

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: 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	48 000.00	0.95	0.95	170.49	45 808.41
BTPS 1.6% 01062026	30.00	967.30	967.30	158.69	29 177.69
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		7 301.99
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.82	0.82		31 874.70
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.93	0.93	38.12	49 312.22
SPGB 0 31012027	68.00	922.00	922.00		62 696.00
BGB 0.8% 22062028	4 900 000.00	0.01	0.01	303.10	45 785.64
SPBG 1.4% 30072028	58.00	943.45	943.45	543.55	55 263.65
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	347.95	46 217.95
RFGB 0.5% 15092029	23.00	892.42	892.42	62.21	20 587.87
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 838.45
BTPS 0.85 15012027	20.00	939.65	939.65	35.49	18 828.49
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	10.27	9 793.72
BTPS 2.8% 01122028	33.00	985.18	985.18	305.48	32 816.42
BTPS 0.6% 01082031	30.00	821.40	821.40	29.18	24 671.18
SPGB 0.5% 31102031	25.00	835.20	835.20	51.91	20 931.91
FRTR 0 25022027	59 000.00	0.92	0.92		54 532.52
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		35 254.12
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.84	0.84		26 074.10
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	934.51	934.51	141.80	28 177.10
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	155.57	25 179.79
RFGB 0.5 15092028	57.00	909.24	909.24	154.18	51 980.86
RAGB 0.5 20022029	53.00	901.90	901.90	29.04	47 829.74
SPGB 0.8 30072029	33.00	900.35	900.35	177.21	29 888.76
DBR 2.1 15112029	2 700 000.00	0.01	0.01	212.24	26 942.24
OBL 2.2 13042028	8 000 000.00	0.01	0.01	2 107.18	81 551.18
BTPS 4 30102031	48.00	1 040.70	1 040.70	802.62	50 756.22
BTPS 2.8 15062029	46.00	980.29	980.29	376.55	45 469.89
NETHER 2.5% 15012030	25 000.00	1.00	1.00	129.78	25 117.28
FRTR 2.75 25022029	24 000.00	1.00	1.00	63.11	24 166.31
SPGB 3.5% 31052029	25.00	1 031.40	1 031.40	413.59	26 198.59
FRTR 2.5% 25052030	32 000.00	0.99	0.99	679.78	32 447.78
RFGB 0 15092026	29.00	932.87	932.87		27 053.23
FRTR 5.5% 25042029	16 000.00	1.13	1.13	819.89	18 928.21
BTPS 4 15112023	46.00	1 037.76	1 037.76	690.00	48 426.96
EU 3% 04122034	28 000.00	1.01	1.01	75.74	28 303.38
Sub-total:					1 247 184.55
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	30.00	884.36	884.36		26 530.80
MADRID 3.462 300434	26.00	1 011.55	1 011.55	76.45	26 376.75
Sub-total:					52 907.55
Sub-total:					1 300 092.10
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15012030	517.00	108.57	100.43	14.95	51 935.05
TII 0.125 15072030	518.00	108.45	100.32	14.97	51 978.24
TII 0.125 15012031	532.00	105.48	97.57	15.15	51 922.15
Sub-total:					155 835.44
Sub-total:					1 455 927.54
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	105.28	105.28		74 117.12
ISHARES MSCI EUROPE	6 092.00	32.01	32.01		194 974.46
DBX MSCI EUROPE	2 201.00	88.57	88.57		194 942.57
AXA WORLD EUR CR SHR	195.60	138.78	138.78		27 145.37
LYXOR UCITS ETF S&P	1 294.00	53.89	49.85		64 502.51

