

## 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: 2022-12-31

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.U.E					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
DBR 0.1% 15042023	2 000 000.00	0.01	0.01	17.25	24 762.61
BTPS 2% 01122025	5.00	957.08	957.08	8.22	4 793.62
NETHER 0.5% 15072026	73 000.00	0.93	0.93	169.00	67 787.44
SPGB 1.3% 31102026	54.00	937.84	937.84	117.32	50 760.68
BTPS 1.6% 01062026	30.00	933.48	933.48	39.45	28 043.85
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		6 946.96
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.77	0.77		29 951.61
SPGBEI 0.15 30112023	33.00	1 192.87	1 192.87	4.20	39 368.88
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.90	0.90	336.51	48 011.07
SPGB 0 31012027	102.00	881.50	881.50		89 913.00
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 328.59
BTPS 0.85 15012027	20.00	893.10	893.10	77.92	17 939.92
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	4.62	9 222.46
BTPS 0.6% 01082031	30.00	728.43	728.43	74.35	21 927.25
FRTR 0 25022027	139 000.00	0.89	0.89		123 825.37
SPGB 0 31/01/2028	9.00	853.63	853.63		7 682.67
SPGB 0.7 30/04/2032	55.00	774.46	774.46	258.42	42 853.72
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		34 136.16
FRTR 0 25/05/2032	74 000.00	0.75	0.75		55 676.12
FRTR 0 25022025	14 000.00	0.94	0.94		13 164.06
BTPS 0 01082026	42.00	876.88	876.88		36 828.96
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.79	0.79		24 618.34
DBR 0 15022032	3 700 000.00	0.01	0.01		29 531.18
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	904.50	904.50	104.79	27 239.79
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	170.39	24 740.13
BUBILL 0 13042023	6 500 000.00	0.01	0.01		64 640.55
BTPS 1.2 08/15/25	74.00	941.41	941.41	333.00	69 997.34
BGTB 0 09112023	1 900 000.00	0.01	0.01		18 555.97
Sub-total:					1 024 248.30
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EU 0.8 04/04/2025	85 000.00	0.95	0.95	422.90	81 065.80
KFW CUP 0 02/18/25	49.00	940.44	940.44		46 081.56
KFW 0 09112028	30.00	837.45	837.45		25 123.50
EU 0 20281004	15 927.00	0.84	0.84		13 414.36
ESM 1% 23092025	2 489 800.00	0.01	0.01	67.53	23 700.96
Sub-total:					189 386.18
Sub-total:					1 213 634.48
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	101.92	101.92		71 751.68
ISHARES MSCI EUROPE	6 994.00	26.46	26.46		185 061.24
DBX MSCI EUROPE	2 612.00	71.17	71.17		185 896.04
LYXOR UCITS ETF S&P	1 603.00	38.95	36.52		58 534.45
VANGUARD S&P 500 UCI	431.00	72.55	68.02		29 316.08
ISHARES CORE S&P 500	79.00	395.45	370.76		29 289.85
DBX S&P 500 ACC	850.00	74.06	69.43		59 016.27
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	155.04	155.04		126 512.64
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	125.70	125.70		46 744.49
AMUNDI S&P500 UCITS	860.00	73.16	68.59		58 984.99
GAM LOCAL EMERG BD-E	43.00	117.70	117.70		5 061.10
JPMORGAN F-EM MAR LO	28.00	117.30	117.30		3 284.40
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	138.26	138.26		126 369.64
SCHRODER IE CORP BON	967.00	22.56	22.56		21 814.17
BNP INSTICASH-EUR-1D	710.28	98.96	98.96		70 291.20
AXA WORLD EUR CR SHD	265.00	96.65	96.65		25 612.25

