

## 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: 2022-03-31

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BTPS 2% 01122025	3.00	1 037.16	1 037.16	19.89	3 131.37
NETHER 0.5% 15072026	58 000.00	1.01	1.01	206.58	58 518.62
SPGB 1.3% 31102026	56.00	1 024.90	1 024.90	303.17	57 697.57
BTPS 1.6% 01062026	44.00	1 019.89	1 019.89	233.38	45 108.54
DBR 0 08/15/31	658 200.00	0.01	0.01		6 272.12
FRTR 0 25/11/2020	31 000.00	0.91	0.91		28 340.20
NETHER 0,5% 15072032	24 817.00	0.97	0.97	14.62	24 096.04
BGB 0 22102027	1 000 000.00	0.01	0.01		9 681.00
BTPS 0.85 15012027	15.00	980.96	980.96	26.92	14 741.32
IRISH 0.2% 18102030	839 200.00	0.01	0.01	7.59	7 925.02
SPGB 0 31012026	57.00	973.82	973.82		55 507.74
BTPS 5.25 01112029	2 300 000.00	0.01	0.01	503.68	29 604.89
RAGB 0 200425	79.00	990.62	990.62		78 258.98
BKO 0 03/10/2023	11 000 000.00	0.01	0.01		110 440.00
FRTR 0 25022027	110 000.00	0.97	0.97		106 925.50
BTPS 1.45 15/05/2025	122.00	1 018.07	1 018.07	669.48	124 874.02
SPGB 0 31/01/2028	34.00	944.84	944.84		32 124.56
SPGB 0.7 30/04/2032	22.00	930.81	930.81	30.80	20 508.62
OBL 0 14/04/2027	3 000 000.00	0.01	0.01		29 434.80
FRTR 0 25/05/2032	22 000.00	0.91	0.91		19 925.18
FRTR 0 25022025	11 000.00	0.99	0.99		10 898.44
BTPS 0 01082026	33.00	950.34	950.34		31 361.22
Sub-total:					905 375.75
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	38.00	986.93	986.93		37 503.34
KFW 0 09112028	23.00	947.20	947.20		21 785.60
EU 0 20281004	11 927.00	0.95	0.95		11 283.78
Sub-total:					70 572.72
Sub-total:					975 948.47
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 366.00	28.33	28.33		208 641.95
DBX MSCI EUROPE	2 826.00	74.02	74.02		209 180.52
LYXOR UCITS ETF S&P	1 629.00	47.11	42.43		69 123.54
VANGUARD S&P 500 UCI	443.00	86.99	78.36		34 715.50
ISHARES CORE S&P 500	82.00	470.25	423.61		34 736.06
DBX S&P 500 ACC	878.00	87.76	79.06		69 411.12
ISHARES EURO GB 3-5Y	797.00	167.60	167.60		133 577.20
AMUNDI S&P500 UCITS	888.00	86.84	78.23		69 468.94
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	119.45	119.45		8 122.60
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	118.93	118.93		5 232.92
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	896.00	149.28	149.28		133 754.88
BNP INSTICASH-EUR-1D	2 760.46	98.88	98.88		272 941.49
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	104.89	104.89		4 824.94
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	102.23	102.23		18 810.32
X EUR CORPORATE BOND	545.00	153.92	153.92		83 886.40
ISHARES CORE EUR COR	44 136.00	5.07	5.07		223 725.38
STT-EURO CORP BOND I	5 614.00	14.86	14.86		83 450.43
AMUNDI 3 M- R2	3.07	99 208.99	99 208.99		304 869.23
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	104.08	104.08		3 538.72
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	111.77	111.77		4 359.03
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	69.58	69.58		4 313.96
AMUNDI PRI EURO COPR	2 884.00	19.34	19.34		55 773.68
INVESCO S&P 500 ACC	89.00	868.99	782.80		69 669.50
ISHARES CHINA CNY BO	5 914.00	5.83	5.25		31 073.94

## 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: 2022-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	4.65	4.18		5 075.57
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	27.30	27.30		4 258.64
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	135.63	135.63		5 289.57
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	107.37	107.37		4 080.06
GL EVO FDS FRT MRK-I	32.00	167.69	167.69		5 366.08
UBS-CHN FX IN RMB-IA	88.00	117.21	117.21		10 314.48
REAL ESTATE SELECT S	232.00	48.32	43.53		10 098.41
AMUNDI MSCI EUROPE	2 797.00	76.76	76.76		214 703.31
Sub-total:					2 396 388.36
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					504 734.35
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-7 785.32
Sub-total:					-7 785.32
Sub-total:					496 949.03
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 869 285.86
Unidades de Participação em circulação:		575 990.71			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.7176			

