

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: 2021-06-30

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 | 1 500 000.00 | 0.01 | 0.01 | 482.05 | 15 658.30 |
| BTPS 2% 01122025 | 2.00 | 1 086.70 | 1 086.70 | 3.29 | 2 176.69 |
| NETHER 0.5% 15072026 | 25 000.00 | 1.05 | 1.05 | 120.21 | 26 409.21 |
| BTPS 1.6% 01062026 | 19.00 | 1 072.30 | 1 072.30 | 24.99 | 20 398.69 |
| SPGB 0.45% 31102022 | 27.00 | 1 013.45 | 1 013.45 | 80.89 | 27 444.04 |
| FRTR 0 25022023 | 29 000.00 | 1.01 | 1.01 | | 29 304.79 |
| BTPS 0.85 15012027 | 7.00 | 1 033.90 | 1 033.90 | 27.44 | 7 264.74 |
| IRISH 0.2% 18102030 | 394 400.00 | 0.01 | 0.01 | 5.53 | 3 989.05 |
| BTPS 0.95 15092027 | 12.00 | 1 038.20 | 1 038.20 | 33.46 | 12 491.86 |
| BTPS 2.8% 01122028 | 17.00 | 1 167.80 | 1 167.80 | 39.12 | 19 891.72 |
| BTPS 5.25 01112029 | 1 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | 87.02 | 13 888.52 |
| BGB 0 221031 | 1 591 400.00 | 0.01 | 0.01 | | 15 729.40 |
| FRTR 0.5 25052072 | 2 954.00 | 0.77 | 0.77 | 1.50 | 2 271.35 |
| RFGB 0.125 15042052 | 6.00 | 874.10 | 874.10 | 1.58 | 5 246.18 |
| BTPS 0.6% 01082031 | 12.00 | 978.16 | 978.16 | 29.83 | 11 767.75 |
| BOTS 0 30/07/2021 | 24.00 | 1 000.43 | 1 000.43 | | 24 010.32 |
| BOTS 0 31/08/2021 | 24.00 | 1 000.89 | 1 000.89 | | 24 021.36 |
| BTPS 1.5 30042015 | 5.00 | 970.60 | 970.60 | 12.70 | 4 865.70 |
| RAGB 0 200425 | 35.00 | 1 019.73 | 1 019.73 | | 35 690.55 |
| BOTS 0 29/10/2021 | 26.00 | 1 001.80 | 1 001.80 | | 26 046.80 |
| DBR 0 02/15/31 | 746 700.00 | 0.01 | 0.01 | | 7 638.74 |
| SPGB 0.5% 31102031 | 9.00 | 1 000.32 | 1 000.32 | 0.25 | 9 003.13 |
| Sub-total: | | | | | 345 208.89 |
| 1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados | | | | | |
| ESM 0.125 22042024 | 700 000.00 | 0.01 | 0.01 | 1.68 | 7 124.18 |
| EU 0.3 04112050 | 2.00 | 906.28 | 906.28 | 7.43 | 1 819.99 |
| KFW 0 15092028 | 10.00 | 1 012.30 | 1 012.30 | | 10 123.00 |
| EU 0 04/07/2031 | | | | | |
| EU 0.7 06/07/2051 | 2 095.00 | 1.01 | 1.01 | | 2 106.98 |
| Sub-total: | | | | | 21 174.15 |
| Sub-total: | | | | | 366 383.04 |
| 2. Valores Não Cotados | | | | | |
| 2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros | | | | | |
| 2.2.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| FRTR 0.5 06252044 | 5 000.00 | 0.95 | 0.95 | 0.41 | 4 769.66 |
| BTPS 0.95 01/12/2031 | 21.00 | 1 007.36 | 1 007.36 | 16.35 | 21 170.91 |
| BKO 0 03/10/2023 | 3 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | | 30 339.30 |
| Sub-total: | | | | | 56 279.87 |
| 2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados | | | | | |
| KFW CUP 0 02/18/25 | 17.00 | 1 016.86 | 1 016.86 | | 17 286.62 |
| Sub-total: | | | | | 73 566.49 |
| 3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo | | | | | |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | |
| ISHARES MSCI EUROPE | 3 358.00 | 27.92 | 27.92 | | 93 755.36 |
| DBX MSCI EUROPE | 1 305.00 | 72.05 | 72.05 | | 94 025.25 |
| LYXOR UCITS ETF S&P | 854.00 | 44.13 | 37.14 | | 31 715.10 |
| VANGUARD S&P 500 UCI | 232.00 | 81.41 | 68.50 | | 15 892.90 |
| ISHARES CORE S&P 500 | 43.00 | 435.95 | 366.84 | | 15 774.02 |
| DBX S&P 500 ACC | 464.00 | 81.30 | 68.41 | | 31 742.85 |
| ISHARES EURO GB 3-5Y | 705.00 | 174.06 | 174.06 | | 122 712.30 |
| AMUNDI ETF MSCI EURO | 352.00 | 274.47 | 274.47 | | 96 612.95 |
| FIDELITY EU SHT BD | 419.00 | 10.32 | 10.32 | | 4 325.59 |
| AMUNDI S&P500 UCITS | 469.00 | 80.40 | 67.65 | | 31 728.14 |
| DEU FLOATING RATE NO | 156.00 | 84.24 | 84.24 | | 13 141.44 |
| GAM LOCAL EMERG BD-E | 30.00 | 121.32 | 121.32 | | 3 639.60 |
| JPMORGAN F-EM MAR LO | 20.00 | 120.04 | 120.04 | | 2 400.80 |

