



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	699,044	38,573,247.92	9.80
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	453,968	92,636,710.08	23.54
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,257,010	46,103,418.30	11.71
1	GENTERA	*	ALTA	2,098,964	40,132,191.68	10.20
1	AMX	B	ALTA	2,144,905	31,937,635.45	8.11
1	OMA	B	ALTA	217,978	30,000,312.14	7.62
1	ALSEA	*	ALTA	490,021	29,273,854.54	7.44
1	NEMAK	A	MEDIA	5,375,103	17,146,578.57	4.36
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	136,122	12,476,942.52	3.17
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	1,540,170	42,154,452.90	10.71
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	416,390	11,633,936.60	2.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					392,069,280.70	99.61
OTROS VALORES				859,985	1,534,893.54	0.39
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					393,604,174.24	100.00

CATEGORÍA
ESRV

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.535%

Límite de VaR
3.127%

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