

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 Data: 2019-12-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
SEM CLASSIFICAÇÃO					
SGLT LET 0 17042020	56.00	1 001.47	1 001.47		56 082.32
PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS					
1. Valores Mobiliários Cotados					
1.2. Mercado de Cot.Oficiais de Bolsa V.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BTPS 3.75% 01092024	20.00	1 145.19	1 145.19	249.31	23 153.11
SPGB 1.6% 2025	74.00	1 085.00	1 085.00	792.57	81 082.57
DBR 0.5% 15022025	1 300 000.00	0.01	0.01	56.81	13 711.36
FRTR 2.5% 25102020	118 000.00	1.03	1.03	540.03	121 527.79
BTPS 2% 01122025	5.00	1 069.15	1 069.15	8.20	5 353.96
BTPS 1.45% 15092022	33.00	1 035.11	1 035.11	140.66	34 299.29
BGB 0.2% 22102023	1 490 700.00	0.01	0.01	5.70	15 275.54
FRTRR 0 25/05/2020	79 000.00	1.00	1.00		79 167.48
RFGB 0 15092023	11.00	1 017.16	1 017.16		11 188.76
SPGB 1.5% 30042027	18.00	1 092.06	1 092.06	180.74	19 837.82
SPGB 2.7% 31102048	11.00	1 327.03	1 327.03	49.50	14 646.83
SPBG 1.4% 30072028	29.00	1 087.59	1 087.59	170.83	31 710.94
BTPS 2.45 01102023	70.00	1 076.63	1 076.63	426.41	75 790.51
BTPS 3.85 01092049	7.00	1 291.09	1 291.09	89.59	9 127.24
RFGB 0.5% 15092029	12.00	1 043.72	1 043.72	17.54	12 542.18
IRISH 1.5% 15052050	974 700.00	0.01	0.01	91.48	11 199.70
SGLT LET 0 080520	56.00	1 001.82	1 001.82		56 101.92
SGLT LET 0 120620	56.00	1 001.88	1 001.88		56 105.28
BTPS 2.5% 15112025	81.00	1 095.86	1 095.86	255.91	89 020.57
RAGB 0 15072024	44.00	1 016.80	1 016.80		44 739.20
SGLT LET 0 120720	55.00	1 002.35	1 002.35		55 129.25
BGB 1.7% 22062050	1 400 000.00	0.01	0.01	124.85	16 973.15
SGLT LET 0 14022020	56.00	1 000.74	1 000.74		56 041.44
BTPS 2.1% 15072026	31.00	1 073.00	1 073.00	298.96	33 561.96
RFGB 0 15092024	56.00	1 016.77	1 016.77		56 939.30
SGLT LET 0 06032020	73.00	1 001.01	1 001.01		73 073.73
SGLT LET 0 11092020	73.00	1 003.17	1 003.17		73 231.41
BKO 0 11092020	18 600 000.00	0.01	0.01		186 890.94
BTPS 1.75 01072024	52.00	1 052.56	1 052.56	452.53	55 185.81
DBR 0 20290815	2 700 000.00	0.01	0.01		27 507.87
SPGB 1.85% 30072035	20.00	1 142.23	1 142.23	155.68	23 000.28
SGLT LET 0 14082020	73.00	1 002.91	1 002.91		73 212.43
Sub-total:					1 536 329.62
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	12.00	1 018.10	1 018.10	36.15	12 253.35
KFW 0.625% 07012028	19.00	1 051.25	1 051.25	116.47	20 090.22
ESM 0.125 22042024	2 000 000.00	0.01	0.01	17.28	20 331.28
KFW 0.01 05052027	39.00	1 005.30	1 005.30	2.38	39 209.08
EFSF 0 17072023	43.00	1 011.00	1 011.00		43 473.00
Sub-total:					135 356.93
Sub-total:					1 671 686.55
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	1 594.00	153.95	153.95		245 391.52
ISHARES BG EURO CORP	2 219.00	134.15	134.15		297 678.85
AMUNDI 6 M-I	5.00	22 489.64	22 489.64		112 448.20
ISHARES MSCI EUROPE	7 685.00	25.81	25.81		198 311.43
DBX MSCI EUROPE	3 085.00	64.75	64.75		199 753.75
DBX MSCI JAPAN - 1C	46.00	6 987.00	57.30		2 635.74
LYXOR UCITS ETF S&P	2 515.00	32.83	29.22		73 495.02
VANGUARD S&P 500 UCI	675.00	61.14	54.42		36 733.24
ISHARES CORE S&P 500	129.00	320.30	285.12		36 780.04
DBX S&P 500 ACC	1 387.00	59.52	52.98		73 486.06

