



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	GENERA	*	ALTA	3,371,377	88,768,356.41	17.97
1	FEMSA	UBD	ALTA	409,432	79,650,901.28	16.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,137,389	65,604,457.53	13.28
1	OMA	B	ALTA	181,626	31,457,623.20	6.37
1	NEMAK	A	MEDIA	9,129,058	30,125,891.40	6.10
1	ALSEA	*	ALTA	406,438	27,442,693.76	5.56
1	LAB	B	ALTA	1,408,948	25,037,005.96	5.07
1	KIMBER	A	ALTA	685,453	24,395,272.27	4.94
1	VOLAR	A	ALTA	1,757,379	23,830,059.24	4.82
1	AMX	B	ALTA	695,557	10,934,156.04	2.21
<b>FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA</b>						
CF	FUNO	11	ALTA	2,768,889	67,062,491.58	13.57
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	468,531	14,894,600.49	3.02
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					489,203,509.16	99.02
<b>OTROS VALORES</b>				45,936	4,817,767.68	0.98
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					494,021,276.84	100.00

CATEGORÍA  
ESRV

CALIFICACIÓN  
NA

VaR Promedio  
1.579%

Límite de VaR  
3.028%

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