## 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: 2022-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
PICTET-EMERG LCL CCY	30.00	104.97	104.97		3 149.10
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	96.77	96.77		17 805.68
X EUR CORPORATE BOND	1 753.00	140.67	140.67		246 585.75
VONTOBEL EUR CRP MDY	109.96	98.71	98.71		10 854.25
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	92.21	92.21		18 165.37
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	96.77	96.77		3 290.18
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	106.29	106.29		4 145.31
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	68.75	68.75		4 262.50
AMUNDI PRI EURO COPR	13 956.00	17.37	17.37		242 373.85
INVESCO S&P 500 ACC	86.00	733.36	687.57		59 130.85
DPAM L-BONDS EMK SU	25.00	133.58	133.58		3 339.50
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	101.29	101.29		3 849.02
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	157.39	157.39		3 619.97
AMUNDI MSCI EUROPE	2 590.00	73.72	73.72		190 937.39
INVESCO EUR CORP BON	2 180.00	9.97	9.97		21 739.18
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	51.96	48.72		143 613.43
Sub-total:					2 080 401.80
<b>5. Liquidez</b>					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					378 864.51
Sub-total:					378 864.51
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-28 927.21
Sub-total:					-28 927.21
Sub-total:					349 937.30
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
<b>7. Operações com produtos derivados</b>					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BUND FUT MAR23	1.00				
FUT EUR/USD CME 0312	1.00				
EURO-BUND FUT MAR23					-132 930.00
FUT EUR/USD CME 0312					-126 031.31
EURO-BUND FUT MAR23	1.00	132 930.00	132 930.00		132 930.00
FUT EUR/USD CME 0312	1.00	134 425.00	126 031.31		126 031.31
<b>TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA</b>					<b>3 643 973.58</b>

Unidades de Participação em circulação: 584 840.64  
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.2307

## 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: 2022-09-30

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.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
BTPS 2% 01122025	3.00	961.60	961.60	20.00	2 904.80
NETHER 0.5% 15072026	60 000.00	0.95	0.95	64.11	56 845.11
SPGB 1.3% 31102026	45.00	955.52	955.52	536.92	43 535.32
BTPS 1.6% 01062026	24.00	938.66	938.66	128.00	22 655.84
DBR 0 08/15/31	658 200.00	0.01	0.01		5 506.63
FRTR 0 25/11/2020	33 000.00	0.79	0.79		26 168.67
NETHER 0,5% 15072032	26 817.00	0.83	0.83	28.65	22 386.52
BGB 0 22102027	1 100 000.00	0.01	0.01		9 794.29
BTPS 0.85 15012027	16.00	893.68	893.68	28.71	14 327.59
IRISH 0.2% 18102030	939 200.00	0.01	0.01	17.91	7 864.74
BTPS 0.6% 01082031	25.00	730.82	730.82	24.86	18 295.36
FRTR 0 25022027	114 000.00	0.91	0.91		103 465.26
SPGB 0 31/01/2028	7.00	866.46	866.46		6 065.22
SPGB 0.7 30/04/2032	45.00	794.35	794.35	132.90	35 878.43
OBL 0 14/04/2027	3 200 000.00	0.01	0.01		29 360.96
FRTR 0 25/05/2032	60 000.00	0.78	0.78		46 638.00
FRTR 0 25022025	12 000.00	0.95	0.95		11 440.20
BTPS 0 01082026	35.00	875.83	875.83		30 654.05
FRTR 0 25/11/2030	26 000.00	0.82	0.82		21 281.00
DBR 0 15022032	3 100 000.00	0.01	0.01		25 586.78
SPGB 2.55 31/10/2032	38.00	937.53	937.53	289.37	35 915.51
RAGB 0 0.5 24042027	24.00	921.55	921.55	53.92	22 171.12
OBL 1.3 15102027	2 100 000.00	0.01	0.01	69.56	20 408.27
BOTS 0 14122022	72.00	998.18	998.18		71 868.96
SGLT 0 13012023	52.00	997.59	997.59		51 874.68
BUBILL 0 13042023	5 300 000.00	0.01	0.01		52 628.47
BTPS 1.2 08/15/25	61.00	942.19	942.19	93.49	57 567.08
Sub-total:					853 088.86
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EU 0.8 04/04/2025	69 000.00	0.96	0.96	205.68	66 442.23
KFW CUP 0 02/18/25	40.00	947.78	947.78		37 911.20
KFW 0 09112028	25.00	852.83	852.83		21 320.75
EU 0 20281004	12 927.00	0.85	0.85		11 006.82
ESM 1% 23092025	1 989 800.00	0.01	0.01	4.36	19 074.21
Sub-total:					155 755.21
Sub-total:					1 008 844.07
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 890.00	24.23	24.23		191 135.25
DBX MSCI EUROPE	2 964.00	64.53	64.53		191 266.92
LYXOR UCITS ETF S&P	1 603.00	37.54	38.51		61 738.44
VANGUARD S&P 500 UCI	431.00	69.44	71.24		30 702.34
ISHARES CORE S&P 500	77.00	377.50	387.26		29 818.94
DBX S&P 500 ACC	850.00	70.61	72.44		61 570.07
ISHARES EURO GB 3-5Y	797.00	157.42	157.42		125 463.74
AMUNDI S&P500 UCITS	860.00	69.80	71.61		61 580.69
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	117.96	117.96		8 021.28
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	117.83	117.83		5 184.52
SPDR BBG 0-3Y EURO C	1 629.00	28.86	28.86		47 008.05
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	896.00	140.21	140.21		125 628.16
SCHRODER IE CORP BON	967.00	22.06	22.06		21 328.73
BNP INSTICASH-EUR-1D	2 377.21	98.68	98.68		234 576.19
AXA WORLD EUR CR SHD	265.00	95.95	95.95		25 426.75
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	106.38	106.38		4 893.48
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	92.61	92.61		17 040.24

