



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GENERA	*	ALTA	3,132,437	82,696,336.80	16.38
1	FEMSA	UBD	ALTA	381,515	76,768,448.30	15.20
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,137,389	67,042,926.45	13.28
1	OMA	B	ALTA	205,256	37,804,050.08	7.49
1	NEMAK	A	MEDIA	9,129,058	27,569,755.16	5.46
1	KIMBER	A	ALTA	690,893	25,873,942.85	5.12
1	VOLAR	A	ALTA	1,757,379	25,025,076.96	4.96
1	LAB	B	ALTA	1,408,948	23,881,668.60	4.73
1	ALSEA	*	ALTA	306,338	21,664,223.36	4.29
1	GMEXICO	B	ALTA	145,043	15,349,900.69	3.04
1	AMX	B	ALTA	815,324	13,444,692.76	2.66
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	2,651,226	67,394,164.92	13.35
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	533,311	17,284,609.51	3.42
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					501,799,796.44	99.37
OTROS VALORES				429,772	3,179,672.32	0.63
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					504,979,468.76	100.00

CATEGORÍA
ESRV

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.613%

Límite de VaR
3.083%

El VaR es calculado a través del modelo de simulación histórica considerando 512 días y se calcula con un nivel de confianza 95% a una cola y un horizonte de 1 día.

Guillermo José de la Fuente Morales