

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

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					
BTPS 3.75% 01092024	11.00	1 145.19	1 145.19	137.12	12 734.21
SPGB 1.6% 2025	40.00	1 085.00	1 085.00	428.42	43 828.42
DBR 0.5% 15022025	700 000.00	0.01	0.01	30.59	7 383.04
FRTR 2.5% 25102020	65 000.00	1.03	1.03	297.47	66 943.27
BTPS 2% 01122025	3.00	1 069.15	1 069.15	4.92	3 212.38
BTPS 1.45% 15092022	18.00	1 035.11	1 035.11	76.72	18 708.70
BGB 0.2% 22102023	822 700.00	0.01	0.01	3.15	8 430.40
FRTRR 0 25/05/2020	42 000.00	1.00	1.00		42 089.04
RFGB 0 15092023	6.00	1 017.16	1 017.16		6 102.96
SPGB 1.5% 30042027	10.00	1 092.06	1 092.06	100.41	11 021.01
SPGB 2.7% 31102048	6.00	1 327.03	1 327.03	27.00	7 989.18
SPBG 1.4% 30072028	16.00	1 087.59	1 087.59	94.25	17 495.69
BTPS 2.45 01102023	38.00	1 076.63	1 076.63	231.48	41 143.42
BTPS 3.85 01092049	4.00	1 291.09	1 291.09	51.19	5 215.56
RFGB 0.5% 15092029	7.00	1 043.72	1 043.72	10.23	7 316.27
IRISH 1.5% 15052050	522 600.00	0.01	0.01	49.05	6 004.89
SGLT LET 0 080520	30.00	1 001.82	1 001.82		30 054.60
SGLT LET 0 120620	30.00	1 001.88	1 001.88		30 056.40
BTPS 2.5% 15112025	44.00	1 095.86	1 095.86	139.01	48 356.85
RAGB 0 15072024	23.00	1 016.80	1 016.80		23 386.40
SGLT LET 0 120720	40.00	1 002.35	1 002.35		40 094.00
BGB 1.7% 22062050	800 000.00	0.01	0.01	71.34	9 698.94
BTPS 2.1% 15072026	16.00	1 073.00	1 073.00	154.30	17 322.30
RFGB 0 15092024	30.00	1 016.77	1 016.77		30 503.20
SGLT LET 0 06032020	39.00	1 001.01	1 001.01		39 039.39
SGLT LET 0 11092020	40.00	1 003.17	1 003.17		40 126.80
BKO 0 11092020	10 200 000.00	0.01	0.01		102 488.58
BTPS 1.75 01072024	28.00	1 052.56	1 052.56	243.67	29 715.44
DBR 0 20290815	1 400 000.00	0.01	0.01		14 263.34
SPGB 1.85% 30072035	11.00	1 142.23	1 142.23	85.63	12 650.16
SGLT LET 0 14082020	40.00	1 002.91	1 002.91		40 116.40
Sub-total:					813 491.24
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	7.00	1 018.10	1 018.10	21.09	7 147.79
KFW 0.625% 07012028	10.00	1 051.25	1 051.25	61.30	10 573.80
ESM 0.125 22042024	1 100 000.00	0.01	0.01	9.50	11 182.20
KFW 0.01 05052027	21.00	1 005.30	1 005.30	1.28	21 112.58
EFSF 0 17072023	24.00	1 011.00	1 011.00		24 264.00
Sub-total:					74 280.37
Sub-total:					887 771.61
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	853.00	153.95	153.95		131 316.79
ISHARES BG EURO CORP	1 199.00	134.15	134.15		160 845.85
AXA IM FIIS-US SHIDUR	225.00	173.34	173.34		39 001.50
AMUNDI 6 M-I	3.00	22 489.64	22 489.64		67 468.92
ISHARES MSCI EUROPE	4 098.00	25.81	25.81		105 748.89
DBX MSCI EUROPE	1 646.00	64.75	64.75		106 578.50
DBX MSCI JAPAN - 1C	24.00	6 987.00	57.30		1 375.17
LYXOR UCITS ETF S&P	1 341.00	32.83	29.22		39 187.60
VANGUARD S&P 500 UCI	360.00	61.14	54.42		19 591.06
ISHARES CORE S&P 500	69.00	320.30	285.12		19 673.05
DBX S&P 500 ACC	740.00	59.52	52.98		39 206.69
ISHARES CORE MSCI JA	35.00	4 874.00	39.97		1 398.97
AMUNDI ETF MSCI EURO	443.00	245.32	245.32		108 676.45