## 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: 2022-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
X EUR CORPORATE BOND	1 753.00	138.56	138.56		242 886.92
VONTOBEL EUR CRP MDY	109.96	95.95	95.95		10 550.76
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	86.22	86.22		16 985.34
AMUNDI 3 M- R2	3.07	99 086.03	99 086.03		304 491.37
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	91.30	91.30		3 104.20
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	103.93	103.93		4 053.27
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	66.89	66.89		4 147.18
AMUNDI PRI EURO COPR	13 956.00	17.37	17.37		242 422.70
INVESCO S&P 500 ACC	86.00	698.98	717.05		61 666.27
ISHARES CHINA CNY BO	1 782.00	5.34	5.48		9 769.19
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	4.03	4.13		5 011.96
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	26.59	26.59		4 148.04
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	131.90	131.90		5 144.10
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	98.06	98.06		3 726.28
GL EVO FDS FRT MRK-I	32.00	149.01	149.01		4 768.32
UBS-CHN FX IN RMB-IA	80.00	121.38	121.38		9 710.40
AMUNDI MSCI EUROPE	2 946.00	67.01	67.01		197 399.68
INVESCO EUR CORP BON	2 180.00	9.75	9.75		21 254.35
VAND USDCP1-3 USD	1 455.00	51.32	52.64		76 593.48
Sub-total:					2 470 217.60
<b>5. Liquidez</b>					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					
					98 760.03
Sub-total:					
					98 760.03
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
					-9 128.44
Sub-total:					
					-9 128.44
Sub-total:					
					89 631.59
<b>PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS</b>					
<b>7. Operações com produtos derivados</b>					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BUND FUT DEC22	1.00				
FUT EUR/USD CME 1222	1.00				
EURO-BUND FUT DEC22					-138 490.00
FUT EUR/USD CME 1222					-126 455.43
EURO-BUND FUT DEC22	1.00	138 490.00	138 490.00		138 490.00
FUT EUR/USD CME 1222	1.00	123 268.75	126 455.43		126 455.43
<b>TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA</b>					<b>3 568 693.26</b>
Unidades de Participação em circulação:		574 430.23			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.2126			