## 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: 2021-12-31

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					
SPGB 2.15% 31102025	58.00	1 092.36	1 092.36	211.82	63 568.70
BTPS 2% 01122025	3.00	1 067.90	1 067.90	5.10	3 208.80
NETHER 0.5% 15072026	56 000.00	1.04	1.04	130.41	58 540.65
SPGB 1.3% 31102026	56.00	1 069.40	1 069.40	123.66	60 010.06
BTPS 1.6% 01062026	43.00	1 055.42	1 055.42	58.43	45 441.49
DBR 0 08/15/31	3 300 000.00	0.01	0.01		33 572.88
BTPS 0 15/08/2024	57.00	998.91	998.91		56 937.87
BGB 0 22102027	1 000 000.00	0.01	0.01		10 157.30
BTPS 0.85 15012027	15.00	1 019.40	1 019.40	58.90	15 349.90
IRISH 0.2% 18102030	839 200.00	0.01	0.01	3.45	8 448.40
BTPS 5.25 01112029	2 300 000.00	0.01	0.01	203.47	31 028.30
RAGB 0 200425	77.00	1 014.58	1 014.58		78 122.66
FRTR 0 25022027	129 000.00	1.01	1.01		130 728.60
BTPS 1.45 15/05/2025	120.00	1 043.47	1 043.47	225.91	125 442.31
SPGB 0 31/01/2028	34.00	992.15	992.15		33 733.10
Sub-total:					754 291.02
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 500 000.00	0.01	0.01	13.05	15 215.55
KFW 0 09112028	23.00	1 005.80	1 005.80		23 133.40
EU 0 20281004	11 927.00	1.01	1.01		12 027.66
Sub-total:					50 376.61
Sub-total:					804 667.63
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BKO 0 03/10/2023	17 000 000.00	0.01	0.01		171 327.70
2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	37.00	1 011.89	1 011.89		37 440.05
Sub-total:					208 767.75
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 146.00	29.97	29.97		214 165.62
DBX MSCI EUROPE	2 754.00	78.35	78.35		215 775.90
LYXOR UCITS ETF S&P	1 640.00	48.79	43.08		70 645.90
VANGUARD S&P 500 UCI	443.00	90.50	79.90		35 397.76
ISHARES CORE S&P 500	82.00	490.15	432.77		35 486.76
DBX S&P 500 ACC	884.00	90.99	80.34		71 018.15
ISHARES EURO GB 3-5Y	797.00	173.09	173.09		137 952.73
AMUNDI ETF MSCI EURO	744.00	298.05	298.05		221 746.45
AMUNDI S&P500 UCITS	894.00	90.03	79.49		71 067.40
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	120.15	120.15		8 170.20
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	120.20	120.20		5 288.80
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	896.00	153.89	153.89		137 885.44
BNP INSTICASH-EUR-1D	2 760.46	99.04	99.04		273 393.10
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	107.38	107.38		4 939.48
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	113.02	113.02		20 795.68
X EUR CORPORATE BOND	545.00	162.33	162.33		88 469.85
ISHARES CORE EUR COR	44 136.00	5.35	5.35		236 149.67
STT-EURO CORP BOND I	5 614.00	15.76	15.76		88 458.11
AMUNDI 3 M- R2	3.07	99 373.84	99 373.84		305 375.81
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	113.38	113.38		3 854.92
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	117.48	117.48		4 581.72
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	73.87	73.87		4 579.94
AMUNDI PRI EURO COPR	2 884.00	20.46	20.46		59 012.41
INVESCO S&P 500 ACC	88.00	900.11	794.72		69 935.76
ISHARES CHINA CNY BO	5 914.00	5.81	5.13		30 339.67

## 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: 2021-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	4.92	4.35		5 273.01
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	27.98	27.98		4 364.41
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	134.99	134.99		5 264.61
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	118.43	118.43		4 500.34
GL EVO FDS FRT MRK-I	32.00	178.03	178.03		5 696.96
UBS-CHN FX IN RMB-IA	88.00	114.10	114.10		10 040.80
REAL ESTATE SELECT S	232.00	51.81	45.74		10 612.68
Sub-total:					2 460 240.02
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					542 104.47
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-10 896.75
Sub-total:					-10 896.75
Sub-total:					531 207.72
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					4 004 883.12
Unidades de Participação em circulação:		576 612.11			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.9455			

