

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: 2021-06-30

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BGB 4.25% 28092021	3 400 000.00	0.01	0.01	1 092.66	35 492.16
BTPS 2% 01122025	3.00	1 086.70	1 086.70	4.93	3 265.03
NETHER 0.5% 15072026	56 000.00	1.05	1.05	269.26	59 156.62
BTPS 1.6% 01062026	42.00	1 072.30	1 072.30	55.23	45 091.83
SPGB 0.45% 31102022	59.00	1 013.45	1 013.45	176.76	59 970.31
FRTR 0 25022023	64 000.00	1.01	1.01		64 672.64
BTPS 0.85 15012027	14.00	1 033.90	1 033.90	54.87	14 529.47
IRISH 0.2% 18102030	839 200.00	0.01	0.01	11.77	8 487.86
BTPS 0.95 15092027	26.00	1 038.20	1 038.20	72.49	27 065.69
BTPS 2.8% 01122028	36.00	1 167.80	1 167.80	82.85	42 123.65
BTPS 5.25 01112029	2 300 000.00	0.01	0.01	200.16	31 943.61
BGB 0 221031	3 282 900.00	0.01	0.01		32 448.18
FRTR 0.5 25052072	5 909.00	0.77	0.77	2.99	4 543.47
RFGB 0.125 15042052	12.00	874.10	874.10	3.16	10 492.36
BTPS 0.6% 01082031	27.00	978.16	978.16	67.13	26 477.45
BOTS 0 30/07/2021	52.00	1 000.43	1 000.43		52 022.36
BOTS 0 31/08/2021	52.00	1 000.89	1 000.89		52 046.28
BTPS 1.5 30042015	11.00	970.60	970.60	27.95	10 704.55
RAGB 0 200425	76.00	1 019.73	1 019.73		77 499.48
BOTS 0 29/10/2021	52.00	1 001.80	1 001.80		52 093.60
DBR 0 02/15/31	1 653 400.00	0.01	0.01		16 914.28
SPGB 0.5% 31102031	21.00	1 000.32	1 000.32	0.58	21 007.30
Sub-total:					748 048.18
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 500 000.00	0.01	0.01	3.60	15 266.10
EU 0.3 04112050	4.00	906.28	906.28	14.86	3 639.98
KFW 0 15092028	20.00	1 012.30	1 012.30		20 246.00
EU 0 04/07/2031					
EU 0.7 06/07/2051	4 789.00	1.01	1.01		4 816.39
Sub-total:					43 968.47
Sub-total:					792 016.65
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
FRTR 0.5 06252044	12 000.00	0.95	0.95	0.99	11 447.19
BTPS 0.95 01/12/2031	46.00	1 007.36	1 007.36	35.82	46 374.38
BKO 0 03/10/2023	6 700 000.00	0.01	0.01		67 757.77
Sub-total:					125 579.34
2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	37.00	1 016.86	1 016.86		37 623.82
Sub-total:					163 203.16
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 456.00	27.92	27.92		208 171.52
DBX MSCI EUROPE	2 897.00	72.05	72.05		208 728.85
LYXOR UCITS ETF S&P	1 896.00	44.13	37.14		70 411.97
VANGUARD S&P 500 UCI	516.00	81.41	68.50		35 348.00
ISHARES CORE S&P 500	97.00	435.95	366.84		35 583.26
DBX S&P 500 ACC	1 029.00	81.30	68.41		70 395.24
ISHARES EURO GB 3-5Y	1 435.00	174.06	174.06		249 776.10
AMUNDI ETF MSCI EURO	782.00	274.47	274.47		214 634.45
FIDELITY EU SHT BD	932.00	10.32	10.32		9 621.60
AMUNDI S&P500 UCITS	1 045.00	80.40	67.65		70 694.90
DEU FLOATING RATE NO	287.00	84.24	84.24		24 176.88
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	121.32	121.32		8 249.76
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	120.04	120.04		5 281.76