## 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: 2022-06-30

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					
BTPS 2% 01122025	3.00	1 000.10	1 000.10	4.92	3 005.22
NETHER 0.5% 15072026	60 000.00	0.97	0.97	288.49	58 781.89
SPGB 1.3% 31102026	59.00	987.40	987.40	510.63	58 767.23
BTPS 1.6% 01062026	46.00	980.68	980.68	60.33	45 171.61
DBR 0 08/15/31	658 200.00	0.01	0.01		5 820.92
FRTR 0 25/11/2020	33 000.00	0.84	0.84		27 707.79
NETHER 0,5% 15072032	26 817.00	0.89	0.89	49.23	23 834.84
BGB 0 22102027	1 100 000.00	0.01	0.01		10 223.51
BTPS 0.85 15012027	16.00	936.63	936.63	62.74	15 048.82
IRISH 0.2% 18102030	939 200.00	0.01	0.01	13.17	8 248.36
SPGB 0 31012026	60.00	946.90	946.90		56 814.00
BTPS 5.25 01112029	2 400 000.00	0.01	0.01	208.86	28 077.66
BTPS 0.6% 01082031	25.00	796.70	796.70	62.15	19 979.65
RAGB 0 200425					
FRTR 0 25022027	117 000.00	0.94	0.94		109 965.96
BTPS 1.45 15/05/2025				235.19	235.19
SPGB 0 31/01/2028	7.00	901.69	901.69		6 311.83
SPGB 0.7 30/04/2032	45.00	848.02	848.02		38 160.90
OBL 0 14/04/2027	3 200 000.00	0.01	0.01		30 451.20
FRTR 0 25/05/2032	62 000.00	0.83	0.83		51 192.78
FRTR 0 25022025	12 000.00	0.97	0.97		11 672.28
BTPS 0 01082026	35.00	913.35	913.35		31 967.25
FRTR 0 25/11/2030	26 000.00	0.86	0.86		22 413.30
DBR 0 15022032	3 100 000.00	0.01	0.01		27 203.74
SPGB 2.55 31/10/2032	38.00	999.85	999.85	45.13	38 039.43
RAGB 0 0.5 24042027	24.00	963.04	963.04		23 112.96
OBL 1.3 15102027	2 100 000.00	0.01	0.01		21 249.90
Sub-total:					773 458.22
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW CUP 0 02/18/25	40.00	971.45	971.45		38 858.00
KFW 0 09112028	25.00	898.89	898.89		22 472.25
EU 0 20281004	12 927.00	0.90	0.90		11 604.70
Sub-total:					72 934.95
Sub-total:					846 393.17
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISHARES MSCI EUROPE	7 564.00	25.53	25.53		193 071.10
DBX MSCI EUROPE	2 860.00	67.42	67.42		192 821.20
LYXOR UCITS ETF S&P	1 726.00	38.96	37.50		64 731.23
VANGUARD S&P 500 UCI	466.00	71.65	68.98		32 144.89
ISHARES CORE S&P 500	86.00	388.20	373.74		32 141.33
DBX S&P 500 ACC	924.00	72.60	69.90		64 583.04
ISHARES EURO GB 3-5Y	797.00	162.70	162.70		129 671.90
AMUNDI S&P500 UCITS	935.00	71.75	69.08		64 590.79
GAM LOCAL EMERG BD-E	68.00	116.17	116.17		7 899.56
JPMORGAN F-EM MAR LO	44.00	116.42	116.42		5 122.48
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	896.00	145.06	145.06		129 973.76
SCHRODER IE CORP BON	967.00	22.62	22.62		21 869.77
BNP INSTICASH-EUR-1D	2 760.46	98.73	98.73		272 529.08
PICTET-EMERG LCL CCY	46.00	104.11	104.11		4 789.06
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	95.02	95.02		17 483.68
X EUR CORPORATE BOND	1 753.00	142.45	142.45		249 714.85
ISHARES CORE EUR COR					
STT-EURO CORP BOND I	5 614.00	13.84	13.84		77 687.65
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	91.28	91.28		17 982.16

## 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: 2022-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AMUNDI 3 M- R2	3.07	99 081.02	99 081.02		304 475.97
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	95.64	95.64		3 251.76
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	106.63	106.63		4 158.57
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	67.78	67.78		4 202.36
AMUNDI PRI EURO COPR	13 956.00	17.88	17.88		249 575.15
INVESCO S&P 500 ACC	93.00	718.03	691.28		64 288.81
ISHARES CHINA CNY BO	1 782.00	5.59	5.38		9 595.04
ISHARES JPM EM LCL G	1 213.00	4.24	4.08		4 948.29
SPDR BBG BARC EM LCL	156.00	26.38	26.38		4 114.81
DPAM L-BONDS EMK SU	39.00	130.14	130.14		5 075.46
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	100.83	100.83		3 831.54
GL EVO FDS FRT MRK-I	32.00	157.21	157.21		5 030.72
UBS-CHN FX IN RMB-IA	80.00	119.47	119.47		9 557.60
AMUNDI MSCI EUROPE	2 842.00	69.96	69.96		198 837.69
INVESCO EUR CORP BON	2 180.00	10.07	10.07		21 951.51
Sub-total:					2 471 702.81
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					431 834.06
Sub-total:					431 834.06
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-83 312.93
Sub-total:					-83 312.93
Sub-total:					348 521.13
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 666 617.11
Unidades de Participação em circulação:		575 132.55			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.3753			

## 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			