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

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AMUNDI S&P500 UCITS	748.00	58.79	52.33		39 141.83
GAM LOCAL EMERG BD-E	153.00	131.97	131.97		20 191.41
X MSCI EMERGING MARK	104.00	47.24	47.24		4 913.06
AMUNDI EMER MKTS BI2	24.00	1 256.59	1 256.59		30 158.16
BNP INSTICASH-EUR-1D	648.00	100.12	100.12		64 878.02
Sub-total:					999 351.92
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					70 673.59
Sub-total:					70 673.59
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-2 909.47
Sub-total:					-2 909.47
Sub-total:					67 764.12
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
MAR20 IMM EMINI EURO	1.00				
MSCI WORLD0320	1.00				
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 954 887.65
Unidades de Participação em circulação:				152 601.54	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				12.8104	

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: CVI PPR
 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	7.00	1 003.70	1 003.70	295.53	7 321.43
BTPS 3.75% 01092024	11.00	1 117.20	1 117.20	135.63	12 424.83
SPGB 1.6% 2025	35.00	1 096.23	1 096.23	93.33	38 461.38
FRTR 2.5% 25102020	23 000.00	1.04	1.04	390.68	24 343.34
BTPS 2% 01122025	3.00	1 027.30	1 027.30	4.75	3 086.65
BTPS 1.45% 15092022	18.00	1 019.60	1 019.60	75.89	18 428.69
BGB 0.2% 22102023	822 700.00	0.01	0.01	11.31	8 495.82
FRTRR 0 25/05/2020	43 000.00	1.01	1.01		43 230.91
FRTRR 0 25/05/2021	26 000.00	1.01	1.01		26 337.22
SPGB 1.5% 30042027	10.00	1 101.30	1 101.30	25.00	11 038.00
BTPS 1.2% 01042022	20.00	1 013.61	1 013.61	59.02	20 331.22
BTPS 0.95% 01032023	19.00	998.90	998.90	59.35	19 038.45
BTPS 2.45 01102023	38.00	1 053.64	1 053.64	228.93	40 267.25
ICTZ LET 0 27112020	32.00	998.32	998.32		31 946.24
BGB 0.9% 22062029	1 400 000.00	0.01	0.01	2.75	15 161.53
BTPS 3.85 01092049	4.00	1 155.54	1 155.54	50.64	4 672.80
FRTR 1.5% 25052050	3 700.00	1.15	1.15	5.46	4 260.94
SGLT LET 0 17012020	32.00	1 002.49	1 002.49		32 079.68
BOTS LET 0 14042020	32.00	1 000.32	1 000.32		32 010.24
RFGB 0.5% 15092029	21.00	1 053.46	1 053.46	39.70	22 162.36
ICTZ LET 0 29062021	14.00	991.70	991.70		13 883.80
IRISH 1.5% 15052050	422 600.00	0.01	0.01	7.79	4 659.73
NETHER 0.5% 15012040	10 875.00	1.05	1.05	5.66	11 417.78
BOTS LET 0 13032020	26.00	1 000.34	1 000.34		26 008.84
SPGB 0.6% 311029	39.00	1 013.90	1 013.90	11.54	39 553.64
BTPS 2.5% 15112025	18.00	1 055.82	1 055.82	56.25	19 061.01
OBL 0 07102022	3 100 000.00	0.01	0.01		31 765.70
RAGB 0 15072024	20.00	1 023.60	1 023.60		20 472.00
Sub-total:					581 921.48
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	7.00	1 030.70	1 030.70	81.89	7 296.79
MADRID 0.747 300422	9.00	1 027.24	1 027.24	11.21	9 256.37
EFSF 0.125% 17102023	24.00	1 024.21	1 024.21	21.04	24 602.08
KFW 0.625% 07012028	11.00	1 064.18	1 064.18	32.77	11 738.75
ESM 0.125 22042024	1 100 000.00	0.01	0.01	2.59	11 281.55
KFW 0.01 05052027	20.00	1 016.31	1 016.31	0.21	20 326.41
Sub-total:					84 501.95
Sub-total:					666 423.43
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	624.00	153.37	153.37		95 702.88
ISHARES BG EURO CORP	1 199.00	133.94	133.94		160 594.06
AXA IM FIIS-US SHDUR	70.00	171.99	171.99		12 039.30
ISHARES MSCI EUROPE	6 262.00	24.27	24.27		151 947.43
DBX MSCI EUROPE	1 404.00	59.40	59.40		83 397.60
LYXOR UCITS ETF S&P	1 693.00	30.13	26.47		44 816.89