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: 2021-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	154.81	154.81		53 254.64
BGF EUR SHORT DUR BO	7 142.00	10.10	10.10		72 134.20
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 537.46	99.36	99.36		152 755.67
AXA WORLD EUR CR SHD	179.00	101.65	101.65		18 195.35
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	107.35	107.35		4 938.10
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	114.24	114.24		21 020.16
X EUR CORPORATE BOND	664.00	162.86	162.86		108 135.72
ISHARES CORE EUR COR	53 527.00	5.38	5.38		287 707.63
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	15.81	15.81		98 323.27
ISHARES USD SHORT DU	34 866.00	5.65	4.75		165 763.13
AMUNDI 3 M- R2	0.33	99 643.86	99 643.86		33 281.05
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	114.32	114.32		3 886.88
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	119.10	119.10		4 644.90
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	75.22	75.22		4 663.64
AMUNDI PRI EURO COPR	3 457.00	20.82	20.82		71 964.37
INVESCO S&P 500 ACC	105.00	804.38	676.86		71 070.26
ISHARES CHINA CNY BO	4 244.00	5.53	4.66		19 761.53
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	5.27	4.44		5 380.11
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	28.16	28.16		4 393.27
LYXOR MSCI WORLD-MH	981.00	10.19	10.19		9 998.35
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	136.00	136.00		5 304.00
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	121.95	121.95		4 634.10
Sub-total:					2 432 284.62
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					471 020.46
Sub-total:					471 020.46
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					36 921.25
Sub-total:					36 921.25
Sub-total:					507 941.71
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
S&P500 EMINI SEP21	1.00				
FUT EUR/USD CME 0921	1.00				
STOXX EUROPE600 0921	1.00				
S&P500 EMINI SEP21					-180 435.88
FUT EUR/USD CME 0921					-124 800.15
STOXX EUROPE600 0921					-22 560.00
S&P500 EMINI SEP21	1.00	214 430.00	180 435.88		180 435.88
FUT EUR/USD CME 0921	1.00	148 312.50	124 800.15		124 800.15
STOXX EUROPE600 0921	1.00	22 560.00	22 560.00		22 560.00
Sub-total:					0.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 895 446.14
Unidades de Participação em circulação:				571 363.98	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.8178	