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 Data: 2019-12-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CORE MSCI JA	65.00	4 874.00	39.97		2 598.08
AMUNDI ETF MSCI EURO	835.00	245.32	245.32		204 841.62
AMUNDI S&P500 UCITS	1 402.00	58.79	52.33		73 364.76
GAM LOCAL EMERG BD-E	284.00	131.97	131.97		37 479.48
X MSCI EMERGING MARK	194.00	47.24	47.24		9 164.75
AMUNDI EMER MKTS BI2	44.00	1 256.59	1 256.59		55 289.96
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	100.12	100.12		120 344.72
Sub-total:					1 779 797.23
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					272 138.01
Sub-total:					272 138.01
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-9 953.21
Sub-total:					-9 953.21
Sub-total:					262 184.80
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
MAR20 IMM EMINI EURO	2.00				
MSCI WORLD0320	2.00				
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	3 769 750.90

Unidades de Participação em circulação: 559 672.42
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.7356

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 Data: 2019-09-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
SEM CLASSIFICAÇÃO					
SGLT LET 0 17042020	56.00	1 002.86	1 002.86		56 160.16
PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS					
1. Valores Mobiliários Cotados					
1.2. Mercado de Cot.Oficiais de Bolsa V.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
NETHER 2.0% 15072024	76 000.00	1.13	1.13	319.78	86 322.90
BTPS 3.75% 01092024	20.00	1 170.60	1 170.60	59.75	23 471.75
SPGB 1.6% 2025	72.00	1 102.40	1 102.40	481.57	79 854.37
FRTR 2.5% 25102020	42 000.00	1.03	1.03	978.08	44 388.02
BTPS 2% 01122025	5.00	1 097.53	1 097.53	33.06	5 520.71
BTPS 1.45% 15092022	33.00	1 045.51	1 045.51	19.72	34 521.55
BGB 0.2% 22102023	1 490 700.00	0.01	0.01	28.02	15 447.52
FRTRR 0 25/05/2020	77 000.00	1.00	1.00		77 294.91
FRTRR 0 25/05/2021	45 000.00	1.01	1.01		45 518.85
RFGB 0 15092023	11.00	1 026.60	1 026.60		11 292.60
SPGB 1.5% 30042027	18.00	1 115.30	1 115.30	112.87	20 188.27
BTPS 1.2% 01042022	36.00	1 033.78	1 033.78	214.82	37 430.90
SPGB 2.7% 31102048	11.00	1 410.86	1 410.86	271.78	15 791.24
BTPS 0.95% 01032023				26.49	26.49
BTPS 2.45 01102023	47.00	1 093.55	1 093.55	572.60	51 969.45
SGLT LET 0 15112019	56.00	1 000.67	1 000.67		56 037.52
BTPS 3.85 01092049	7.00	1 441.66	1 441.66	21.47	10 113.09
SGLT LET 0 17012020	26.00	1 001.57	1 001.57		26 040.82
BOTS LET 0 14042020	53.00	1 001.29	1 001.29		53 068.37
RFGB 0.5% 15092029	38.00	1 081.17	1 081.17	7.79	41 092.25
ICTZ LET 0 29062021	15.00	1 003.16	1 003.16		15 047.40
IRISH 1.5% 15052050	374 700.00	0.01	0.01	21.04	4 483.53
SPGB 0.6% 311029	26.00	1 044.74	1 044.74	47.01	27 210.25
SGLT LET 0 080520	56.00	1 003.16	1 003.16		56 176.96
SGLT LET 0 120620	56.00	1 003.52	1 003.52		56 197.12
BTPS 2.5% 15112025	56.00	1 125.77	1 125.77	525.00	63 568.12
RAGB 0 15072024	43.00	1 029.70	1 029.70		44 277.10
BTPS 1% 15072022	58.00	1 030.70	1 030.70	121.36	59 901.96
BGB 1.7% 22062050	1 400 000.00	0.01	0.01	65.03	18 617.83
SGLT LET 0 14022020	56.00	1 002.04	1 002.04		56 114.24
SGLT LET 0 06122019	56.00	1 000.98	1 000.98		56 054.88
BTPS 2.1% 15072026	30.00	1 106.37	1 106.37	131.82	33 322.92
RFGB 0 15092024	54.00	1 030.25	1 030.25		55 633.50
BKO 0 11092020	18 300 000.00	0.01	0.01		184 189.50
BTPS 1.75 01072024	24.00	1 072.60	1 072.60		25 742.40
Sub-total:					1 491 929.29
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	12.00	1 024.45	1 024.45	193.32	12 486.72
KFW 0.625% 07012028	19.00	1 083.05	1 083.05	86.54	20 664.49
ESM 0.125 22042024	2 000 000.00	0.01	0.01	11.00	20 605.20
KFW 0.01 05052027	38.00	1 034.01	1 034.01	1.36	39 293.74
EFSF 0.05% 17102029	37.00	1 029.60	1 029.60	3.79	38 098.99
Sub-total:					131 149.14
Sub-total:					1 623 078.43
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	1 594.00	154.79	154.79		246 728.88
ISHARES BG EURO CORP	2 219.00	134.83	134.83		299 187.77
AMUNDI 6 M-I	12.00	22 494.45	22 494.45		269 933.40
ISHARES MSCI EUROPE	8 100.00	24.58	24.58		199 098.00
DBX MSCI EUROPE	3 290.00	60.74	60.74		199 834.60
DBX MSCI JAPAN - 1C	46.00	6 467.00	55.00		2 529.82
LYXOR UCITS ETF S&P	2 705.00	30.43	27.95		75 599.15

