



**BTGALFA BTG PACTUAL FONDO ALFA CONCENTRADO, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 2022**

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|--------|-----------------------|---------------|-----------------------|--------------------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | | |
| DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN | | | | | | |
| CHM | BMIFEL | 429880 | | 520,192 | 520,280.17 | 0.19 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 520,280.17 | 0.19 |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | | |
| EMPRESAS MATERIALES | | | | | | |
| 1 | CEMEX | CPO | ALTA | 2,883,305 | 22,576,278.15 | 8.25 |
| 1 | GMEXICO | B | ALTA | 35,645 | 2,968,159.15 | 1.08 |
| EMPRESAS INDUSTRIALES | | | | | | |
| 1 | GAP | B | ALTA | 20 | 5,601.80 | 0.00 |
| 1 | OMA | B | ALTA | 125,745 | 16,173,321.90 | 5.91 |
| 1 | ORBIA | * | ALTA | 55,834 | 2,627,548.04 | 0.96 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO | | | | | | |
| 1 | ALSEA | * | ALTA | 561,300 | 21,374,304.00 | 7.81 |
| 1 | LIVEPOL | C-1 | ALTA | 156,780 | 13,641,427.80 | 4.98 |
| 1 | NEMAK | A | ALTA | 3,272,083 | 13,022,890.34 | 4.76 |
| EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE | | | | | | |
| 1 | AC | * | ALTA | 15,800 | 2,093,500.00 | 0.77 |
| 1 | CHDRAUI | B | ALTA | 212,450 | 11,561,529.00 | 4.22 |
| 1 | FEMSA | UBD | ALTA | 416,190 | 56,501,954.40 | 20.65 |
| 1 | KIMBER | A | ALTA | 2 | 54.46 | 0 |
| EMPRESAS DE SALUD | | | | | | |
| 1 | LAB | B | ALTA | 640,580 | 12,894,875.40 | 4.71 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS | | | | | | |
| CF | FUNO | | 11 ALTA | 37,838 | 757,895.14 | 0.28 |
| 1 | GENTERA | * | ALTA | 1,464,650 | 23,595,511.50 | 8.62 |
| 1 | GFNORTE | O | ALTA | 340,370 | 38,179,302.90 | 13.95 |
| 1 | R | A | ALTA | 9,400 | 893,846.00 | 0.33 |
| 41 | BBAJIO | O | ALTA | 745,805 | 30,063,399.55 | 10.99 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES | | | | | | |
| 1 | AMX | L | ALTA | 205,465 | 4,222,305.75 | 1.54 |
| TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | 273,153,705.28 | 99.81 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 273,153,705.28 | 99.81 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 273,673,985.45 | 100 |

CATEGORÍA
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

| | | |
|--------------|--------------|---------------|
| CALIFICACIÓN | VaR Promedio | Límite de VaR |
| NA | 1.70% | 3.18% |

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