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: 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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BGB 4.25% 28092021	3 300 000.00	0.01	0.01	710.86	34 479.76
DBR 0.5% 15022025	900 000.00	0.01	0.01	5.55	9 430.53
BTPS 2% 01122025	3.00	1 094.54	1 094.54	19.89	3 303.51
BTPS 1.6% 01062026	42.00	1 079.82	1 079.82	222.77	45 575.21
SPGB 0.45% 31102022	58.00	1 015.70	1 015.70	108.69	59 019.29
RAGB 0 15072024	31.00	1 019.80	1 019.80		31 613.80
FRTR 0 25022023	63 000.00	1.01	1.01		63 793.17
OBL 0 11042025	6 200 000.00	0.01	0.01		63 734.76
BTPS 0.85 15012027	14.00	1 040.41	1 040.41	25.12	14 590.86
IRISH 0.2% 18102030	839 200.00	0.01	0.01	7.59	8 579.60
BOTS LET 0 14052021	51.00	1 000.56	1 000.56		51 028.56
SGLT 0 11062021	51.00	1 001.00	1 001.00		51 051.00
BTPS 0.95 15092027	26.00	1 045.10	1 045.10	11.41	27 184.01
BTPS 2.8% 01122028	36.00	1 181.53	1 181.53	324.88	42 859.96
BTPS 1.7 01092051	4.00	1 009.88	1 009.88	5.73	4 045.25
BTPS 5.25 01112029	2 200 000.00	0.01	0.01	481.78	31 291.90
BGB 0 221031	3 282 900.00	0.01	0.01		32 775.82
SPGB 0.1 130431	47.00	976.49	976.49	9.14	45 904.17
FRTR 0.5 25052072	5 909.00	0.81	0.81	25.17	4 815.42
RFGB 0.125 15042052	12.00	891.94	891.94	1.92	10 705.20
NETHER 0 17072031	30 000.00	1.02	1.02		30 477.30
BTPS 0.6% 01082031	27.00	989.12	989.12	26.40	26 732.64
BOTS 0 30/07/2021	52.00	1 001.63	1 001.63		52 084.76
BOTS 0 31/08/2021	51.00	1 002.06	1 002.06		51 105.06
BTPS 1.5 30042015	6.00	1 003.52	1 003.52	37.83	6 058.95
FRTR 0.75 25052052	9 000.00	0.98	0.98	57.51	8 892.99
Sub-total:					811 133.48
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 400 000.00	0.01	0.01	16.49	14 314.55
KFW 0.375% 15032023	76.00	1 019.77	1 019.77	13.10	77 515.62
EU 0.3 04112050	8.00	943.59	943.59	8.88	7 557.60
KFW 0 15092028	19.00	1 017.55	1 017.55		19 333.45
EU 0 04072035	23.00	970.39	970.39		22 318.97
MADRID 0.42 30042031	21.00	997.70	997.70	1.45	20 953.15
Sub-total:					161 993.34
Sub-total:					973 126.82
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 886.00	26.48	26.48		208 821.28
DBX MSCI EUROPE	3 096.00	67.39	67.39		208 639.44
LYXOR UCITS ETF S&P	2 493.00	40.77	34.77		86 691.55
VANGUARD S&P 500 UCI	672.00	75.45	64.35		43 244.42
ISHARES CORE S&P 500	126.00	402.85	343.58		43 291.34
DBX S&P 500 ACC	1 355.00	75.15	64.09		86 847.12
ISHARES EURO GB 3-5Y	306.00	174.53	174.53		53 406.18
AMUNDI ETF MSCI EURO	835.00	257.68	257.68		215 162.30
FIDELITY EU SHT BD	3 490.00	10.37	10.37		36 193.39
AMUNDI S&P500 UCITS	1 368.00	74.31	63.38		86 698.06
DEU FLOATING RATE NO	432.00	84.21	84.21		36 378.72
GAM LOCAL EMERG BD-E	100.00	118.06	118.06		11 806.00
JPMORGAN F-EM MAR LO	51.00	116.58	116.58		5 945.58
SPDR BBG 0-3Y EURO C	2 389.00	30.26	30.26		72 279.20
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	155.21	155.21		53 392.24
BGF EUR SHORT DUR BO	10 784.00	10.12	10.12		109 134.08
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	99.50	99.50		119 604.05

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: 2021-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AXA WORLD EUR CR SHD	179.00	101.44	101.44		18 157.76
X WORLD SWAP EUR	332.00	29.66	29.66		9 848.45
GS EMRG MKT CORP BD	165.00	111.78	111.78		18 443.70
X EUR CORPORATE BOND	664.00	162.77	162.77		108 075.96
ISHARES CORE EUR COR	53 527.00	5.37	5.37		287 493.52
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	15.80	15.80		98 292.17
ISHARES USD SHORT DU	34 866.00	5.63	4.80		167 312.20
BLACKROCK GIF I EMMK	320.00	112.75	112.75		36 080.00
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 070.50	100 070.50		100 070.50
JPM EMERG MKTS CORP	55.00	112.53	112.53		6 189.15
MUZIN EMERG MKTS SHO	53.00	118.04	118.04		6 256.12
PICTE-S/T EM CRP BD	83.00	74.45	74.45		6 179.35
AMUNDI PRI EURO COPR	3 457.00	20.80	20.80		71 915.97
Sub-total:					2 411 849.80
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					473 124.26
Sub-total:					473 124.26
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-12 529.99
Sub-total:					-12 529.99
Sub-total:					460 594.27
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				
S&P500 EMINI JUN21	1.00				
STOXX EUROPE600 0621	1.00				
FUT EUR/USD CME 0621					-125 181.24
S&P500 EMINI JUN21					-169 185.50
STOXX EUROPE600 0621					-21 265.00
FUT EUR/USD CME 0621	1.00	146 775.00	125 181.24		125 181.24
S&P500 EMINI JUN21	1.00	198 370.00	169 185.50		169 185.50
STOXX EUROPE600 0621	1.00	21 265.00	21 265.00		21 265.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 845 570.89
Unidades de Participação em circulação:		572 194.18			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.7207			

