

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2021-03-31

Pág. 1 de 2

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					
BGB 4.25% 28092021	1 600 000.00	0.01	0.01	344.66	16 717.46
DBR 0.5% 15022025	500 000.00	0.01	0.01	3.08	5 239.18
BTPS 2% 01122025	2.00	1 094.54	1 094.54	13.26	2 202.34
BTPS 1.6% 01062026	19.00	1 079.82	1 079.82	100.78	20 617.36
SPGB 0.45% 31102022	26.00	1 015.70	1 015.70	48.72	26 456.92
RAGB 0 15072024	16.00	1 019.80	1 019.80		16 316.80
FRTR 0 25022023	31 000.00	1.01	1.01		31 390.29
OBL 0 11042025	3 100 000.00	0.01	0.01		31 867.38
BTPS 0.85 15012027	7.00	1 040.41	1 040.41	12.56	7 295.43
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	3.57	4 032.17
BOTS LET 0 14052021	26.00	1 000.56	1 000.56		26 014.56
SGLT 0 11062021	26.00	1 001.00	1 001.00		26 026.00
BTPS 0.95 15092027	13.00	1 045.10	1 045.10	5.71	13 592.01
BTPS 2.8% 01122028	18.00	1 181.53	1 181.53	167.08	21 434.62
BTPS 1.7 01092051	2.00	1 009.88	1 009.88	2.86	2 022.62
BTPS 5.25 01112029	1 100 000.00	0.01	0.01	240.89	15 645.95
BGB 0 221031	1 591 400.00	0.01	0.01		15 888.22
SPGB 0.1 130431	24.00	976.49	976.49	4.67	23 440.43
FRTR 0.5 25052072	2 954.00	0.81	0.81	12.58	2 407.30
RFGB 0.125 15042052	6.00	891.94	891.94	1.05	5 352.69
NETHER 0 17072031	15 000.00	1.02	1.02		15 238.65
BTPS 0.6% 01082031	12.00	989.12	989.12	11.73	11 881.17
BOTS 0 30/07/2021	23.00	1 001.63	1 001.63		23 037.49
BOTS 0 31/08/2021	23.00	1 002.06	1 002.06		23 047.38
BTPS 1.5 30042015	3.00	1 003.52	1 003.52	18.91	3 029.47
FRTR 0.75 25052052	4 000.00	0.98	0.98	25.56	3 952.44
Sub-total:					394 146.33
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	8.25	7 157.28
KFW 0.375% 15032023	38.00	1 019.77	1 019.77	6.64	38 757.90
EU 0.3 04112050	4.00	943.59	943.59	4.44	3 778.80
KFW 0 15092028	10.00	1 017.55	1 017.55		10 175.50
EU 0 04072035	11.00	970.39	970.39		10 674.29
MADRID 0.42 30042031	10.00	997.70	997.70	0.62	9 977.62
Sub-total:					80 521.39
Sub-total:					474 667.72
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	3 546.00	26.48	26.48		93 898.08
DBX MSCI EUROPE	1 392.00	67.39	67.39		93 806.88
LYXOR UCITS ETF S&P	1 121.00	40.77	34.77		38 981.64
VANGUARD S&P 500 UCI	302.00	75.45	64.35		19 434.25
ISHARES CORE S&P 500	57.00	402.85	343.58		19 584.18
DBX S&P 500 ACC	609.00	75.15	64.09		39 033.13
ISHARES EURO GB 3-5Y	158.00	174.53	174.53		27 575.74
AMUNDI ETF MSCI EURO	375.00	257.68	257.68		96 629.78
FIDELITY EU SHT BD	1 699.00	10.37	10.37		17 619.65
AMUNDI S&P500 UCITS	615.00	74.31	63.38		38 976.10
DEU FLOATING RATE NO	209.00	84.21	84.21		17 599.89
GAM LOCAL EMERG BD-E	52.00	118.06	118.06		6 139.12
JPMORGAN F-EM MAR LO	26.00	116.58	116.58		3 031.08
SPDR BBG 0-3Y EURO C	1 163.00	30.26	30.26		35 186.57
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	178.00	155.21	155.21		27 627.38
BGF EUR SHORT DUR BO	5 204.00	10.12	10.12		52 664.48
BNP INSTICASH-EUR-1D	588.00	99.50	99.50		58 508.47