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: 2021-06-30

Pág. 2 de 2

| Designação | Quantidade | Cotação | Cotação (EUR) | Montante Juros (EUR) | Montante Global (EUR) |
|--|------------|------------|---------------|----------------------|-----------------------|
| LYXOR EUROMTS 3-5Y D | 178.00 | 154.81 | 154.81 | | 27 556.18 |
| BGF EUR SHORT DUR BO | 3 898.00 | 10.10 | 10.10 | | 39 369.80 |
| BNP INSTICASH-EUR-1D | 923.50 | 99.36 | 99.36 | | 91 755.26 |
| AXA WORLD EUR CR SHD | 78.00 | 101.65 | 101.65 | | 7 928.70 |
| PICTET-EMERG LCL CCY | 21.00 | 107.35 | 107.35 | | 2 254.35 |
| GS EMRG MKT CORP BD | 83.00 | 114.24 | 114.24 | | 9 481.92 |
| X EUR CORPORATE BOND | 303.00 | 162.86 | 162.86 | | 49 345.07 |
| ISHARES CORE EUR COR | 24 068.00 | 5.38 | 5.38 | | 129 365.50 |
| STT-EURO CORP BOND I | 3 113.00 | 15.81 | 15.81 | | 49 209.06 |
| ISHARES USD SHORT DU | 18 041.00 | 5.65 | 4.75 | | 85 772.17 |
| AMUNDI 3 M- R2 | 0.34 | 99 643.88 | 99 643.88 | | 33 380.70 |
| JPM EMERG MKTS CORP | 15.00 | 114.32 | 114.32 | | 1 714.80 |
| MUZIN EMERG MKTS SHO | 18.00 | 119.10 | 119.10 | | 2 143.80 |
| PICTE-S/T EM CRP BD | 28.00 | 75.22 | 75.22 | | 2 106.16 |
| AMUNDI PRI EURO COPR | 1 554.00 | 20.82 | 20.82 | | 32 349.62 |
| INVESCO S&P 500 ACC | 47.00 | 804.38 | 676.86 | | 31 812.40 |
| ISHARES CHINA CNY BO | 1 912.00 | 5.53 | 4.66 | | 8 902.93 |
| ISHARES JPM EM LCL G | 546.00 | 5.27 | 4.44 | | 2 421.71 |
| SPDR BBG BARC EM LCL | 70.00 | 28.16 | 28.16 | | 1 971.34 |
| LYXOR MSCI WORLD-MH | 442.00 | 10.19 | 10.19 | | 4 504.86 |
| DPAM L-BONDS EMK SU | 17.00 | 136.00 | 136.00 | | 2 312.00 |
| AXA WORLD EMMK SH DU | 17.00 | 121.95 | 121.95 | | 2 073.15 |
| Sub-total: | | | | | 1 175 197.79 |
| 5. Liquidez | | | | | |
| 5.1. A Vista | | | | | |
| 5.1.2. Depósitos à Ordem | | | | | |
| Depositos a Ordem | | | | | 124 599.47 |
| Sub-total: | | | | | 124 599.47 |
| 5.2. A Prazo | | | | | |
| 5.2.1. Depósitos e Outros Equipados | | | | | |
| Outros | | | | | 13 856.54 |
| Sub-total: | | | | | 13 856.54 |
| Sub-total: | | | | | 138 456.01 |
| PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS | | | | | |
| 7. Operações com produtos derivados | | | | | |
| 7.1. Em Mercado Regulamentado | | | | | |
| 7.1.1. Futuros | | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0921 | 1.00 | | | | |
| STOXX EUROPE600 0921 | 1.00 | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0921 | | | | | -124 800.15 |
| STOXX EUROPE600 0921 | | | | | -22 560.00 |
| 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 |
| TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA | | | | | 1 753 603.33 |
| Unidades de Participação em circulação: | | | | 133 383.75 | |
| Valor Unitário de Unidades de Participação: | | | | 13.1471 | |

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.U.E | | | | | |
| 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