

## ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA  
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA

Fundo: F.PENSOES BBVA PME

Data: 2020-06-30

Pág. 1 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
<b>PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS</b>					
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	13.00	1 130.70	1 130.70	161.62	14 860.72
SPGB 1.6% 2025	51.00	1 084.01	1 084.01	138.61	55 423.12
DBR 0.5% 15022025	900 000.00	0.01	0.01	16.84	9 533.44
FRTR 2.5% 25102020	81 000.00	1.01	1.01	1 383.20	83 140.55
BTPS 2% 01122025	3.00	1 067.23	1 067.23	4.93	3 206.62
BTPS 1.45% 15092022	23.00	1 028.80	1 028.80	97.88	23 760.28
BGB 0.2% 22102023	990 700.00	0.01	0.01	13.70	10 176.30
TII 0.125 15012022	347.00	114.89	102.59	20.45	35 620.64
BTPS 2.45 01102023	48.00	1 068.28	1 068.28	293.19	51 570.63
RAGB 0 15072024	30.00	1 022.36	1 022.36		30 670.80
BKO 0 11092020	4 300 000.00	0.01	0.01		43 043.00
FRTR 3.5% 25042026	33 000.00	1.23	1.23	212.01	40 938.96
BGB 0.1% 22062030	862 200.00	0.01	0.01	0.21	8 820.52
RFGB 0.125 15042036	16.00	1 010.76	1 010.76	4.22	16 176.38
FRTR 0 25022023	59 000.00	1.02	1.02		59 933.97
BTPS 0.05 15012023	19.00	996.50	996.50	4.38	18 937.88
BGB 0 22102027	2 171 200.00	0.01	0.01		22 178.16
BTPS 1.85 0102025	87.00	1 055.30	1 055.30	282.21	92 093.31
OBL 0 11042025	5 900 000.00	0.01	0.01		61 021.34
FRTR 0.5% 25052040	9 479.00	1.03	1.03	4.80	9 746.94
BTPS 0.85 15012027	14.00	996.05	996.05	54.92	13 999.62
SPGB 1.2% 31102040	35.00	1 025.41	1 025.41	17.26	35 906.61
IRISH 0.2% 18102030	1 739 200.00	0.01	0.01	1.43	17 743.88
Sub-total:					758 503.67
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	8.00	1 007.45	1 007.45	94.10	8 153.70
ESM 0.125 22042024	1 400 000.00	0.01	0.01	3.36	14 331.66
EIB 0.05% 16012030	22.00	1 037.48	1 037.48	5.02	22 829.58
KFW 0 31032027	28.00	1 028.00	1 028.00		28 784.00
EIB 0 25032025	12.00	1 026.62	1 026.62		12 319.44
Sub-total:					86 418.38
Sub-total:					844 922.05
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 4/15/21	378.00	108.68	97.05	9.85	36 696.34
TII 0.125 04152022	372.00	107.00	95.55	9.29	35 554.65
TII 0.625 15072021	302.00	115.75	103.37	89.46	31 307.44
TII 0.125% 15072022	346.00	114.18	101.96	20.10	35 298.69
TII 0.625% 15042023	361.00	107.41	95.92	44.13	34 669.70
Sub-total:					173 526.82
Sub-total:					1 018 448.87
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ROBECO HIGH YLD BD	80.00	229.88	229.88		18 390.40
AMUNDI 6 M-I	5.00	22 156.99	22 156.99		110 784.95
PIMCO GIS-GL HI YD-E	805.00	22.70	22.70		18 273.50
ISHARES MSCI EUROPE	8 682.00	22.27	22.27		193 348.14
DBX MSCI EUROPE	3 452.00	55.95	55.95		193 139.40
LYXOR UCITS ETF S&P	2 598.00	31.66	28.27		73 447.21
VANGUARD S&P 500 UCI	703.00	58.29	52.05		36 593.92
ISHARES CORE S&P 500	133.00	308.20	275.23		36 605.29
DBX S&P 500 ACC	1 433.00	57.36	51.22		73 403.18
ISHARES EURO GB 3-5Y	306.00	173.90	173.90		53 213.40
AMUNDI ETF MSCI EURO	929.00	214.35	214.35		199 134.49
FIDELITY EU SHT BD	3 490.00	10.27	10.27		35 856.96
AMUNDI S&P500 UCITS	1 449.00	56.71	50.64		73 378.69

## ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA  
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA

Fundo: F.PENSOES BBVA PME

Data: 2020-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DEU FLOATING RATE NO	432.00	83.51	83.51		36 076.32
SPDR BBG 0-3Y EURO C	2 389.00	30.08	30.08		71 856.34
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	154.68	154.68		53 209.92
BGF EUR SHORT DUR BO	10 784.00	10.02	10.02		108 055.68
X MSCI EMERGING MARK	182.00	42.06	42.06		7 654.92
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	99.90	99.90		120 075.71
AXA WORLD EUR CR SHD	179.00	99.89	99.89		17 880.31
AMUNDI EMER MKT BD	36.07	986.64	986.64		35 583.17
X WORLD SWAP EUR	409.00	23.37	23.37		9 558.74
GS EMRG MKT CORP BD	174.00	105.09	105.09		18 285.66
X EUR CORPORATE BOND	664.00	158.22	158.22		105 058.08
ISHARES CORE EUR COR	67 133.00	5.21	5.21		350 031.46
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	15.28	15.28		95 044.71
ISHARES USD SHORT DU	34 866.00	5.58	4.99		173 816.26
Sub-total:					2 317 756.80
<b>5. Liquidez</b>					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					280 403.03
Sub-total:					280 403.03
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-8 806.01
Sub-total:					-8 806.01
Sub-total:					271 597.02
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
<b>7. Operações com produtos derivados</b>					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0920	1.00				
SEP20 IMM EMINI EURO	5.00				
S&P500 EMINI SEP20	-1.00				
STOXX EUROPE600 0920	-1.00				
<b>TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA</b>					<b>3 607 802.69</b>
Unidades de Participação em circulação:		558 144.24			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.4639			

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA  
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA  
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME  
 Data: 2020-03-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
<b>PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS</b>					
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	1 123.90	1 123.90	63.18	22 541.18
SPGB 1.6% 2025	68.00	1 067.50	1 067.50	1 001.79	73 591.79
DBR 0.5% 15022025	1 200 000.00	0.01	0.01	7.54	12 703.18
FRTR 2.5% 25102020	108 000.00	1.02	1.02	1 172.95	110 958.19
BTPS 2.5% 01122024	22.00	1 071.54	1 071.54		23 573.88
BTPS 2% 01122025	5.00	1 052.56	1 052.56	33.33	5 296.13
BTPS 1.45% 15092022	34.00	1 022.43	1 022.43	22.77	34 785.39
BGB 0.2% 22102023	1 390 700.00	0.01	0.01	12.31	14 196.06
SPGB 1.3% 31102026	48.00	1 057.05	1 057.05	260.85	50 999.25
SPGB 1.5% 30042027	5.00	1 062.52	1 062.52	69.06	5 381.66
BTPS 2.45 01102023	64.00	1 061.06	1 061.06	784.00	68 691.84
IRISH 1.5% 15052050	974 700.00	0.01	0.01	128.23	11 576.37
SPGB 0.6% 311029				70.23	70.23
BTPS 2.5% 15112025	106.00	1 079.55	1 079.55	1 004.67	115 436.97
RAGB 0 15072024	41.00	1 015.11	1 015.11		41 619.51
BTPS 2.1% 15072026	31.00	1 057.70	1 057.70	137.71	32 926.41
SGLT LET 0 11092020	73.00	1 000.86	1 000.86		73 062.78
BKO 0 11092020	6 000 000.00	0.01	0.01		60 161.40
SGLT LET 0 14082020					
FRTR 3.5% 25042026	46 000.00	1.23	1.23	1 504.43	58 041.65
BGB 0.1% 22062030	1 262 200.00	0.01	0.01	6.56	12 660.62
RFGB 0.125 15042036	23.00	984.40	984.40	3.93	22 645.13
BTPS 1.45% 01032036				32.46	32.46
FRTR 0 25022023	80 000.00	1.01	1.01		81 144.00
ICTZ LET 0 29112021	71.00	992.77	992.77		70 486.67
BTPS 0.05 15012023	71.00	986.20	986.20	7.51	70 027.71
SPGB 0.8 30072027	43.00	1 019.47	1 019.47	0.94	43 838.15
SPGB 0 31012025	50.00	987.85	987.85		49 392.50
BGB 0 22102027	2 971 200.00	0.01	0.01		29 741.12
Sub-total:					1 195 582.23
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	12.00	1 010.44	1 010.44	88.93	12 214.21
ESM 0.125 22042024	2 100 000.00	0.01	0.01	24.74	21 318.74
EIB 0.05% 16012030	33.00	1 001.50	1 001.50	3.43	33 052.93
KFW 0 31032027	38.00	1 007.00	1 007.00		38 266.00
EIB 0 25032025	17.00	1 009.77	1 009.77		17 166.09
Sub-total:					122 017.97
Sub-total:					1 317 600.20
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
T 1.625 15112022	944.00	103.50	94.47	530.82	89 709.36
T 2.25 30042021	949.00	102.19	93.27	819.19	89 333.19
T 1.75 15052022	946.00	103.13	94.13	572.87	89 620.86
T 2.5 31012021	957.00	101.89	93.00	365.96	89 366.78
Sub-total:					358 030.19
Sub-total:					1 675 630.39
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
AMUNDI 6 M-I	5.00	22 121.66	22 121.66		110 608.30
ISHARES MSCI EUROPE	9 623.00	19.97	19.97		192 123.20
DBX MSCI EUROPE	3 862.00	48.66	48.66		187 924.92
LYXOR UCITS ETF S&P	2 949.00	27.05	24.69		72 796.37
VANGUARD S&P 500 UCI	794.00	50.03	45.67		36 259.41
ISHARES CORE S&P 500	151.00	263.95	240.92		36 378.65
DBX S&P 500 ACC	1 620.00	49.04	44.76		72 512.60
AMUNDI ETF MSCI EURO	1 043.00	190.42	190.42		198 607.12