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: 2020-12-31

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.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BGB 4.25% 28092021	3 100 000.00	0.01	0.01	342.91	32 461.39
SPGB 1.6% 2025	51.00	1 090.90	1 090.90	549.96	56 185.86
DBR 0.5% 15022025	900 000.00	0.01	0.01	39.47	9 511.34
BTPS 2% 01122025	3.00	1 101.24	1 101.24	5.10	3 308.82
SPGB 0.45% 31102022	130.00	1 018.76	1 018.76	99.37	132 538.17
RAGB 0 15072024	30.00	1 024.30	1 024.30		30 729.00
BGB 0.1% 22062030	180 300.00	0.01	0.01	0.95	1 887.56
FRTR 0 25022023	60 000.00	1.02	1.02		60 911.40
BGB 0 22102027	2 171 200.00	0.01	0.01		22 554.64
OBL 0 11042025	5 900 000.00	0.01	0.01		60 905.70
FRTR 0.5% 25052040	9 479.00	1.08	1.08	28.70	10 233.60
BTPS 0.85 15012027	14.00	1 044.42	1 044.42	54.87	14 676.75
IRISH 0.2% 18102030	1 639 200.00	0.01	0.01	6.74	17 208.50
BOTS LET 0 14052021	49.00	1 001.98	1 001.98		49 097.02
SGLT 0 11062021	49.00	1 002.86	1 002.86		49 140.14
NETHER 0 15012052	12 000.00	1.03	1.03		12 313.32
SPGB 0 31012026	36.00	1 019.82	1 019.82		36 713.52
BTPS 2.8% 01122028	34.00	1 193.86	1 193.86	80.85	40 672.09
BTPS 1.7 01092051	9.00	1 063.46	1 063.46	51.56	9 622.70
BTPS 5.25 01112029	2 100 000.00	0.01	0.01	185.78	30 034.55
Sub-total:					680 706.07
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 400 000.00	0.01	0.01	12.18	14 352.52
KFW 0.375% 15032023	72.00	1 022.50	1 022.50	216.00	73 836.00
EU 0 04102030	15.00	1 040.91	1 040.91		15 613.65
KFW CUP 0 17092030	7.00	1 037.10	1 037.10		7 259.70
EU 0 04112025	42.00	1 031.30	1 031.30		43 314.60
EU 0.3 04112050	7.00	1 079.86	1 079.86	2.59	7 561.61
KFW 0 15092028	18.00	1 035.90	1 035.90		18 646.20
EU 0 04072035	22.00	1 026.46	1 026.46		22 582.12
Sub-total:					203 166.40
1.2.9. Opções					
CALL EURST 3475 1501	4.00				
Sub-total:					883 872.47
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BTPS 0.95 15092027	24.00	1 049.66	1 049.66	67.46	25 259.30
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	8 184.00	24.42	24.42		199 853.28
DBX MSCI EUROPE	3 217.00	62.70	62.70		201 705.90
LYXOR UCITS ETF S&P	2 625.00	38.11	31.05		81 516.61
VANGUARD S&P 500 UCI	704.00	70.75	57.65		40 588.57
ISHARES CORE S&P 500	133.00	377.50	307.64		40 915.57
DBX S&P 500 ACC	1 425.00	70.19	57.20		81 509.86
ISHARES EURO GB 3-5Y	306.00	175.38	175.38		53 666.28
AMUNDI ETF MSCI EURO	867.00	237.24	237.24		205 687.17
FIDELITY EU SHT BD	3 490.00	10.37	10.37		36 199.68
AMUNDI S&P500 UCITS	1 440.00	69.42	56.57		81 467.67
DEU FLOATING RATE NO	432.00	84.17	84.17		36 361.44
GAM LOCAL EMERG BD-E	100.00	124.45	124.45		12 445.00
JPMORGAN F-EM MAR LO	51.00	119.49	119.49		6 093.99
SPDR BBG 0-3Y EURO C	2 389.00	30.27	30.27		72 315.03
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	155.80	155.80		53 595.20
BGF EUR SHORT DUR BO	10 784.00	10.14	10.14		109 349.76

