

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: 2024-03-31

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.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
NETHER 0.5% 15072026	18 000.00	0.95	0.95	63.93	17 178.15
BTPS 1.6% 01062026	11.00	967.30	967.30	58.19	10 698.49
DBR 0 08/15/31	299 200.00	0.01	0.01		2 545.74
FRTR 0 25/11/2020	14 000.00	0.82	0.82		11 442.20
FRTR 0.75 25022028	20 000.00	0.93	0.93	14.38	18 608.38
SPGB 0 31012027	25.00	922.00	922.00		23 050.00
BGB 0.8% 22062028	1 800 000.00	0.01	0.01	111.34	16 819.21
SPBG 1.4% 30072028	22.00	943.45	943.45	206.17	20 962.07
BGB 0.9% 22062029	1 800 000.00	0.01	0.01	125.26	16 638.46
RFGB 0.5% 15092029	8.00	892.42	892.42	21.64	7 161.00
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		4 553.25
BTPS 0.85 15012027	7.00	939.65	939.65	12.42	6 589.97
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	3.56	3 390.67
BTPS 2.8% 01122028	12.00	985.18	985.18	111.08	11 933.24
BTPS 0.6% 01082031	11.00	821.40	821.40	10.70	9 046.10
SPGB 0.5% 31102031	9.00	835.20	835.20	18.69	7 535.49
FRTR 0 25022027	21 000.00	0.92	0.92		19 409.88
OBL 0 14/04/2027	1 400 000.00	0.01	0.01		12 988.36
FRTR 0 25/11/2030	11 000.00	0.84	0.84		9 252.10
RAGB 0 0.5 24042027	11.00	934.51	934.51	51.99	10 331.60
OBL 1.3 15102027	1 000 000.00	0.01	0.01	59.84	9 684.54
RFGB 0.5 15092028	21.00	909.24	909.24	56.80	19 150.84
RAGB 0.5 20022029	20.00	901.90	901.90	10.96	18 048.96
SPGB 0.8 30072029	12.00	900.35	900.35	64.44	10 868.64
DBR 2.1 15112029	1 000 000.00	0.01	0.01	78.61	9 978.61
OBL 2.2 13042028	2 900 000.00	0.01	0.01	763.85	29 562.30
BTPS 4 30102031	16.00	1 040.70	1 040.70	267.54	16 918.74
BTPS 2.8 15062029	17.00	980.29	980.29	139.16	16 804.09
NETHER 2.5% 15012030	9 000.00	1.00	1.00	46.72	9 042.22
FRTR 2.75 25022029	9 000.00	1.00	1.00	23.67	9 062.37
SPGB 3.5% 31052029	10.00	1 031.40	1 031.40	165.44	10 479.44
FRTR 2.5% 25052030	12 000.00	0.99	0.99	254.92	12 167.92
RFGB 0 15092026	11.00	932.87	932.87		10 261.57
FRTR 5.5% 25042029	6 000.00	1.13	1.13	307.46	7 098.08
BTPS 4 15112023	16.00	1 037.76	1 037.76	240.00	16 844.16
EU 3% 04122034	9 550.00	1.01	1.01	25.83	9 653.47
Sub-total:					455 760.31
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	11.00	884.36	884.36		9 727.96
MADRID 3.462 300434	9.00	1 011.55	1 011.55	26.46	9 130.41
Sub-total:					18 858.37
Sub-total:					474 618.68
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15012030	208.00	108.57	100.43	6.01	20 894.56
TII 0.125 15072030	208.00	108.45	100.32	6.01	20 871.57
TII 0.125 15012031	214.00	105.48	97.57	6.09	20 885.98
Sub-total:					62 652.12
Sub-total:					537 270.80
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	105.28	105.28		32 636.80
ISHARES MSCI EUROPE	2 145.00	32.01	32.01		68 650.73
DBX MSCI EUROPE	775.00	88.57	88.57		68 641.75
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	138.78	138.78		11 990.59
LYXOR UCITS ETF S&P	460.00	53.89	49.85		22 929.79

