

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE:

(CIFRAS EN MILES DE PESOS)

ACTIVO	2022	2021	PASIVO	2022	2021
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
BANCOS MONEDA NACIONAL	500	500			
BANCOS MONEDA EXTRANJERA	1,590	707	PROVISIONES PARA GASTOS	52	48
	2,090	1,207	TOTAL PASIVO	52	48
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE		
INVERSIÓN EN VAL. DE RENTA VARIABLE	229,636	201,472			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. RENTA VARIABLE	29,846	49,953	CAPITAL		
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	239,643	124,197	CAPITAL CONTRIBUIDO	957,007	759,146
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. DE TASA REAL PESOS Y UDIS	20,871	16,559	CAPITAL SOCIAL PAGADO	917,940	748,440
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL PESOS	381,019	363,087	PRIMA EN VENTA DE ACCIONES	39,067	10,706
PLUS (MINUS) VALÍA EN INST. DEUDA NAC. TASA NOM. PESOS	14,124	5,471	CAPITAL GANADO	64,779	31,496
INVERSIÓN EN INST. DEUDA NAC. DE TASA NOMINAL DIVISAS	32,094	8,360	RESULTADO DE EJERCICIOS ANTERIORES	31,496	16,091
PLUS (MINUS) VALÍA INST. DEUDA NAC. TASA NOM. DIVISAS	(2,300)	1,151	RESULTADO DEL EJERCICIO	33,284	15,404
INVERSIÓN EN FIBRAS	53,800	25,542	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍA EN INV. EN FIBRAS	804	(4)	PLUS(MINUS) VALÍAS	76,735	87,395
INVERSIÓN EN VALORES EXTRANJEROS DEUDA	37,089	29,362			
PLUS (MINUS) VALÍA EN VAL. EXT. DEUDA	23	2,211			
INVERSIÓN EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	5,370	5,370			
PLUS (MINUS) VALÍA EN TÍTULOS FIDUCIARIOS	13,368	12,055			
	1,055,385	844,784			
DEUDORES DIVERSOS			TOTAL CAPITAL CONTABLE	1,098,521	878,036
LIQUIDADORA	-	131			
DIVIDENDOS O DERECHOS POR COBRAR	24	-			
INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES	3,900	1,506			
REPORTOS	37,173	30,457			
	41,097	32,094	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	1,098,572	878,085
TOTAL ACTIVO	1,098,572	878,085			

CUENTAS DE ORDEN

VALORES ENTREGADOS EN CUSTODIA	1,055,385	844,784	CAPITAL SOCIAL AUTORIZADO	300,000,100	300,000,100
COLATERALES RECIBIDOS POR REPORTO	37,203	30,459	ACCIONES EMITIDAS	41,298,612,409	41,298,612,409
BANCOS DIVISAS MONEDA EXTRANJERA	81	34	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, POSICIÓN PROPIA	1,051,336	1,051,336
DÓLAR AMERICANO	79	33	ACCIONES DE SIEFORES, POSICIÓN DE TERCEROS	1	1
EUROS	2	2	ACCIONES EN CIRCULACIÓN, PROPIEDAD DE LOS TRABAJADORES	125,314,149	101,980,453

LA SOCIEDAD VALUADORA DE ESTA SOCIEDAD DE INVERSIÓN DETERMINÓ:

UNA PLUS (MINUS) VALÍA DE:	76,735	87,395
UN VALOR DE LOS ACTIVOS NETOS DE:	1,098,521	878,036
EL PRECIO DE LA ACCIÓN DE:	8.693202	8.521996

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

LOS PRESENTES ESTADOS FINANCIEROS HAN SIDO FORMULADOS DE ACUERDO A 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.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO
INBURSA SIEFORE BÁSICA INICIAL, 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:

	2022	2021
INGRESOS POR LA VENTA DE VALORES	807,796	812,774
INTERESES, DIVIDENDOS, PREMIOS Y DERECHOS	24,051	11,431
RESULTADO CAMBIARIO / OTROS PRODUCTOS	26	13
INGRESOS NETOS	831,872	824,218
-		
COSTO DE VENTAS DE VALORES	792,931	802,767
GASTOS GENERALES	47	113
COMISIONES SOBRE SALDOS	5,611	5,934
EGRESOS NETOS	798,589	808,813
=		
UTILIDAD DE OPERACIÓN	33,284	15,404
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	(10,660)	39,480
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	22,623	54,885

MARIO ORDOÑEZ RODRÍGUEZ
CONTADOR GENERAL DE SIEFORE

JOSÉ IGNACIO JIMÉNEZ SANTOS
DIRECTOR GENERAL

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

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 2022 el VaR Histórico a un día reportado fue de 0.46%. 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 2022 el VaR de Crédito ascendió a 0.13% 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 2022 se reportó un Riesgo de Liquidez de 1.51% 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.