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: 2020-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	99.65	99.65		119 782.18
AXA WORLD EUR CR SHD	179.00	101.44	101.44		18 157.76
X WORLD SWAP EUR	409.00	27.94	27.94		11 428.28
GS EMRG MKT CORP BD	165.00	113.80	113.80		18 777.00
X EUR CORPORATE BOND	664.00	163.92	163.92		108 842.88
ISHARES CORE EUR COR	67 133.00	5.41	5.41		363 223.10
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	15.90	15.90		98 903.60
ISHARES USD SHORT DU	34 866.00	5.66	4.61		160 734.22
BLACKROCK GIF I EMMK	320.00	118.44	118.44		37 900.80
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 121.00	100 121.00		100 121.00
JPM EMERG MKTS CORP	55.00	114.17	114.17		6 279.35
MUZIN EMERG MKTS SHO	53.00	117.53	117.53		6 229.09
PICTE-S/T EM CRP BD	83.00	74.36	74.36		6 171.88
Sub-total:					2 369 822.16
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					524 295.71
Sub-total:					524 295.71
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-11 096.36
Sub-total:					-11 096.36
Sub-total:					513 199.35
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				
MAR21 IMM EMINI EURO	2.00				
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 792 153.29

Unidades de Participação em circulação: 572 834.35
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.6200