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2021-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AXA WORLD EUR CR SHD	93.00	101.44	101.44		9 433.92
X WORLD SWAP EUR	171.00	29.66	29.66		5 072.54
GS EMRG MKT CORP BD	77.00	111.78	111.78		8 607.06
X EUR CORPORATE BOND	303.00	162.77	162.77		49 317.80
ISHARES CORE EUR COR	24 068.00	5.37	5.37		129 269.23
STT-EURO CORP BOND I	3 113.00	15.80	15.80		49 193.49
ISHARES USD SHORT DU	18 041.00	5.63	4.80		86 573.72
BLACKROCK GIF I EMMK	150.00	112.75	112.75		16 912.50
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 070.50	100 070.50		100 070.50
JPM EMERG MKTS CORP	28.00	112.53	112.53		3 150.84
MUZIN EMERG MKTS SHO	27.00	118.04	118.04		3 187.08
PICTE-S/T EM CRP BD	43.00	74.45	74.45		3 201.35
AMUNDI PRI EURO COPR	1 554.00	20.80	20.80		32 327.86
Sub-total:					1 182 614.31
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					71 987.65
Sub-total:					71 987.65
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-786.01
Sub-total:					-786.01
Sub-total:					71 201.64
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0621	1.00				
STOXX EUROPE600 0621	1.00				
FUT EUR/USD CME 0621					-125 181.24
STOXX EUROPE600 0621					-21 265.00
FUT EUR/USD CME 0621	1.00	146 775.00	125 181.24		125 181.24
STOXX EUROPE600 0621	1.00	21 265.00	21 265.00		21 265.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 728 483.67
Unidades de Participação em circulação:				133 288.95	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				12.9679	