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: 2024-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
VANGUARD S&P 500 UCI	125.00	99.47	92.01		11 500.73
ISHARES CORE S&P 500	22.00	552.00	510.59		11 233.00
DBX S&P 500 ACC	240.00	103.45	95.69		22 965.50
BBVA CREDITO EUROPA	166.16	132.66	132.66		22 043.60
AMUNDI S&P500 UCITS	242.00	102.28	94.61		22 894.48
JPMORGAN F-EM MAR LO	11.00	128.45	128.45		1 412.95
SCHRODER IE CORP BON	562.00	25.24	25.24		14 186.17
UBAM GHYS AHC EUR	120.00	182.02	182.02		21 842.40
PICTET-EMERG LCL CCY	12.00	111.25	111.25		1 335.00
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	105.62	105.62		2 218.02
X EUR CORPORATE BOND	652.00	151.52	151.52		98 791.04
VONTOBEL EUR CRP MDY	65.38	107.90	107.90		7 054.83
BLACKROCK GIF I EMMK	81.00	101.30	101.30		8 205.30
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	102.78	102.78		308.34
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	113.42	113.42		1 587.88
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	72.26	72.26		2 384.58
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.37	18.37		96 941.03
INVESCO S&P 500 ACC	24.00	1 025.24	948.33		22 759.93
DPAM L-BONDS EMK SU	9.00	153.42	153.42		1 380.78
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	106.80	106.80		1 495.20
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	180.54	180.54		1 805.40
AMUNDI MSCI EUROPE	770.00	91.71	91.71		70 613.62
INVESCO EUR CORP BON	1 293.00	10.85	10.85		14 031.25
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	55.27	51.12		65 847.53
ISHARES USD TRS 1-3Y	12 518.00	4.82	4.82		60 380.57
Sub-total:					790 068.79
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					62 826.46
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					527.40
Sub-total:					63 353.86
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BOBL FUT JUN24	1.00				
STOXX EUROPE600 0624	2.00				
FUT MINI EUR/USD CME	2.00				
EURO-BOBL FUT JUN24					-118 250.00
STOXX EUROPE600 0624					-51 080.00
FUT MINI EUR/USD CME					-125 121.40
EURO-BOBL FUT JUN24	1.00	118 250.00	118 250.00		118 250.00
STOXX EUROPE600 0624	2.00	25 540.00	25 540.00		51 080.00
FUT MINI EUR/USD CME	2.00	67 634.38	62 560.70		125 121.40
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 390 693.45

Unidades de Participação em circulação: 104 788.85
Valor Unitário de Unidades de Participação: 13.2714