DBX S&P 500 ACC	1 733.00	53.67	47.16		81 731.20
AMUNDI ETF MSCI EURO	672.00	226.57	226.57		152 255.11
MFS MER-EMERG MARK D	362.00	142.33	142.33		51 523.46
AMUNDI S&P500 UCITS	1 753.00	53.08	46.64		81 765.13
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	1 164.00	154.69	154.69		180 059.16
X MSCI EMERGING MARK	605.00	43.09	43.09		26 066.43
Sub-total:					1 121 898.65
5. Líquidez					
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: CVI PPR
 Data: 2019-09-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
SEM CLASSIFICAÇÃO					
SGLT LET 0 17042020	30.00	1 002.86	1 002.86		30 085.80
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	41 000.00	1.13	1.13	172.51	46 568.93
BTPS 3.75% 01092024	11.00	1 170.60	1 170.60	32.86	12 909.46
SPGB 1.6% 2025	39.00	1 102.40	1 102.40	260.85	43 254.45
FRTR 2.5% 25102020	22 000.00	1.03	1.03	512.33	23 250.87
BTPS 2% 01122025	3.00	1 097.53	1 097.53	19.84	3 312.43
BTPS 1.45% 15092022	18.00	1 045.51	1 045.51	10.76	18 829.94
BGB 0.2% 22102023	822 700.00	0.01	0.01	15.46	8 525.30
FRTRR 0 25/05/2020	40 000.00	1.00	1.00		40 153.20
FRTRR 0 25/05/2021	24 000.00	1.01	1.01		24 276.72
RFGB 0 15092023	6.00	1 026.60	1 026.60		6 159.60
SPGB 1.5% 30042027	10.00	1 115.30	1 115.30	62.70	11 215.70
BTPS 1.2% 01042022	19.00	1 033.78	1 033.78	113.38	19 755.20
SPGB 2.7% 31102048	6.00	1 410.86	1 410.86	148.24	8 613.40
BTPS 0.95% 01032023				14.38	14.38
BTPS 2.45 01102023	25.00	1 093.55	1 093.55	304.58	27 643.33
SGLT LET 0 15112019	20.00	1 000.67	1 000.67		20 013.40
BTPS 3.85 01092049	4.00	1 441.66	1 441.66	12.27	5 778.91
SGLT LET 0 17012020	14.00	1 001.57	1 001.57		14 021.98
BOTS LET 0 14042020	28.00	1 001.29	1 001.29		28 036.12
RFGB 0.5% 15092029	21.00	1 081.17	1 081.17	4.30	22 708.87
ICTZ LET 0 29062021	14.00	1 003.16	1 003.16		14 044.24
IRISH 1.5% 15052050	222 600.00	0.01	0.01	12.50	2 663.55
SPGB 0.6% 311029	14.00	1 044.74	1 044.74	25.32	14 651.68
SGLT LET 0 080520	30.00	1 003.16	1 003.16		30 094.80
SGLT LET 0 120620	30.00	1 003.52	1 003.52		30 105.60
BTPS 2.5% 15112025	30.00	1 125.77	1 125.77	281.25	34 054.35
RAGB 0 15072024	23.00	1 029.70	1 029.70		23 683.10
BTPS 1% 15072022	30.00	1 030.70	1 030.70	62.77	30 983.77
BGB 1.7% 22062050	800 000.00	0.01	0.01	37.16	10 638.76
SGLT LET 0 14022020	30.00	1 002.04	1 002.04		30 061.20
SGLT LET 0 06122019	30.00	1 000.98	1 000.98		30 029.40
BTPS 2.1% 15072026	16.00	1 106.37	1 106.37	70.30	17 772.22
RFGB 0 15092024	28.00	1 030.25	1 030.25		28 847.00
BKO 0 11092020	9 900 000.00	0.01	0.01		99 643.50
BTPS 1.75 01072024	13.00	1 072.60	1 072.60		13 943.80
Sub-total:					796 259.16
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	7.00	1 024.45	1 024.45	112.77	7 283.92
KFW 0.625% 07012028	10.00	1 083.05	1 083.05	45.55	10 876.05
ESM 0.125 22042024	1 100 000.00	0.01	0.01	6.05	11 332.86
KFW 0.01 05052027	19.00	1 034.01	1 034.01	0.68	19 646.87
EFSF 0.05% 17102029	20.00	1 029.60	1 029.60	2.05	20 594.05
Sub-total:					69 733.75
Sub-total:					865 992.91
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	853.00	154.79	154.79		132 032.46
ISHARES BG EURO CORP	1 199.00	134.83	134.83		161 661.17
AXA IM FIIS-US SHDUR	225.00	172.84	172.84		38 889.00
AMUNDI 6 M-I	6.00	22 494.45	22 494.45		134 966.70
ISHARES MSCI EUROPE	4 367.00	24.58	24.58		107 340.86
DBX MSCI EUROPE	1 774.00	60.74	60.74		107 752.76
DBX MSCI JAPAN - 1C	24.00	6 467.00	55.00		1 319.91