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 Data: 2019-09-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
VANGUARD S&P 500 UCI	734.00	56.48	51.87		38 073.43
ISHARES CORE S&P 500	141.00	294.80	270.73		38 173.20
DBX S&P 500 ACC	1 504.00	54.75	50.28		75 621.27
ISHARES CORE MSCI JA	65.00	4 503.00	38.29		2 489.11
AMUNDI ETF MSCI EURO	883.00	232.47	232.47		205 270.92
AMUNDI S&P500 UCITS	1 521.00	54.14	49.72		75 629.00
GAM LOCAL EMERG BD-E	284.00	129.61	129.61		36 809.24
X MSCI EMERGING MARK	207.00	43.13	43.13		8 927.50
AMUNDI EMER MKTS BI2	44.00	1 231.42	1 231.42		54 182.48
Sub-total:					1 828 087.77
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depósitos a Ordem					148 285.99
Sub-total:					148 285.99
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					1 687.58
Sub-total:					1 687.58
Sub-total:					149 973.57
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
DEC19 IMM EMINI EURO	-2.00				
MSCI WORLD1219	2.00				
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	3 657 299.94
Unidades de Participação em circulação:				545 033.74	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.7102	

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 Data: 2019-06-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS					
1. Valores Mobiliários Cotados					
1.2. Mercado de Cot.Oficiais de Bolsa V.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
SPGB 4.6% 20190730	12.00	1 003.70	1 003.70	506.63	12 551.03
BTPS 3.75% 01092024	20.00	1 117.20	1 117.20	246.60	22 590.60
SPGB 1.6% 2025	66.00	1 096.23	1 096.23	176.00	72 527.18
FRTR 2.5% 25102020	42 000.00	1.04	1.04	713.42	44 453.06
BTPS 2% 01122025	5.00	1 027.30	1 027.30	7.92	5 144.42
BTPS 1.45% 15092022	33.00	1 019.60	1 019.60	139.13	33 785.93
BGB 0.2% 22102023	1 490 700.00	0.01	0.01	20.50	15 394.09
FRTRR 0 25/05/2020	79 000.00	1.01	1.01		79 424.23
FRTRR 0 25/05/2021	46 000.00	1.01	1.01		46 596.62
SPGB 1.5% 30042027	18.00	1 101.30	1 101.30	45.00	19 868.40
BTPS 1.2% 01042022	36.00	1 013.61	1 013.61	106.23	36 596.19
BTPS 0.95% 01032023	35.00	998.90	998.90	109.33	35 070.83
BTPS 2.45 01102023	69.00	1 053.64	1 053.64	415.70	73 116.86
ICTZ LET 0 27112020	58.00	998.32	998.32		57 902.56
BGB 0.9% 22062029	2 700 000.00	0.01	0.01	5.31	29 240.10
BTPS 3.85 01092049	7.00	1 155.54	1 155.54	88.61	8 177.39
FRTR 1.5% 25052050	6 900.00	1.15	1.15	10.18	7 946.08
SGLT LET 0 17012020	60.00	1 002.49	1 002.49		60 149.40
BOTS LET 0 14042020	60.00	1 000.32	1 000.32		60 019.20