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA  
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA  
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME  
 Data: 2020-03-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AMUNDI S&P500 UCITS	1 639.00	48.46	44.23		72 490.74
X MSCI EMERGING MARK	163.00	36.67	36.67		5 977.21
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	100.00	100.00		120 199.64
AMUNDI EMER MKT BD	36.07	826.33	826.33		29 801.59
X WORLD SWAP EUR	374.00	20.20	20.20		7 554.80
GS EMRG MKT CORP BD	174.00	92.93	92.93		16 169.82
X EUR CORPORATE BOND	664.00	150.54	150.54		99 958.56
ISHARES CORE EUR COR	67 133.00	4.96	4.96		333 013.25
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	14.33	14.33		89 135.71
Sub-total:					1 681 511.89
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					121 532.71
Sub-total:					121 532.71
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					4 501.34
Sub-total:					4 501.34
Sub-total:					126 034.05
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
JUN20 IMM EMINI EURO	8.00				
STOXX EUROPE600 0620	1.00				
S&P500 EMINI JUN20	2.00				

TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA 3 483 176.33

Unidades de Participação em circulação: 559 028.04  
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.2308

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)
<b>SEM CLASSIFICAÇÃO</b>					
SGLT LET 0 17042020	56.00	1 001.47	1 001.47		56 082.32
<b>PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS</b>					
1. Valores Mobiliários Cotados					
1.2. Mercado de Cot.Oficiais de Bolsa V.U.E					
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
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
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)
<b>SEM CLASSIFICAÇÃO</b>					
SGLT LET 0 17042020	56.00	1 002.86	1 002.86		56 160.16
<b>PARTE I - VALORES PATRIMONIAIS</b>					
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
<b>5. Liquidez</b>					
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
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
<b>7. Operações com produtos derivados</b>					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
DEC19 IMM EMINI EURO	-2.00				
MSCI WORLD1219	2.00				
				<b>TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA</b>	<b>3 657 299.94</b>
Unidades de Participação em circulação:				545 033.74	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.7102	