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

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
LYXOR UCITS ETF S&P	1 475.00	30.43	27.95		41 223.20
VANGUARD S&P 500 UCI	396.00	56.48	51.87		20 540.98
ISHARES CORE S&P 500	76.00	294.80	270.73		20 575.63
DBX S&P 500 ACC	820.00	54.75	50.28		41 229.68
ISHARES CORE MSCI JA	35.00	4 503.00	38.29		1 340.29
AMUNDI ETF MSCI EURO	476.00	232.47	232.47		110 655.67
AMUNDI S&P500 UCITS	829.00	54.14	49.72		41 220.54
GAM LOCAL EMERG BD-E	153.00	129.61	129.61		19 830.33
X MSCI EMERGING MARK	111.00	43.13	43.13		4 787.21
AMUNDI EMER MKTS B12	24.00	1 231.42	1 231.42		29 554.08
Sub-total:					1 014 920.46
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depósitos a Ordem					58 621.81
Sub-total:					58 621.81
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					3 841.52
Sub-total:					3 841.52
Sub-total:					62 463.33
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
DEC19 IMM EMINI EURO	-1.00				
MSCI WORLD1219	1.00				
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	1 973 462.50
Unidades de Participação em circulação:		154 950.01			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		12.7361			

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

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
Depositos a Ordem					172 213.92
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-21 278.28
Sub-total:					-21 278.28
Sub-total:					150 935.64
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 939 257.72
Unidades de Participação em circulação:			154 894.69		
Valor Unitário de Unidades de Participação:			12.5198		