## 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: 2021-09-30

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
SPGB 2.15% 31102025	58.00	1 103.25	1 103.25	1 144.51	65 133.01
BTPS 2% 01122025	3.00	1 083.51	1 083.51	20.05	3 270.58
NETHER 0.5% 15072026	56 000.00	1.05	1.05	59.84	58 857.60
SPGB 1.3% 31102026	56.00	1 078.63	1 078.63	668.16	61 071.44
BTPS 1.6% 01062026	43.00	1 070.40	1 070.40	229.96	46 257.16
BGB 0 22102027	1 000 000.00	0.01	0.01		10 203.00
BTPS 0.85 15012027	15.00	1 033.59	1 033.59	26.92	15 530.77
IRISH 0.2% 18102030	839 200.00	0.01	0.01	16.00	8 499.47
BTPS 0.95 15092027	26.00	1 037.33	1 037.33	10.92	26 981.50
BTPS 2.8% 01122028	37.00	1 162.50	1 162.50	346.28	43 358.78
BTPS 5.25 01112029	2 300 000.00	0.01	0.01	502.03	31 995.93
BGB 0 221031	3 282 900.00	0.01	0.01		32 418.64
RAGB 0 200425	77.00	1 019.89	1 019.89		78 531.53
FRTR 0 25/02/2024	97 000.00	1.01	1.01		98 443.36
FRTR 0 25022027	86 000.00	1.02	1.02		87 548.00
BTPS 1.45 15/05/2025	120.00	1 056.38	1 056.38	657.23	127 422.83
Sub-total:					795 523.60
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	1 500 000.00	0.01	0.01	8.32	15 249.07
KFW 0 09112028	23.00	1 013.44	1 013.44		23 309.12
EU 0 20281004	11 927.00	1.01	1.01		12 093.02
Sub-total:					50 651.21
Sub-total:					846 174.81
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BKO 0 03/10/2023	16 900 000.00	0.01	0.01		170 728.87
2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	37.00	1 016.34	1 016.34		37 604.58
Sub-total:					208 333.45
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 456.00	27.95	27.95		208 357.92
DBX MSCI EUROPE	2 897.00	72.57	72.57		210 235.29
LYXOR UCITS ETF S&P	1 791.00	44.56	38.48		68 923.88
VANGUARD S&P 500 UCI	482.00	82.41	71.17		34 303.84
ISHARES CORE S&P 500	90.00	442.75	382.37		34 413.59
DBX S&P 500 ACC	965.00	82.64	71.37		68 872.61
ISHARES EURO GB 3-5Y	1 435.00	173.89	173.89		249 532.15
AMUNDI ETF MSCI EURO	782.00	276.44	276.44		216 175.38
AMUNDI S&P500 UCITS	976.00	81.76	70.61		68 912.31
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	119.88	119.88		8 151.84
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	119.62	119.62		5 263.28
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	344.00	154.63	154.63		53 192.72
BNP INSTICASH-EUR-1D	2 760.46	99.21	99.21		273 851.61
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	105.35	105.35		4 846.10
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	114.49	114.49		21 066.16
X EUR CORPORATE BOND	629.00	162.93	162.93		102 479.83
ISHARES CORE EUR COR	50 836.00	5.37	5.37		273 090.99
STT-EURO CORP BOND I	6 484.00	15.89	15.89		103 010.01
AMUNDI 3 M- R2	3.07	99 514.88	99 514.88		305 809.23
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	114.53	114.53		3 894.02
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	118.92	118.92		4 637.88
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	74.86	74.86		4 641.32
AMUNDI PRI EURO COPR	3 279.00	20.82	20.82		68 265.50
INVESCO S&P 500 ACC	98.00	817.41	705.94		69 182.30

## 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: 2021-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CHINA CNY BO	4 244.00	5.65	4.88		20 711.26
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	5.10	4.40		5 340.07
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	27.95	27.95		4 360.04
LYXOR MSCI WORLD-MH	981.00	10.29	10.29		10 098.41
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	134.60	134.60		5 249.40
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	121.02	121.02		4 598.76
GL EVO FDS FRT MRK-I	32.00	179.75	179.75		5 752.00
Sub-total:					2 517 219.70
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					341 342.62
Sub-total:					341 342.62
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-9 664.50
Sub-total:					-9 664.50
Sub-total:					331 678.12
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 903 406.08
Unidades de Participação em circulação:		570 751.16			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.8391			

## 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)
<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					
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
<b>5. Liquidez</b>					
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
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
<b>7. Operações com produtos derivados</b>					
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
<b>TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA</b>					<b>3 895 446.14</b>
Unidades de Participação em circulação:				571 363.98	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.8178	