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: 2023-12-31

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					
NETHER 0.5% 15072026	19 000.00	0.96	0.96	43.87	18 236.37
BTPS 1.6% 01062026	12.00	972.84	972.84	15.74	11 689.82
DBR 0 08/15/31	399 200.00	0.01	0.01		3 455.95
FRTR 0 25/11/2020	16 000.00	0.83	0.83		13 289.44
FRTR 0.75 25022028	22 000.00	0.94	0.94	139.68	20 867.64
SPGB 0 31012027	28.00	925.40	925.40		25 911.20
BGB 0.8% 22062028	2 000 000.00	0.01	0.01	83.93	18 888.73
SPBG 1.4% 30072028	23.00	951.12	951.12	135.49	22 011.25
BGB 0.9% 22062029	2 000 000.00	0.01	0.01	94.43	18 691.43
BGB 0 22102027	600 000.00	0.01	0.01		5 519.16
BTPS 0.85 15012027	8.00	944.46	944.46	31.23	7 586.91
IRISH 0.2% 18102030	494 400.00	0.01	0.01	2.00	4 303.23
BTPS 2.8% 01122028	13.00	992.66	992.66	29.84	12 934.42
BTPS 0.6% 01082031	13.00	817.57	817.57	32.22	10 660.63
SPGB 0.5% 31102031	10.00	841.46	841.46	8.33	8 422.93
FRTR 0 25022027	45 000.00	0.93	0.93		41 952.60
OBL 0 14/04/2027	1 600 000.00	0.01	0.01		14 982.56
FRTR 0 25/11/2030	14 000.00	0.86	0.86		11 972.52
RAGB 0 0.5 24042027	12.00	942.89	942.89	41.80	11 356.48
OBL 1.3 15102027	1 100 000.00	0.01	0.01	30.17	10 767.82
RFGB 0.5 15092028	23.00	919.28	919.28	33.62	21 177.06
RAGB 0.5 20022029	21.00	911.95	911.95	90.33	19 241.28
SPGB 0.8 30072029	13.00	906.79	906.79	43.88	11 832.15
DBR 2.1 15112029	1 100 000.00	0.01	0.01	29.03	11 138.26
BTPS 3.85 15122029	6.00	1 036.85	1 036.85	10.10	6 231.20
OBL 2.2 13042028	3 200 000.00	0.01	0.01	667.35	32 968.79
BTPS 4 30102031	16.00	1 042.35	1 042.35	108.42	16 786.02
BTPS 2.8 15062029	18.00	986.15	986.15	22.03	17 772.73
NETHER 2.5% 15012030	10 000.00	1.02	1.02	184.25	10 371.55
FRTR 2.75 25022029	10 000.00	1.02	1.02	232.81	10 470.61
SPGB 3.5% 31052029	28.00	1 044.53	1 044.53	219.56	29 466.40
BKP 3.1 12/12/2025	800 000.00	0.01	0.01	49.60	8 152.72
FRTR 2.5% 25052030	13 000.00	1.01	1.01	195.36	13 363.71
RFGB 0 15092026	12.00	937.50	937.50		11 250.00
Sub-total:					513 723.57
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	12.00	890.60	890.60		10 687.20
Sub-total:					524 410.77
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15012030	208.00	108.51	98.20	12.93	20 437.73
TII 0.125 15072030	208.00	108.55	98.23	12.97	20 445.31
TII 0.125 15012031	214.00	105.65	95.61	13.26	20 473.09
Sub-total:					61 356.13
Sub-total:					585 766.90
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	106.23	106.23		32 931.30
ISHARES MSCI EUROPE	2 416.00	29.73	29.73		71 815.60
DBX MSCI EUROPE	876.00	82.35	82.35		72 138.60
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	138.05	138.05		11 927.52
LYXOR UCITS ETF S&P	528.00	48.93	44.28		23 380.13
VANGUARD S&P 500 UCI	142.00	90.74	82.12		11 660.71
ISHARES CORE S&P 500	26.00	498.75	451.36		11 735.29
DBX S&P 500 ACC	275.00	93.99	85.06		23 391.18
BBVA CREDITO EUROPA	166.16	131.95	131.95		21 925.33

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: 2023-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AMUNDI S&P500 UCITS	278.00	92.36	83.58		23 236.27
JPMORGAN F-EM MAR LO	11.00	128.90	128.90		1 417.90
SCHRODER IE CORP BON	562.00	24.85	24.85		13 965.19
PICTET-EMERG LCL CCY	12.00	112.26	112.26		1 347.12
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	103.66	103.66		2 176.86
X EUR CORPORATE BOND	652.00	151.13	151.13		98 536.76
VONTOBEL EUR CRP MDY	65.38	107.24	107.24		7 011.67
BLACKROCK GIF I EMMK	154.00	99.74	99.74		15 359.96
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	101.03	101.03		303.09
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	111.16	111.16		1 556.24
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	70.90	70.90		2 339.70
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.32	18.32		96 695.60
INVESCO S&P 500 ACC	28.00	931.37	842.87		23 600.33
ISHARES JPM EM LCL G	497.00	4.90	4.43		2 201.87
DPAM L-BONDS EMK SU	9.00	151.01	151.01		1 359.09
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	104.95	104.95		1 469.30
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	169.75	169.75		1 697.50
AMUNDI MSCI EUROPE	869.00	85.12	85.12		73 969.28
INVESCO EUR CORP BON	1 293.00	10.79	10.79		13 956.64
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	54.76	49.56		63 828.85
ISHARES USD TRS 1-3Y	12 518.00	4.82	4.82		60 393.09
Sub-total:					787 327.96
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					57 209.78
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-2 660.30
Sub-total:					
54 549.48					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT MINI EUR/USD CME	2.00				
EURO-BOBL FUT MAR24	1.00				
FUT MINI EUR/USD CME					-125 282.81
EURO-BOBL FUT MAR24					-119 280.00
FUT MINI EUR/USD CME	2.00	69 218.75	62 641.40		125 282.81
EURO-BOBL FUT MAR24	1.00	119 280.00	119 280.00		119 280.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 427 644.34
Unidades de Participação em circulação:				109 586.46	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				13.0276	