RFGB 0.5% 15092029	39.00	1 053.46	1 053.46	73.73	41 158.67
ICTZ LET 0 29062021	15.00	991.70	991.70		14 875.50
IRISH 1.5% 15052050	774 700.00	0.01	0.01	14.29	8 542.11
NETHER 0.5% 15012040	20 300.00	1.05	1.05	10.57	21 313.19
BOTS LET 0 13032020	47.00	1 000.34	1 000.34		47 015.98
SPGB 0.6% 311029	73.00	1 013.90	1 013.90	21.60	74 036.30
BTPS 2.5% 15112025	34.00	1 055.82	1 055.82	106.25	36 004.13
OBL 0 07102022	6 207 900.00	0.01	0.01		63 612.35
RAGB 0 15072024	38.00	1 023.60	1 023.60		38 896.80
Sub-total:					1 066 009.20
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	12.00	1 030.70	1 030.70	140.38	12 508.78
MADRID 0.747 300422	17.00	1 027.24	1 027.24	21.17	17 484.25
EFSF 0.125% 17102023	43.00	1 024.21	1 024.21	37.70	44 078.73
KFW 0.625% 07012028	19.00	1 064.18	1 064.18	56.61	20 276.03
ESM 0.125 22042024	2 000 000.00	0.01	0.01	4.71	20 511.91
KFW 0.01 05052027	38.00	1 016.31	1 016.31	0.40	38 620.18
Sub-total:					153 479.88
Sub-total:					1 219 489.08
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	1 189.00	153.37	153.37		182 356.93
ISHARES BG EURO CORP	2 219.00	133.94	133.94		297 212.86
AXA IM FIIS-US SHDUR	121.00	171.99	171.99		20 810.79
ISHARES MSCI EUROPE	11 625.00	24.27	24.27		282 080.63
DBX MSCI EUROPE	2 606.00	59.40	59.40		154 796.40
LYXOR UCITS ETF S&P	3 143.00	30.13	26.47		83 201.12
DBX S&P 500 ACC	3 217.00	53.67	47.16		151 719.15
AMUNDI ETF MSCI EURO	1 247.00	226.57	226.57		282 532.91
MFS MER-EMERG MARK D	605.00	142.33	142.33		86 109.65
AMUNDI S&P500 UCITS	3 254.00	53.08	46.64		151 776.22
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	2 170.00	154.69	154.69		335 677.30
X MSCI EMERGING MARK	1 123.00	43.09	43.09		48 384.46
Sub-total:					2 076 658.42
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2019-06-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
Depositos a Ordem					360 997.10
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-46 482.97
Sub-total:					-46 482.97
Sub-total:					314 514.13
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 610 661.63
Unidades de Participação em circulação:			546 159.05		
Valor Unitário de Unidades de Participação:			6.6110		

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2019-03-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
Outros					-86 000.02
Sub-total:					-86 000.02
Sub-total:					340 897.21
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 566 918.48
Unidades de Participação em circulação:			546 800.45		
Valor Unitário de Unidades de Participação:			6.5233		