



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 2023**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	663,114	37,817,391.42	8.98
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	453,968	99,142,071.52	23.54
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,570,310	54,112,470.40	12.85
1	GENTERA	*	ALTA	2,317,664	43,247,610.24	10.27
1	OMA	B	ALTA	271,678	40,939,157.82	9.72
1	ALSEA	*	ALTA	455,521	27,417,808.99	6.51
1	AMX	B	ALTA	1,692,945	25,817,411.25	6.13
1	NEMAK	A	MEDIA	5,375,103	21,930,420.24	5.21
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	136,122	13,118,077.14	3.11
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	1,540,170	44,095,067.10	10.47
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	416,390	12,679,075.50	3.01
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>420,316,561.62</b>	<b>99.80</b>
<b>OTROS VALORES</b>				60,760	<b>863,410.80</b>	0.21
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>421,179,972.42</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
ESRV

CALIFICACIÓN  
NA

VaR Promedio  
1.554%

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