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

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	7.00	1 016.28	1 016.28	215.25	7 329.21
RFGB 1.625% 15092022	25.00	1 072.50	1 072.50	219.26	27 031.76
SPGB 3.8% 30042024	13.00	1 180.67	1 180.67	453.40	15 802.11
BTPS 3.75% 01092024	11.00	1 100.79	1 100.79	33.63	12 142.32
SPGB 1.6% 2025	54.00	1 071.96	1 071.96	792.99	58 678.83
BTPS 3.75% 01052021	73.00	1 066.05	1 066.05	1 134.32	78 955.97
FRTR 0.5% 25052025	16 000.00	1.04	1.04	67.95	16 720.27
FRTR 2.5% 25102020	23 000.00	1.05	1.05	247.33	24 353.17
SPGB 4.4% 31/10/2023	4.00	1 196.16	1 196.16	72.81	4 857.45
BTPS 2% 01122025	3.00	1 001.42	1 001.42	19.78	3 024.04
BTPS 1.45% 15092022	18.00	1 011.31	1 011.31	11.35	18 214.93
BGB 0.2% 22102023	4 574 800.00	0.01	0.01	40.11	46 822.01
FRTRR 0 25/05/2020	43 000.00	1.01	1.01		43 264.88
FRTRR 0 25/05/2021	26 000.00	1.01	1.01		26 294.32
SPGB 1.5% 30042027	10.00	1 054.70	1 054.70		10 547.00
BTPS 1.2% 01042022	20.00	1 006.35	1 006.35	119.34	20 246.34
DBR 1% 15082024	900 000.00	0.01	0.01	56.22	9 760.65
IRISH 1.3 15052033	950 200.00	0.01	0.01	117.77	10 071.59
BTPS 0.95% 01032023	19.00	986.90	986.90	14.71	18 765.81
BTPS 2.45 01102023	38.00	1 041.10	1 041.10	462.94	40 024.74
ICTZ LET 0 27112020	32.00	993.54	993.54		31 793.28
BTPS 3.85 01092049	12.00	1 050.10	1 050.10	37.66	12 638.86
NETHER 0.25% 1507202	20 999.00	1.01	1.01	6.47	21 258.72
FRTR 1.5% 25052050	7 301.00	1.04	1.04	93.01	7 653.20
SGLT LET 0 17012020	32.00	1 002.69	1 002.69		32 086.08
Sub-total:					598 337.54
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	7.00	1 034.14	1 034.14	51.35	7 290.33
MADRID 0,747 300422	9.00	1 023.13	1 023.13	61.70	9 269.87
EFSF 0.125% 17102023	24.00	1 013.76	1 013.76	13.56	24 343.80
KFW 0.625% 07012028	11.00	1 037.70	1 037.70	15.63	11 430.33
ESM 0.125 22042024	1 100 000.00	0.01	0.01	12.92	11 153.17
Sub-total:					63 487.50
Sub-total:					661 825.04
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
LYXOR ETF EUR CORP B	624.00	150.07	150.07		93 643.68
ISHARES BG EURO CORP	1 199.00	131.27	131.27		157 392.73
AXA IM FIIS-US SHIDUR	141.00	171.03	171.03		24 115.23
LYXOR ETF MSCI EUROP	559.00	126.27	126.27		70 584.93
ISHARES MSCI EUROPE	1 569.00	23.80	23.80		37 334.36
MFS MER-EMERG MARK D	362.00	137.48	137.48		49 767.76
ISHARES CORE S&P 500	566.00	277.70	247.17		139 900.49
AMUNDI ETF MSCI EURO	939.00	219.88	219.88		206 467.41
AMUNDI S&P500 UCITS	690.00	50.91	45.32		31 268.45
DEU FLOATING RATE NO	1 218.00	83.99	83.99		102 299.82
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	1 164.00	153.44	153.44		178 604.16
Sub-total:					1 091 379.02
5. Líquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					210 518.89
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-42 570.26
Sub-total:					-42 570.26

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

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
Sub-total:					167 948.63
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	1 921 152.69
	Unidades de Participação em circulação:		155 918.44		
	Valor Unitário de Unidades de Participação:		12.3215		