

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:
 (CIFRAS EN MILES DE PESOS)

ACTIVO	2021	2020	PASIVO	2021	2020
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
BANCOS MONEDA NACIONAL	1,100	1,100			
BANCO MONEDAS EXTRANJERAS	22,829	25,031	PROVISIONES PARA GASTOS	1,471	2,368
DIVISAS POR RECIBIR	-	131			
	23,929	26,262	TOTAL PASIVO	1,471	2,368
INVERSIONES					
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	4,039,788	3,668,821			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	1,582,717	568,055			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	5,070,542	4,662,340			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	1,229,813	994,750			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	10,130,051	9,021,721			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	189,645	208,334			
DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	2,335			
PLUS (MINUS) VALÍA DEPÓSITO TRASPASO BANXICO	-	1			
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	214,688	242,442			
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	50,324	107,717			
INVERSIÓN EN FIBRAS	926,755	445,433			
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	13,519	(13,068)			
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	1,310,783	2,126,733			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	111,053	122,369			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	409,061	409,061			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	924,660	1,172,990			
	26,203,399	23,740,033			
DEUDORES DIVERSOS					
LIQUIDADORA	7,663	-			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	-	154			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	75,244	62,170			
REPORTOS	557,738	866,512			
	640,644	928,836			
			CAPITAL CONTABLE		
			CAPITAL		
			CAPITAL CONTRIBUIDO	1,486,089	1,102,347
			CAPITAL SOCIAL PAGADO	11,782,301	11,606,150
			PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	(10,296,213)	(10,503,803)
			CAPITAL GANADO	21,278,681	20,429,268
			RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	20,429,268	19,334,378
			RESULTADO DEL EJERCICIO	849,413	1,094,891
			OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
			PLUS(MINUS) VALÍAS	4,101,731	3,161,148
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	26,866,500	24,692,762
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	26,867,972	24,695,131
CUENTAS DE ORDEN					
VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	26,203,399	23,740,033	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	18,000,100	18,000,100
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	557,779	865,726	ACCIONES EMITIDAS	18,000,027,060	18,000,027,060
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	1,107	1,257	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	55,739,426	55,739,427
DÓLAR AMERICANO	1,044	1,257	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	62	-	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	3,135,013,321	3,087,309,875
DIVISAS POR RECIBIR	-	5			
EUROS	-	5			
LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:					
UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	4,101,731	3,161,148			
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	26,866,500	24,692,762			
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.420114	7.856308			

 MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
 CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

 JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ SANTOS
 DIRECTOR GENERAL

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIFORE BÁSICA 75-79, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL

(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

POR LOS PERIODOS AL 31 DE DICIEMBRE DE:

	2021	2020
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	25,553,842	32,171,361
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	486,618	416,215
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	3,915	(1,029)
INGRESOS NETOS	26,044,375	32,586,548
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	24,972,113	31,288,018
GASTOS GENERALES	2,268	3,016
COMISIONES SOBRE SALDOS	220,582	200,623
EGRESOS NETOS	25,194,962	31,491,657
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	849,413	1,094,891
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	940,583	884,012
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,789,996	1,978,903

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
CONTADOR GENERAL DE SIFORE

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS CONTENIDOS SON
 AUTÉNTICOS Y VERACES

JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ SANTOS
DIRECTOR GENERAL

DECLARO BAJO PROTESTA DE DECIR VERDAD QUE LOS DATOS
 CONTENIDOS SON AUTÉNTICOS Y VERACES

EL PRESENTE ESTADO FINANCIERO SE FORMULÓ DE CONFORMIDAD CON LAS REGLAS DE AGRUPACIÓN DE CUENTAS ESTABLECIDAS POR LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO Y BAJO LA ESTRICTA RESPONSABILIDAD DE LOS FUNCIONARIOS QUE SUSCRIBEN.

ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO FINANCIERO.

La Sociedad de Inversión deberá cumplir con la Trayectoria de Inversión definida para cada trimestre, acorde al perfil de edad de los Trabajadores y la estrategia de inversión de largo plazo definida por el Comité de Inversión, de igual forma deberá cumplir con los límites autorizados de régimen de inversión de CONSAR.

El Consejo de Administración de Afore Inbursa, ha constituido un Comité de Riesgos Financieros cuyo objeto es el establecimiento y vigilancia del marco prudencial para la administración de los riesgos a los que se encuentra expuesta la Sociedad de Inversión, así tenemos los siguientes:

Riesgo de Mercado.- Es la pérdida potencial en el valor de los Activos Objeto de Inversión debido a movimientos adversos en los factores que determinan su precio. Es administrado a través de metodologías de Valor en Riesgo (VaR). Entendiendo al VaR como la pérdida máxima esperada en un horizonte de tiempo determinado dentro de un nivel de confianza dado. El 31 de diciembre de 2021 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.40%. Como medidas complementarias al VaR, se realizan pruebas bajo escenarios de estrés que consisten en la estimación de las pérdidas que podría sufrir el portafolio ante movimientos de mercado adversos.

Riesgo de Crédito.- Es la pérdida potencial que asume la Sociedad de Inversión como consecuencia del incumplimiento de las obligaciones contractuales de las contrapartes y/o emisores. Es administrado a través de la metodología de VaR de Crédito, definido como la suma de la Pérdida Esperada y la Pérdida no Esperada de los Activos Objeto de Inversión y de las Contrapartes, que cuenten con una calificación crediticia otorgada por una Agencia Calificadora. El 31 de diciembre de 2021 el VaR de Crédito ascendió a 0.36% encontrándose dentro del límite prudencial autorizado.

Riesgo de Liquidez.- Es la pérdida esperada por la venta anticipada o forzosa de un Activo Objeto de inversión a descuentos inusuales debido a condiciones extraordinarias de mercado. El modelo para la estimación del Riesgo de Liquidez, consiste en analizar los niveles de operación de los spreads observados en el mercado para cada Activo Objeto de Inversión y a partir de estos, obtener indicadores de descuentos o castigos en caso de estar en la necesidad de liquidar la posición a precios de mercado en una fecha determinada. Adicionalmente la Sociedad de Inversión en caso de contar con posiciones en Derivados deberá cumplir con el nivel diario de Coeficiente de Liquidez. El 31 de diciembre de 2021 se reportó un Riesgo de Liquidez de 0.27% encontrándose dentro de los límites prudencial autorizado.

Riesgo Operativo.- A la posibilidad de ocurrencia de pérdidas por deficiencias o fallas en los procesos operativos, en la tecnología de información, en los recursos humanos o cualquier otro evento externo adverso relacionado con el proceso de inversión, entre los cuales se encuentran comprendidos los siguientes tipos: Legal, Tecnológico y Procesos Operativos. Este riesgo es administrado a través de la estimación de las pérdidas por la materialización de dichos riesgos y el establecimiento de controles preventivos en los procesos.

Para mayor detalle de las características y resultados de la administración integral de riesgos de la Sociedad de Inversión, favor de consultar la página de Internet de Afore Inbursa www.inbursa.com.