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2020-12-31

Pág. 1 de 2

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BGB 4.25% 28092021	1 600 000.00	0.01	0.01	176.99	16 754.27
SPGB 1.6% 2025	27.00	1 090.90	1 090.90	291.16	29 745.46
DBR 0.5% 15022025	500 000.00	0.01	0.01	21.93	5 284.08
BTPS 2% 01122025	2.00	1 101.24	1 101.24	3.40	2 205.88
SPGB 0.45% 31102022	67.00	1 018.76	1 018.76	51.21	68 308.13
RAGB 0 15072024	16.00	1 024.30	1 024.30		16 388.80
BGB 0.1% 22062030	99 400.00	0.01	0.01	0.53	1 040.62
FRTR 0 25022023	31 000.00	1.02	1.02		31 470.89
BGB 0 22102027	1 117 200.00	0.01	0.01		11 605.59
OBL 0 11042025	3 100 000.00	0.01	0.01		32 001.30
FRTR 0.5% 25052040	5 055.00	1.08	1.08	15.30	5 457.41
BTPS 0.85 15012027	7.00	1 044.42	1 044.42	27.44	7 338.38
IRISH 0.2% 18102030	894 400.00	0.01	0.01	3.68	9 389.51
BOTS LET 0 14052021	26.00	1 001.98	1 001.98		26 051.48
SGLT 0 11062021	26.00	1 002.86	1 002.86		26 074.36
NETHER 0 15012052	6 000.00	1.03	1.03		6 156.66
SPGB 0 31012026	19.00	1 019.82	1 019.82		19 376.58
BTPS 2.8% 01122028	18.00	1 193.86	1 193.86	42.81	21 532.29
BTPS 1.7 01092051	5.00	1 063.46	1 063.46	28.65	5 345.95
BTPS 5.25 01112029	1 100 000.00	0.01	0.01	97.31	15 732.38
Sub-total:					357 260.02
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	6.09	7 176.26
KFW 0.375% 15032023	38.00	1 022.50	1 022.50	114.00	38 969.00
EU 0 04102030	7.00	1 040.91	1 040.91		7 286.37
KFW CUP 0 17092030	3.00	1 037.10	1 037.10		3 111.30
EU 0 04112025	22.00	1 031.30	1 031.30		22 688.60
EU 0.3 04112050	3.00	1 079.86	1 079.86	1.11	3 240.69
KFW 0 15092028	9.00	1 035.90	1 035.90		9 323.10
EU 0 04072035	11.00	1 026.46	1 026.46		11 291.06
Sub-total:					103 086.38
1.2.9. Opções					
CALL EURST 3475 1501	2.00				
Sub-total:					460 346.40
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BTPS 0.95 15092027	13.00	1 049.66	1 049.66	36.54	13 682.12
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	4 216.00	24.42	24.42		102 954.72
DBX MSCI EUROPE	1 657.00	62.70	62.70		103 893.90
LYXOR UCITS ETF S&P	1 354.00	38.11	31.05		42 047.05
VANGUARD S&P 500 UCI	357.00	70.75	57.65		20 582.56
ISHARES CORE S&P 500	68.00	377.50	307.64		20 919.24
DBX S&P 500 ACC	735.00	70.19	57.20		42 041.93
ISHARES EURO GB 3-5Y	158.00	175.38	175.38		27 710.04
AMUNDI ETF MSCI EURO	447.00	237.24	237.24		106 046.32
FIDELITY EU SHT BD	1 808.00	10.37	10.37		18 753.30
AMUNDI S&P500 UCITS	743.00	69.42	56.57		42 035.05
DEU FLOATING RATE NO	224.00	84.17	84.17		18 854.08
GAM LOCAL EMERG BD-E	52.00	124.45	124.45		6 471.40
JPMORGAN F-EM MAR LO	26.00	119.49	119.49		3 106.74
SPDR BBG 0-3Y EURO C	1 236.00	30.27	30.27		37 413.72
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	178.00	155.80	155.80		27 732.40
BGF EUR SHORT DUR BO	5 585.00	10.14	10.14		56 631.90

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2020-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
BNP INSTICASH-EUR-1D	648.00	99.65	99.65		64 574.76
AXA WORLD EUR CR SHD	93.00	101.44	101.44		9 433.92
X WORLD SWAP EUR	212.00	27.94	27.94		5 923.70
GS EMRG MKT CORP BD	85.00	113.80	113.80		9 673.00
X EUR CORPORATE BOND	345.00	163.92	163.92		56 552.40
ISHARES CORE EUR COR	34 877.00	5.41	5.41		188 702.01
STT-EURO CORP BOND I	3 230.00	15.90	15.90		51 359.91
ISHARES USD SHORT DU	18 041.00	5.66	4.61		83 170.02
BLACKROCK GIF I EMMK	167.00	118.44	118.44		19 779.48
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 121.00	100 121.00		100 121.00
JPM EMERG MKTS CORP	28.00	114.17	114.17		3 196.76
MUZIN EMERG MKTS SHO	27.00	117.53	117.53		3 173.31
PICTE-S/T EM CRP BD	43.00	74.36	74.36		3 197.48
Sub-total:					1 276 052.10
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					149 261.68
Sub-total:					149 261.68
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-2 848.37
Sub-total:					-2 848.37
Sub-total:					146 413.31
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0321	1.00				
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	1 896 493.93

Unidades de Participação em circulação: 148 355.99
Valor Unitário de Unidades de Participação: 12.7834

