

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: 2022-03-31

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					
BTPS 2% 01122025	2.00	1 037.16	1 037.16	13.26	2 087.58
NETHER 0.5% 15072026	26 000.00	1.01	1.01	92.60	26 232.48
SPGB 1.3% 31102026	25.00	1 024.90	1 024.90	135.34	25 757.84
BTPS 1.6% 01062026	20.00	1 019.89	1 019.89	106.08	20 503.88
DBR 0 08/15/31	299 200.00	0.01	0.01		2 851.14
FRTR 0 25/11/2020	14 000.00	0.91	0.91		12 798.80
NETHER 0,5% 15072032	11 208.00	0.97	0.97	6.60	10 882.39
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		4 840.50
BTPS 0.85 15012027	7.00	980.96	980.96	12.56	6 879.28
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	3.57	3 724.54
SPGB 0 31012026	25.00	973.82	973.82		24 345.50
BTPS 5.25 01112029	1 000 000.00	0.01	0.01	218.99	12 871.69
RAGB 0 200425	35.00	990.62	990.62		34 671.70
BKO 0 03/10/2023	4 900 000.00	0.01	0.01		49 196.00
FRTR 0 25022027	49 000.00	0.97	0.97		47 630.45
BTPS 1.45 15/05/2025	54.00	1 018.07	1 018.07	296.33	55 272.11
SPGB 0 31/01/2028	15.00	944.84	944.84		14 172.60
SPGB 0.7 30/04/2032	10.00	930.81	930.81	14.00	9 322.10
OBL 0 14/04/2027	1 300 000.00	0.01	0.01		12 755.08
FRTR 0 25/05/2032	10 000.00	0.91	0.91		9 056.90
FRTR 0 25022025	5 000.00	0.99	0.99		4 953.84
BTPS 0 01082026	15.00	950.34	950.34		14 255.10
Sub-total:					405 061.50
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	17.00	986.93	986.93		16 777.81
KFW 0 09112028	10.00	947.20	947.20		9 472.00
EU 0 20281004	5 176.00	0.95	0.95		4 896.86
Sub-total:					31 146.67
Sub-total:					436 208.17
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	3 266.00	28.33	28.33		92 509.45
DBX MSCI EUROPE	1 253.00	74.02	74.02		92 747.06
LYXOR UCITS ETF S&P	722.00	47.11	42.43		30 636.71
VANGUARD S&P 500 UCI	196.00	86.99	78.36		15 359.45
ISHARES CORE S&P 500	36.00	470.25	423.61		15 249.98
DBX S&P 500 ACC	389.00	87.76	79.06		30 752.76
ISHARES EURO GB 3-5Y	359.00	167.60	167.60		60 168.40
AMUNDI S&P500 UCITS	394.00	86.84	78.23		30 822.93
GAM LOCAL EMERG BD-E	30.00	119.45	119.45		3 583.50
JPMORGAN F-EM MAR LO	20.00	118.93	118.93		2 378.60
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	404.00	149.28	149.28		60 309.12
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 588.70	98.88	98.88		157 083.55
PICTET-EMERG LCL CCY	21.00	104.89	104.89		2 202.69
GS EMRG MKT CORP BD	83.00	102.23	102.23		8 485.09
X EUR CORPORATE BOND	246.00	153.92	153.92		37 864.32
ISHARES CORE EUR COR	19 888.00	5.07	5.07		100 812.27
STT-EURO CORP BOND I	2 530.00	14.86	14.86		37 607.69
AMUNDI 3 M- R2	1.67	99 208.99	99 208.99		165 877.43
JPM EMERG MKTS CORP	15.00	104.08	104.08		1 561.20
MUZIN EMERG MKTS SHO	18.00	111.77	111.77		2 011.86
PICTE-S/T EM CRP BD	28.00	69.58	69.58		1 948.24
AMUNDI PRI EURO COPR	1 299.00	19.34	19.34		25 121.36
INVESCO S&P 500 ACC	39.00	868.99	782.80		30 529.33
ISHARES CHINA CNY BO	2 620.00	5.83	5.25		13 766.27

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: 2022-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES JPM EM LCL G	546.00	4.65	4.18		2 284.63
SPDR BBG BARC EM LCL	70.00	27.30	27.30		1 910.93
DPAM L-BONDS EMK SU	17.00	135.63	135.63		2 305.71
AXA WORLD EMMK SH DU	17.00	107.37	107.37		1 825.29
GL EVO FDS FRT MRK-I	14.00	167.69	167.69		2 347.66
UBS-CHN FX IN RMB-IA	39.00	117.21	117.21		4 571.19
REAL ESTATE SELECT S	103.00	48.32	43.53		4 483.34
AMUNDI MSCI EUROPE	1 240.00	76.76	76.76		95 184.88
Sub-total:					1 134 302.90
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					145 084.24
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					229.46
Sub-total:					229.46
Sub-total:					145 313.70
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 715 824.77
Unidades de Participação em circulação:				131 906.25	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				13.0079	

