



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	388,264	25,159,507.20	4.83
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GENERA	*	ALTA	3,082,217	87,689,073.65	16.82
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,492,884	80,580,608.28	15.46
1	FEMSA	UBD	ALTA	247,625	53,397,855.00	10.24
1	OMA	B	ALTA	267,656	43,737,666.96	8.39
1	KIMBER	A	ALTA	787,888	30,412,476.80	5.83
1	NEMAK	A	MEDIA	7,633,558	25,114,405.82	4.82
1	ALSEA	*	ALTA	292,738	23,998,661.24	4.60
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	159,378	22,983,901.38	4.41
1	AMX	B	ALTA	1,184,289	18,451,222.62	3.54
1	LAB	B	ALTA	1,090,718	17,211,530.04	3.30
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	2,376,395	65,612,265.95	12.59
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	578,311	18,656,312.86	3.58
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					513,005,487.80	98.40
OTROS VALORES				1,195,308	8,337,593.54	1.60
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>521,343,081.34</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
ESRV

CALIFICACIÓN  
NA

VaR Promedio

1.63%

Límite de VaR

3.08%

El VaR es calculado a través del modelo de simulacion historica considerando 512 dias y se calcula con un nivel de confianza 95% a una cola y un horizonte de 1 dia.

---

Guillermo José de la Fuente Morales