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR
Data: 2020-09-30

Pág. 1 de 2

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	7.00	1 141.46	1 141.46	21.88	8 012.10
SPGB 1.6% 2025	26.00	1 087.23	1 087.23	175.52	28 443.50
SPGB 2.15% 31102025	42.00	1 122.69	1 122.69	828.98	47 981.96
DBR 0.5% 15022025	500 000.00	0.01	0.01	15.64	5 291.24
BTPS 2% 01122025	2.00	1 087.43	1 087.43	13.37	2 188.23
BTPS 1.45% 15092022	12.00	1 032.08	1 032.08	7.69	12 392.65
BGB 0.2% 22102023	522 700.00	0.01	0.01	9.85	5 375.37
TII 0.125 15012022	179.00	116.29	99.33	4.08	17 783.36
RAGB 0 15072024	16.00	1 024.65	1 024.65		16 394.40
FRTR 3.5% 25042026	18 000.00	1.23	1.23	274.44	22 424.88
BGB 0.1% 22062030	99 400.00	0.01	0.01	0.28	1 032.55
RFGB 0.125 15042036	8.00	1 035.86	1 035.86	4.63	8 291.51
FRTR 0 25022023	31 000.00	1.02	1.02		31 471.82
BTPS 0.05 15012023	10.00	1 004.32	1 004.32	1.07	10 044.27
BGB 0 22102027	1 117 200.00	0.01	0.01		11 542.35
BTPS 1.85 0102025	45.00	1 074.82	1 074.82	209.84	48 576.74
OBL 0 11042025	3 100 000.00	0.01	0.01		32 032.92
FRTR 0.5% 25052040	5 055.00	1.06	1.06	8.93	5 374.71
BTPS 0.85 15012027	7.00	1 023.86	1 023.86	12.56	7 179.58
IRISH 0.2% 18102030	894 400.00	0.01	0.01	5.24	9 277.66
BOTS LET 0 14052021	25.00	1 002.52	1 002.52		25 063.00
SGLT 0 11062021	26.00	1 003.42	1 003.42		26 088.92
BOTS LET 0 31122020	25.00	1 001.18	1 001.18		25 029.50
FRTR 0 25032025	6 000.00	1.03	1.03		6 165.12
DBR 0 15082030	395 400.00	0.01	0.01		4 171.59
BTPS 1.8 01032041	6.00	1 047.50	1 047.50	4.73	6 289.73
NETHER 0 15012052	6 000.00	1.00	1.00		6 009.90
Sub-total:					429 929.56
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	3.88	7 172.37
KFW 0.375% 15032023	38.00	1 024.41	1 024.41	78.08	39 005.66
Sub-total:					46 178.03
Sub-total:					476 107.59
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 4/15/21	195.00	109.71	93.71	10.66	18 283.63
TII 0.125 04152022	192.00	108.42	92.60	10.06	17 789.51
TII 0.625 15072021	156.00	116.61	99.60	17.65	15 555.11
TII 0.125% 15072022	179.00	115.60	98.74	4.08	17 677.73
TII 0.625% 15042023	186.00	109.18	93.25	47.73	17 392.43
Sub-total:					86 698.41
Sub-total:					562 806.00
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ROBECO HIGH YLD BD	41.00	236.12	236.12		9 680.92
PIMCO GIS-GL HI YD-E	420.00	23.46	23.46		9 853.20
ISHARES MSCI EUROPE	4 596.00	22.13	22.13		101 709.48
DBX MSCI EUROPE	1 814.00	56.08	56.08		101 729.12
LYXOR UCITS ETF S&P	1 321.00	34.57	29.53		39 004.93
VANGUARD S&P 500 UCI	355.00	63.95	54.62		19 391.13
ISHARES CORE S&P 500	67.00	339.40	289.89		19 422.45
DBX S&P 500 ACC	722.00	63.20	53.98		38 973.69
ISHARES EURO GB 3-5Y	158.00	174.72	174.72		27 605.76
AMUNDI ETF MSCI EURO	488.00	214.29	214.29		104 574.50
FIDELITY EU SHT BD	1 808.00	10.33	10.33		18 681.52
AMUNDI S&P500 UCITS	729.00	62.50	53.38		38 913.52