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: 2021-12-31

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					
SPGB 2.15% 31102025	26.00	1 092.36	1 092.36	94.95	28 496.31
BTPS 2% 01122025	2.00	1 067.90	1 067.90	3.40	2 139.20
NETHER 0.5% 15072026	25 000.00	1.04	1.04	58.22	26 134.22
SPGB 1.3% 31102026	25.00	1 069.40	1 069.40	55.21	26 790.21
BTPS 1.6% 01062026	19.00	1 055.42	1 055.42	25.82	20 078.80
DBR 0 08/15/31	1 500 000.00	0.01	0.01		15 260.40
BTPS 0 15/08/2024	26.00	998.91	998.91		25 971.66
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		5 078.65
BTPS 0.85 15012027	7.00	1 019.40	1 019.40	27.49	7 163.29
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	1.62	3 970.51
BTPS 5.25 01112029	1 000 000.00	0.01	0.01	88.47	13 490.57
RAGB 0 200425	35.00	1 014.58	1 014.58		35 510.30
FRTR 0 25022027	58 000.00	1.01	1.01		58 777.20
BTPS 1.45 15/05/2025	54.00	1 043.47	1 043.47	101.66	56 449.04
SPGB 0 31/01/2028	15.00	992.15	992.15		14 882.25
Sub-total:					340 192.61
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	6.09	7 100.59
KFW 0 15092028	1.00	1 006.13	1 006.13		1 006.13
KFW 0 09112028	10.00	1 005.80	1 005.80		10 058.00
EU 0 20281004	5 176.00	1.01	1.01		5 219.69
Sub-total:					23 384.41
Sub-total:					363 577.02
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BKO 0 03/10/2023	7 600 000.00	0.01	0.01		76 593.56
2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	17.00	1 011.89	1 011.89		17 202.19
Sub-total:					93 795.75
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	3 164.00	29.97	29.97		94 825.08
DBX MSCI EUROPE	1 219.00	78.35	78.35		95 508.65
LYXOR UCITS ETF S&P	727.00	48.79	43.08		31 316.81
VANGUARD S&P 500 UCI	196.00	90.50	79.90		15 661.31
ISHARES CORE S&P 500	36.00	490.15	432.77		15 579.55
DBX S&P 500 ACC	391.00	90.99	80.34		31 411.88
ISHARES EURO GB 3-5Y	359.00	173.09	173.09		62 139.31
AMUNDI ETF MSCI EURO	330.00	298.05	298.05		98 355.28
AMUNDI S&P500 UCITS	396.00	90.03	79.49		31 479.52
GAM LOCAL EMERG BD-E	30.00	120.15	120.15		3 604.50
JPMORGAN F-EM MAR LO	20.00	120.20	120.20		2 404.00
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	404.00	153.89	153.89		62 171.56
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 588.70	99.04	99.04		157 343.46
PICTET-EMERG LCL CCY	21.00	107.38	107.38		2 254.98
GS EMRG MKT CORP BD	83.00	113.02	113.02		9 380.66
X EUR CORPORATE BOND	246.00	162.33	162.33		39 933.18
ISHARES CORE EUR COR	19 888.00	5.35	5.35		106 410.74
STT-EURO CORP BOND I	2 530.00	15.76	15.76		39 864.45
AMUNDI 3 M- R2	1.67	99 373.84	99 373.84		166 153.06
JPM EMERG MKTS CORP	15.00	113.38	113.38		1 700.70
MUZIN EMERG MKTS SHO	18.00	117.48	117.48		2 114.64
PICTE-S/T EM CRP BD	28.00	73.87	73.87		2 068.36
AMUNDI PRI EURO COPR	1 299.00	20.46	20.46		26 580.14
INVESCO S&P 500 ACC	39.00	900.11	794.72		30 994.26

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: 2021-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CHINA CNY BO	2 620.00	5.81	5.13		13 440.97
ISHARES JPM EM LCL G	546.00	4.92	4.35		2 373.50
SPDR BBG BARC EM LCL	70.00	27.98	27.98		1 958.39
DPAM L-BONDS EMK SU	17.00	134.99	134.99		2 294.83
AXA WORLD EMMK SH DU	17.00	118.43	118.43		2 013.31
GL EVO FDS FRT MRK-I	14.00	178.03	178.03		2 492.42
UBS-CHN FX IN RMB-IA	39.00	114.10	114.10		4 449.90
REAL ESTATE SELECT S	103.00	51.81	45.74		4 711.66
Sub-total:					1 162 991.07
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					156 445.53
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-2 736.77
Sub-total:					-2 736.77
Sub-total:					153 708.76
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 774 072.60
Unidades de Participação em circulação:				132 162.61	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				13.4234	