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: 2020-09-30

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	13.00	1 141.46	1 141.46	40.63	14 879.61
SPGB 1.6% 2025	51.00	1 087.23	1 087.23	344.28	55 793.01
SPGB 2.15% 31102025	81.00	1 122.69	1 122.69	1 598.75	92 536.64
DBR 0.5% 15022025	900 000.00	0.01	0.01	28.16	9 524.24
BTPS 2% 01122025	3.00	1 087.43	1 087.43	20.05	3 282.34
BTPS 1.45% 15092022	23.00	1 032.08	1 032.08	14.74	23 752.58
BGB 0.2% 22102023	990 700.00	0.01	0.01	18.68	10 188.22
TII 0.125 15012022	347.00	116.29	99.33	7.92	34 473.88
RAGB 0 15072024	30.00	1 024.65	1 024.65		30 739.50
FRTR 3.5% 25042026	34 000.00	1.23	1.23	518.38	42 358.10
BGB 0.1% 22062030	180 300.00	0.01	0.01	0.50	1 872.92
RFGB 0.125 15042036	16.00	1 035.86	1 035.86	9.26	16 583.02
FRTR 0 25022023	60 000.00	1.02	1.02		60 913.20
BTPS 0.05 15012023	19.00	1 004.32	1 004.32	2.03	19 084.11
BGB 0 22102027	2 171 200.00	0.01	0.01		22 431.75
BTPS 1.85 0102025	86.00	1 074.82	1 074.82	401.02	92 835.54
OBL 0 11042025	5 900 000.00	0.01	0.01		60 965.88
FRTR 0.5% 25052040	9 479.00	1.06	1.06	16.75	10 078.52
BTPS 0.85 15012027	14.00	1 023.86	1 023.86	25.12	14 359.16
IRISH 0.2% 18102030	1 739 200.00	0.01	0.01	10.20	18 040.83
BOTS LET 0 14052021	48.00	1 002.52	1 002.52		48 120.96
SGLT 0 11062021	49.00	1 003.42	1 003.42		49 167.58
BOTS LET 0 31122020	48.00	1 001.18	1 001.18		48 056.64
FRTR 0 25032025	12 000.00	1.03	1.03		12 330.24
DBR 0 15082030	632 700.00	0.01	0.01		6 675.17
BTPS 1.8 01032041	11.00	1 047.50	1 047.50	8.68	11 531.18
NETHER 0 15012052	12 000.00	1.00	1.00		12 019.80
Sub-total:					822 594.62
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 400 000.00	0.01	0.01	7.77	14 344.75
KFW 0.375% 15032023	72.00	1 024.41	1 024.41	147.95	73 905.47
Sub-total:					88 250.22
Sub-total:					910 844.84
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	109.71	93.71	20.67	35 442.12
TII 0.125 04152022	372.00	108.42	92.60	19.49	34 467.17
TII 0.625 15072021	302.00	116.61	99.60	34.17	30 113.10
TII 0.125% 15072022	346.00	115.60	98.74	7.89	34 170.37
TII 0.625% 15042023	361.00	109.18	93.25	92.64	33 756.27
Sub-total:					167 949.03
Sub-total:					1 078 793.87
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ROBECO HIGH YLD BD	80.00	236.12	236.12		18 889.60
PIMCO GIS-GL HI YD-E	805.00	23.46	23.46		18 885.30
ISHARES MSCI EUROPE	8 828.00	22.13	22.13		195 363.64
DBX MSCI EUROPE	3 483.00	56.08	56.08		195 326.64
LYXOR UCITS ETF S&P	2 537.00	34.57	29.53		74 909.54
VANGUARD S&P 500 UCI	682.00	63.95	54.62		37 252.82
ISHARES CORE S&P 500	129.00	339.40	289.89		37 395.46
DBX S&P 500 ACC	1 386.00	63.20	53.98		74 816.54
ISHARES EURO GB 3-5Y	306.00	174.72	174.72		53 464.32
AMUNDI ETF MSCI EURO	938.00	214.29	214.29		201 005.90
FIDELITY EU SHT BD	3 490.00	10.33	10.33		36 061.12
AMUNDI S&P500 UCITS	1 401.00	62.50	53.38		74 784.42

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: 2020-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DEU FLOATING RATE NO	432.00	83.96	83.96		36 270.72
SPDR BBG 0-3Y EURO C	2 389.00	30.19	30.19		72 133.47
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	155.34	155.34		53 436.96
BGF EUR SHORT DUR BO	10 784.00	10.10	10.10		108 918.40
X MSCI EMERGING MARK	182.00	44.47	44.47		8 094.27
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 202.00	99.79	99.79		119 945.42
AXA WORLD EUR CR SHD	179.00	100.86	100.86		18 053.94
X WORLD SWAP EUR	409.00	25.06	25.06		10 250.36
GS EMRG MKT CORP BD	174.00	107.89	107.89		18 772.86
X EUR CORPORATE BOND	664.00	160.68	160.68		106 691.52
ISHARES CORE EUR COR	67 133.00	5.30	5.30		355 804.90
STT-EURO CORP BOND I	6 220.00	15.65	15.65		97 364.15
ISHARES USD SHORT DU	34 866.00	5.61	4.79		166 914.87
BLACKROCK GIF I EMMK	320.00	112.19	112.19		35 900.80
AMUNDI 6 M- R2	1.00	100 014.10	100 014.10		100 014.10
Sub-total:					2 326 722.03
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					208 271.95
Sub-total:					208 271.95
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-9 775.00
Sub-total:					-9 775.00
Sub-total:					198 496.95
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	3.00				

TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA 3 604 012.86

Unidades de Participação em circulação: 557 497.38
Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.4646