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: CVI PPR
 Data: 2023-09-30

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					
NETHER 0.5% 15072026	20 000.00	0.93	0.93	21.04	18 651.04
BTPS 1.6% 01062026	12.00	941.56	941.56	63.48	11 362.20
DBR 0 08/15/31	399 200.00	0.01	0.01		3 224.82
FRTR 0 25/11/2020	16 000.00	0.77	0.77		12 302.40
FRTR 0.75 25022028	22 000.00	0.90	0.90	98.10	19 951.56
SPGB 0 31012027	28.00	891.46	891.46		24 960.88
SPBG 1.4% 30072028	24.00	907.78	907.78	56.92	21 843.64
BGB 0.9% 22062029	2 000 000.00	0.01	0.01	49.18	17 706.58
SPGB 1.45% 30042029	18.00	895.38	895.38	109.11	16 225.95
BGB 0 22102027	600 000.00	0.01	0.01		5 289.60
BTPS 0.85 15012027	8.00	904.77	904.77	14.17	7 252.33
IRISH 0.2% 18102030	494 400.00	0.01	0.01	9.40	4 026.94
BTPS 2.8% 01122028	13.00	937.15	937.15	120.34	12 303.29
BTPS 0.6% 01082031	13.00	745.83	745.83	12.72	9 708.51
FRTR 0 25022027	47 000.00	0.90	0.90		42 257.70
SPGB 0 31/01/2028	27.00	861.65	861.65		23 264.55
OBL 0 14/04/2027	1 600 000.00	0.01	0.01		14 483.84
BTPS 0 01082026	18.00	895.11	895.11		16 111.98
FRTR 0 25/11/2030	14 000.00	0.80	0.80		11 159.68
RAGB 0 0.5 24042027	12.00	910.52	910.52	26.72	10 952.96
OBL 1.3 15102027	1 100 000.00	0.01	0.01	179.04	10 553.80
NETHER 2.5 15072033	4 236.00	0.95	0.95	22.45	4 045.59
RFGB 0.5 15092028	23.00	876.55	876.55	4.71	20 165.36
RAGB 0.5 20022029	22.00	865.96	865.96	66.90	19 118.02
SPGB 0.8 30072029	27.00	855.55	855.55	36.69	23 136.54
DBR 2.1 15112029	1 100 000.00	0.01	0.01	218.34	10 811.89
BTPS 3.85 15122029	6.00	973.50	973.50	67.53	5 908.53
OBL 2.2 13042028	3 300 000.00	0.01	0.01	505.22	32 681.21
DBR 2.3 15022033	800 000.00	0.01	0.01	131.07	7 794.43
BTPS 4 30102031	16.00	966.67	966.67	267.54	15 734.26
SPGB 3.55% 10/31/33	10.00	967.92	967.92	105.04	9 784.24
BTPS 2.8 15062029	19.00	926.10	926.10	155.53	17 751.43
NETHER 2.5% 15012030	10 000.00	0.97	0.97	121.23	9 793.73
FRTR 2.75 25022029	10 000.00	0.98	0.98	163.49	9 946.49
Sub-total:					500 265.97
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	12.00	844.20	844.20		10 130.40
Sub-total:					510 396.37
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	102.31	102.31		31 716.10
ISHARES MSCI EUROPE	2 717.00	28.09	28.09		76 306.95
DBX MSCI EUROPE	987.00	77.33	77.33		76 324.71
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	134.39	134.39		11 611.30
LYXOR UCITS ETF S&P	592.00	44.41	41.92		24 813.82
VANGUARD S&P 500 UCI	161.00	81.68	77.10		12 413.14
ISHARES CORE S&P 500	29.00	450.20	424.96		12 323.77
DBX S&P 500 ACC	312.00	84.37	79.64		24 847.50
ISHARES EURO GB 3-5Y	370.00	156.60	156.60		57 942.00
BBVA CREDITO EUROPA	166.16	128.33	128.33		21 323.64
AMUNDI S&P500 UCITS	315.00	83.40	78.72		24 796.51
JPMORGAN F-EM MAR LO	11.00	123.05	123.05		1 353.55
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	415.00	139.18	139.18		57 759.70
SCHRODER IE CORP BON	264.00	23.33	23.33		6 159.36
AXA WF-FRM EUROPE R	12.00	211.59	211.59		2 539.08