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: 2021-09-30

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
SPGB 2.15% 31102025	26.00	1 103.25	1 103.25	513.05	29 197.55
BTPS 2% 01122025	2.00	1 083.51	1 083.51	13.37	2 180.39
NETHER 0.5% 15072026	25 000.00	1.05	1.05	26.71	26 275.71
SPGB 1.3% 31102026	25.00	1 078.63	1 078.63	298.29	27 264.04
BTPS 1.6% 01062026	19.00	1 070.40	1 070.40	101.61	20 439.21
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		5 101.50
BTPS 0.85 15012027	7.00	1 033.59	1 033.59	12.56	7 247.69
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	7.52	3 994.51
BTPS 0.95 15092027	12.00	1 037.33	1 037.33	5.04	12 453.00
BTPS 2.8% 01122028	17.00	1 162.50	1 162.50	159.10	19 921.60
BTPS 5.25 01112029	1 000 000.00	0.01	0.01	218.27	13 911.27
BGB 0 221031	1 491 400.00	0.01	0.01		14 727.58
RAGB 0 200425	35.00	1 019.89	1 019.89		35 696.15
FRTR 0 25/02/2024	43 000.00	1.01	1.01		43 639.84
FRTR 0 25022027	38 000.00	1.02	1.02		38 684.00
BTPS 1.45 15/05/2025	53.00	1 056.38	1 056.38	290.28	56 278.42
Sub-total:					357 012.46
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
ESM 0.125 22042024	700 000.00	0.01	0.01	3.88	7 116.23
KFW 0 09112028	10.00	1 013.44	1 013.44		10 134.40
EU 0 20281004	5 176.00	1.01	1.01		5 248.05
Sub-total:					22 498.68
Sub-total:					379 511.14
2. Valores Não Cotados					
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					
2.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BKO 0 03/10/2023	7 500 000.00	0.01	0.01		75 767.25
2.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	17.00	1 016.34	1 016.34		17 277.78
Sub-total:					93 045.03
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	3 358.00	27.95	27.95		93 839.31
DBX MSCI EUROPE	1 305.00	72.57	72.57		94 703.85
LYXOR UCITS ETF S&P	793.00	44.56	38.48		30 517.38
VANGUARD S&P 500 UCI	213.00	82.41	71.17		15 159.17
ISHARES CORE S&P 500	40.00	442.75	382.37		15 294.93
DBX S&P 500 ACC	427.00	82.64	71.37		30 475.24
ISHARES EURO GB 3-5Y	705.00	173.89	173.89		122 592.45
AMUNDI ETF MSCI EURO	352.00	276.44	276.44		97 306.56
AMUNDI S&P500 UCITS	432.00	81.76	70.61		30 502.17
GAM LOCAL EMERG BD-E	30.00	119.88	119.88		3 596.40
JPMORGAN F-EM MAR LO	20.00	119.62	119.62		2 392.40
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	178.00	154.63	154.63		27 524.14
BNP INSTICASH-EUR-1D	1 588.70	99.21	99.21		157 607.34
PICTET-EMERG LCL CCY	21.00	105.35	105.35		2 212.35
GS EMRG MKT CORP BD	83.00	114.49	114.49		9 502.67
X EUR CORPORATE BOND	283.00	162.93	162.93		46 107.78
ISHARES CORE EUR COR	22 877.00	5.37	5.37		122 895.24
STT-EURO CORP BOND I	2 918.00	15.89	15.89		46 357.68
AMUNDI 3 M- R2	1.67	99 514.88	99 514.88		166 388.88
JPM EMERG MKTS CORP	15.00	114.53	114.53		1 717.95
MUZIN EMERG MKTS SHO	18.00	118.92	118.92		2 140.56
PICTE-S/T EM CRP BD	28.00	74.86	74.86		2 096.08
AMUNDI PRI EURO COPR	1 476.00	20.82	20.82		30 728.84
INVESCO S&P 500 ACC	43.00	817.41	705.94		30 355.50

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: 2021-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CHINA CNY BO	1 912.00	5.65	4.88		9 330.80
ISHARES JPM EM LCL G	546.00	5.10	4.40		2 403.69
SPDR BBG BARC EM LCL	70.00	27.95	27.95		1 956.43
LYXOR MSCI WORLD-MH	442.00	10.29	10.29		4 549.95
DPAM L-BONDS EMK SU	17.00	134.60	134.60		2 288.20
AXA WORLD EMMK SH DU	17.00	121.02	121.02		2 057.34
GL EVO FDS FRT MRK-I	14.00	179.75	179.75		2 516.50
Sub-total:					1 207 117.78
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					49 783.85
Sub-total:					49 783.85
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-1 727.75
Sub-total:					-1 727.75
Sub-total:					48 056.10
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 727 730.05
Unidades de Participação em circulação:		131 018.23			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		13.1869			

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.UE					
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					
Sub-total:					
124 599.47					
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
Sub-total:					
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	