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2020-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DEU FLOATING RATE NO	224.00	83.96	83.96		18 807.04
SPDR BBG 0-3Y EURO C	1 236.00	30.19	30.19		37 319.78
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	178.00	155.34	155.34		27 650.52
BGF EUR SHORT DUR BO	5 585.00	10.10	10.10		56 408.50
X MSCI EMERGING MARK	94.00	44.47	44.47		4 180.56
BNP INSTICASH-EUR-1D	648.00	99.79	99.79		64 662.75
AXA WORLD EUR CR SHD	93.00	100.86	100.86		9 379.98
X WORLD SWAP EUR	212.00	25.06	25.06		5 313.14
GS EMRG MKT CORP BD	91.00	107.89	107.89		9 817.99
X EUR CORPORATE BOND	345.00	160.68	160.68		55 434.60
ISHARES CORE EUR COR	34 877.00	5.30	5.30		184 848.10
STT-EURO CORP BOND I	3 230.00	15.65	15.65		50 560.48
ISHARES USD SHORT DU	18 041.00	5.61	4.79		86 368.13
BLACKROCK GIF I EMMK	167.00	112.19	112.19		18 735.73
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 014.10	100 014.10		100 014.10
Sub-total:					1 259 041.62
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					58 912.79
Sub-total:					58 912.79
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-1 802.96
Sub-total:					-1 802.96
Sub-total:					57 109.83
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 1220	1.00				
DEC20 IMM EMINI EURO	1.00				

TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA 1 878 957.45

Unidades de Participação em circulação: 150 914.62
Valor Unitário de Unidades de Participação: 12.4505