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: CVI PPR
 Data: 2023-09-30

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)	
UBAM GHYS AHC EUR	92.42	165.93	165.93		15 335.91	
BNP INSTICASH-EUR-1D	920.39	101.24	101.24		93 178.83	
PICTET-EMERG LCL CCY	12.00	107.43	107.43		1 289.16	
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	98.19	98.19		2 061.99	
X EUR CORPORATE BOND	593.00	142.92	142.92		84 751.56	
VONTOBEL EUR CRP MDY	30.38	99.72	99.72		3 029.79	
BLACKROCK GIF I EMMK	81.00	91.82	91.82		7 437.42	
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	95.51	95.51		286.53	
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	107.76	107.76		1 508.64	
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	69.12	69.12		2 280.96	
AMUNDI PRI EURO COPR	4 798.00	17.64	17.64		84 653.51	
INVESCO S&P 500 ACC	31.00	835.76	788.90		24 455.88	
ISHARES JPM EM LCL G	497.00	4.52	4.26		2 119.55	
DPAM L-BONDS EMK SU	9.00	143.83	143.83		1 294.47	
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	101.66	101.66		1 423.24	
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	164.00	164.00		1 640.00	
AMUNDI MSCI EUROPE	980.00	80.22	80.22		78 610.70	
INVESCO EUR CORP BON	603.00	10.14	10.14		6 111.71	
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	53.21	50.22		64 685.71	
X FTSE EUROPE REAL	32.00	19.45	19.45		622.34	
Sub-total:					919 009.02	
5. Liquidez						
5.1. A Vista						
5.1.2. Depósitos à Ordem						
Depósitos a Ordem						72 895.92
Sub-total:						72 895.92
5.2. A Prazo						
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados						
Outros						-1 380.67
Sub-total:						-1 380.67
Sub-total:						71 515.25
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS						
7. Operações com produtos derivados						
7.1. Em Mercado Regulamentado						
7.1.1. Futuros						
FUT MINI EUR/USD CME	1.00					
FUT MINI EUR/USD CME					-62 609.14	
FUT MINI EUR/USD CME	1.00	66 328.13	62 609.14		62 609.14	
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	1 500 920.65	

Unidades de Participação em circulação: 120 616.75
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 12.4437

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: CVI PPR
 Data: 2023-06-30

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 2% 01122025	2.00	959.99	959.99	3.17	1 923.15
NETHER 0.5% 15072026	20 000.00	0.93	0.93	95.89	18 668.89
BTPS 1.6% 01062026	12.00	941.48	941.48	15.21	11 312.97
DBR 0 08/15/31	399 200.00	0.01	0.01		3 302.58
FRTR 0 25/11/2020	16 000.00	0.79	0.79		12 632.96
FRTR 0.75 25022028	22 000.00	0.91	0.91	56.51	20 008.75
SPGB 0 31012027	28.00	889.96	889.96		24 918.88
BGB 0.9% 22062029	2 000 000.00	0.01	0.01	3.93	17 874.33
SPGB 1.45% 30042029	18.00	907.15	907.15	43.50	16 372.20
BGB 0 22102027	600 000.00	0.01	0.01		5 294.10
BTPS 0.85 15012027	8.00	906.37	906.37	31.18	7 282.14
IRISH 0.2% 18102030	494 400.00	0.01	0.01	6.91	4 109.69
BTPS 2.8% 01122028	13.00	956.16	956.16	28.84	12 458.92
BTPS 0.6% 01082031	13.00	776.55	776.55	32.10	10 127.25
FRTR 0 25022027	47 000.00	0.90	0.90		42 216.34
SPGB 0 31/01/2028	11.00	863.85	863.85		9 502.35
OBL 0 14/04/2027	1 600 000.00	0.01	0.01		14 457.60
BTPS 0 01082026	18.00	892.20	892.20		16 059.60
FRTR 0 25/11/2030	14 000.00	0.81	0.81		11 373.32
RAGB 0 0.5 24042027	12.00	910.66	910.66	11.64	10 939.56
OBL 1.3 15102027	1 100 000.00	0.01	0.01	143.00	10 552.52
BTPS 1.2 08/15/25	31.00	947.50	947.50	138.73	29 511.23
NETHER 0 15012026	13 000.00	0.93	0.93		12 038.65
NETHER 2.5 15072033	4 236.00	0.98	0.98	40.91	4 186.17
RFGB 0.5 15092028	23.00	883.84	883.84	90.74	20 419.06
RAGB 0.5 20022029	22.00	871.99	871.99	39.18	19 222.96
SPGB 0.8 30072029	27.00	866.36	866.36	198.25	23 589.97
DBR 2.1 15112029	1 100 000.00	0.01	0.01	160.12	10 919.33
BTPS 3.85 15122029	6.00	1 002.30	1 002.30	9.47	6 023.27
OBL 2.2 13042028	3 300 000.00	0.01	0.01	322.22	32 751.32
DBR 2.3 15022033	800 000.00	0.01	0.01	84.69	8 018.53
BTPS 4 30102031	16.00	1 008.28	1 008.28	106.67	16 239.15
SPGB 3.55% 10/31/33	15.00	1 008.82	1 008.82	23.34	15 155.64
FRTR 2.5% 09/24/26	22 000.00	0.98	0.98	420.41	22 026.17
Sub-total:					501 489.55
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	12.00	851.13	851.13		10 213.56
Sub-total:					511 703.11
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	102.40	102.40		31 744.00
ISHARES MSCI EUROPE	2 777.00	28.99	28.99		80 505.23
DBX MSCI EUROPE	1 020.00	78.85	78.85		80 427.00
LYXOR UCITS ETF S&P	623.00	45.55	41.92		26 115.29
VANGUARD S&P 500 UCI	168.00	84.07	77.37		12 998.51
ISHARES CORE S&P 500	31.00	462.85	425.96		13 204.81
DBX S&P 500 ACC	328.00	86.60	79.69		26 139.48
ISHARES EURO GB 3-5Y	370.00	156.78	156.78		58 008.60
BBVA CREDITO EUROPA	166.16	127.10	127.10		21 119.62
AMUNDI S&P500 UCITS	331.00	85.61	78.79		26 078.51
GAM LOCAL EMERG BD-E	19.00	125.09	125.09		2 376.71
JPMORGAN F-EM MAR LO	12.00	124.50	124.50		1 494.00
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	415.00	139.47	139.47		57 880.05
SCHRODER IE CORP BON	264.00	23.19	23.19		6 123.35
AXA WF-FRM EUROPE R	12.00	206.83	206.83		2 481.96

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: 2023-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
BNP INSTICASH-EUR-1D	920.39	100.31	100.31		92 327.01
AXA WORLD EUR CR SHD	117.00	97.87	97.87		11 450.79
PICTET-EMERG LCL CCY	13.00	108.77	108.77		1 414.01
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	98.57	98.57		2 069.97
X EUR CORPORATE BOND	593.00	142.89	142.89		84 730.81
VONTOBEL EUR CRP MDY	30.38	100.35	100.35		3 048.93
BLACKROCK GIF I EMMK	88.00	94.43	94.43		8 309.84
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	97.38	97.38		292.14
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	107.08	107.08		1 499.12
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	68.90	68.90		2 273.70
AMUNDI PRI EURO COPR	4 798.00	17.67	17.67		84 768.67
INVESCO S&P 500 ACC	33.00	857.52	789.18		26 042.85
DPAM L-BONDS EMK SU	11.00	145.22	145.22		1 597.42
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	101.73	101.73		1 424.22
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	165.08	165.08		1 650.80
AMUNDI MSCI EUROPE	1 012.00	81.90	81.90		82 877.74
INVESCO EUR CORP BON	603.00	10.17	10.17		6 135.28
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	52.76	48.56		62 539.00
X FTSE EUROPE REAL	32.00	18.69	18.69		597.95
Sub-total:					921 747.37
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depósitos a Ordem					
Sub-total:					
103 000.42					
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
Sub-total:					
-543.72					
Sub-total:					
-543.72					
Sub-total:					
102 456.70					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT Mini EUR/USD CME	1.00				
FUT Mini EUR/USD CME					-63 000.41
FUT Mini EUR/USD CME	1.00	68 456.25	63 000.41		63 000.41
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	1 535 907.18

Unidades de Participação em circulação: 122 401.17
 Valor Unitário de Unidades de Participação: 12.5481