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR
Data: 2020-06-30

Pág. 1 de 2

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	7.00	1 130.70	1 130.70	87.02	8 001.92
SPGB 1.6% 2025	26.00	1 084.01	1 084.01	70.66	28 254.92
DBR 0.5% 15022025	500 000.00	0.01	0.01	9.36	5 296.36
FRTR 2.5% 25102020	42 000.00	1.01	1.01	717.21	43 109.91
BTPS 2% 01122025	2.00	1 067.23	1 067.23	3.29	2 137.75
BTPS 1.45% 15092022	12.00	1 028.80	1 028.80	51.07	12 396.67
BGB 0.2% 22102023	522 700.00	0.01	0.01	7.23	5 369.09
TII 0.125 15012022	179.00	114.89	102.59	10.55	18 374.91
BTPS 2.45 01102023	25.00	1 068.28	1 068.28	152.71	26 859.71
RAGB 0 15072024	16.00	1 022.36	1 022.36		16 357.76
BKO 0 11092020	2 200 000.00	0.01	0.01		22 022.00
FRTR 3.5% 25042026	17 000.00	1.23	1.23	109.22	21 089.77
BGB 0.1% 22062030	475 100.00	0.01	0.01	0.12	4 860.39
RFGB 0.125 15042036	8.00	1 010.76	1 010.76	2.11	8 088.19
FRTR 0 25022023	30 000.00	1.02	1.02		30 474.90
BTPS 0.05 15012023	10.00	996.50	996.50	2.31	9 967.31
BGB 0 22102027	1 117 200.00	0.01	0.01		11 411.86
BTPS 1.85 0102025	45.00	1 055.30	1 055.30	145.97	47 634.47
OBL 0 11042025	3 100 000.00	0.01	0.01		32 062.06
FRTR 0.5% 25052040	5 055.00	1.03	1.03	2.56	5 197.89
BTPS 0.85 15012027	7.00	996.05	996.05	27.46	6 999.81
SPGB 1.2% 31102040	17.00	1 025.41	1 025.41	8.38	17 440.35
IRISH 0.2% 18102030	894 400.00	0.01	0.01	0.74	9 124.96
Sub-total:					392 532.96
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EFSF 1.75% 29102020	4.00	1 007.45	1 007.45	47.05	4 076.85
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	1.68	7 165.83
EIB 0.05% 16012030	11.00	1 037.48	1 037.48	2.51	11 414.79
KFW 0 31032027	14.00	1 028.00	1 028.00		14 392.00
EIB 0 25032025	6.00	1 026.62	1 026.62		6 159.72
Sub-total:					43 209.19
Sub-total:					435 742.15
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 4/15/21	195.00	108.68	97.05	5.08	18 930.65
TII 0.125 04152022	192.00	107.00	95.55	4.79	18 350.79
TII 0.625 15072021	156.00	115.75	103.37	46.21	16 172.06
TII 0.125% 15072022	179.00	114.18	101.96	10.40	18 261.46
TII 0.625% 15042023	186.00	107.41	95.92	22.74	17 863.06
Sub-total:					89 578.01
Sub-total:					525 320.16
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ROBECO HIGH YLD BD	41.00	229.88	229.88		9 425.08
AMUNDI 6 M-I	6.00	22 156.99	22 156.99		132 941.94
PIMCO GIS-GL HI YD-E	420.00	22.70	22.70		9 534.00
ISHARES MSCI EUROPE	4 517.00	22.27	22.27		100 593.59
DBX MSCI EUROPE	1 796.00	55.95	55.95		100 486.20
LYXOR UCITS ETF S&P	859.00	31.66	28.27		24 284.51
VANGUARD S&P 500 UCI	366.00	58.29	52.05		19 051.74
ISHARES CORE S&P 500	70.00	308.20	275.23		19 265.94
DBX S&P 500 ACC	474.00	57.36	51.22		24 279.91
ISHARES EURO GB 3-5Y	158.00	173.90	173.90		27 476.20
AMUNDI ETF MSCI EURO	483.00	214.35	214.35		103 532.79
FIDELITY EU SHT BD	1 808.00	10.27	10.27		18 575.75
AMUNDI S&P500 UCITS	479.00	56.71	50.64		24 257.00

ASF - Norma Regulamentar N.º 6/2003-R

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

Fundo: CVI PPR

Data: 2020-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DEU FLOATING RATE NO	224.00	83.51	83.51		18 706.24
SPDR BBG 0-3Y EURO C	1 236.00	30.08	30.08		37 176.41
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	178.00	154.68	154.68		27 533.04
BGF EUR SHORT DUR BO	5 585.00	10.02	10.02		55 961.70
X MSCI EMERGING MARK	94.00	42.06	42.06		3 953.64
BNP INSTICASH-EUR-1D	648.00	99.90	99.90		64 733.00
AXA WORLD EUR CR SHD	93.00	99.89	99.89		9 289.77
AMUNDI EMER MKT BD	18.95	986.64	986.64		18 691.89
X WORLD SWAP EUR	212.00	23.37	23.37		4 954.65
GS EMRG MKT CORP BD	91.00	105.09	105.09		9 563.19
X EUR CORPORATE BOND	345.00	158.22	158.22		54 585.90
ISHARES CORE EUR COR	34 877.00	5.21	5.21		181 848.68
STT-EURO CORP BOND I	3 230.00	15.28	15.28		49 356.02
ISHARES USD SHORT DU	18 041.00	5.58	4.99		89 939.17
Sub-total:					1 239 997.95
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					112 855.77
Sub-total:					112 855.77
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-831.24
Sub-total:					-831.24
Sub-total:					112 024.53
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0920	1.00				
SEP20 IMM EMINI EURO	2.00				
STOXX EUROPE600 0920	-1.00				
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 877 342.64
Unidades de Participação em circulação:				151 858.27	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				12.3625	