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: 2024-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
VANGUARD S&P 500 UCI	350.00	99.47	92.01		32 202.04
ISHARES CORE S&P 500	63.00	552.00	510.59		32 167.24
DBX S&P 500 ACC	673.00	103.45	95.69		64 399.08
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	160.72	160.72		131 147.52
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	132.66	132.66		49 335.67
AMUNDI S&P500 UCITS	681.00	102.28	94.61		64 426.22
JPMORGAN F-EM MAR LO	27.00	128.45	128.45		3 468.15
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	144.36	144.36		131 945.04
SCHRODER IE CORP BON	1 409.00	25.24	25.24		35 566.40
UBAM GHYS AHC EUR	327.00	182.02	182.02		59 520.54
PICTET-EMERG LCL CCY	29.00	111.25	111.25		3 226.25
GS EMRG MKT CORP BD	52.00	105.62	105.62		5 492.24
X EUR CORPORATE BOND	1 634.00	151.52	151.52		247 583.68
VONTOBEL EUR CRP MDY	163.96	107.90	107.90		17 691.39
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	101.30	101.30		19 956.10
JPM EMERG MKTS CORP	8.00	102.78	102.78		822.24
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	113.42	113.42		4 423.38
PICTE-S/T EM CRP BD	81.00	72.26	72.26		5 853.06
AMUNDI PRI EURO COPR	13 232.00	18.37	18.37		243 032.14
INVESCO S&P 500 ACC	68.00	1 025.24	948.33		64 486.47
DPAM L-BONDS EMK SU	23.00	153.42	153.42		3 528.66
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	106.80	106.80		4 058.40
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	180.54	180.54		4 152.42
AMUNDI MSCI EUROPE	2 188.00	91.71	91.71		200 652.73
INVESCO EUR CORP BON	3 241.00	10.85	10.85		35 170.36
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	55.27	51.12		150 713.13
ISHARES USD TRS 1-3Y	31 383.00	4.82	4.82		151 375.90
Sub-total:					2 322 078.47
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					176 472.17
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-7 708.29
Sub-total:					168 763.88
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
STOXX EUROPE600 0624	5.00				
FUT EUR/USD CME 0624	2.00				
STOXX EUROPE600 0624					-127 700.00
FUT EUR/USD CME 0624					-250 242.81
STOXX EUROPE600 0624	5.00	25 540.00	25 540.00		127 700.00
FUT EUR/USD CME 0624	2.00	135 268.75	125 121.40		250 242.81
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 946 769.89
Unidades de Participação em circulação:				586 721.35	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.7268	

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: 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	48 000.00	0.96	0.96	110.82	46 070.82
BTPS 1.6% 01062026	30.00	972.84	972.84	39.34	29 224.54
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		7 429.61
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.83	0.83		32 393.01
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.94	0.94	336.51	50 272.05
SPGB 0 31012027	68.00	925.40	925.40		62 927.20
BGB 0.8% 22062028	4 900 000.00	0.01	0.01	205.64	46 277.40
SPBG 1.4% 30072028	58.00	951.12	951.12	341.66	55 506.62
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	236.07	46 728.57
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 958.18
BTPS 0.85 15012027	20.00	944.46	944.46	78.07	18 967.27
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	4.61	9 915.54
BTPS 2.8% 01122028	33.00	992.66	992.66	75.74	32 833.52
BTPS 0.6% 01082031	30.00	817.57	817.57	74.35	24 601.45
SPGB 0.5% 31102031	25.00	841.46	841.46	20.83	21 057.33
FRTR 0 25022027	113 000.00	0.93	0.93		105 347.64
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		35 583.58
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.86	0.86		26 510.58
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	942.89	942.89	104.51	28 391.21
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	71.30	25 451.20
RFGB 0.5 15092028	57.00	919.28	919.28	83.32	52 482.28
RAGB 0.5 20022029	53.00	911.95	911.95	227.97	48 561.32
SPGB 0.8 30072029	33.00	906.79	906.79	111.39	30 035.46
DBR 2.1 15112029	2 700 000.00	0.01	0.01	71.26	27 339.37
BTPS 3.85 15122029	16.00	1 036.85	1 036.85	26.93	16 616.53
OBL 2.2 13042028	8 000 000.00	0.01	0.01	1 668.38	82 421.98
BTPS 4 30102031	48.00	1 042.35	1 042.35	325.25	50 358.05
BTPS 2.8 15062029	46.00	986.15	986.15	56.31	45 419.21
NETHER 2.5% 15012030	25 000.00	1.02	1.02	460.62	25 928.87
FRTR 2.75 25022029	24 000.00	1.02	1.02	558.74	25 129.46
SPGB 3.5% 31052029	71.00	1 044.53	1 044.53	556.75	74 718.38
BKP 3.1 12/12/2025	2 000 000.00	0.01	0.01	124.00	20 381.80
FRTR 2.5% 25052030	32 000.00	1.01	1.01	480.87	32 895.27
RFGB 0 15092026	29.00	937.50	937.50		27 187.50
Sub-total:					1 276 922.80
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	30.00	890.60	890.60		26 718.00
Sub-total:					1 303 640.80
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15012030	517.00	108.51	98.20	32.13	50 799.56
TII 0.125 15072030	518.00	108.55	98.23	32.30	50 916.68
TII 0.125 15012031	532.00	105.65	95.61	32.96	50 895.73
Sub-total:					152 611.97
Sub-total:					1 456 252.77
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	106.23	106.23		74 785.92
ISHARES MSCI EUROPE	6 386.00	29.73	29.73		189 823.85
DBX MSCI EUROPE	2 315.00	82.35	82.35		190 640.25
AXA WORLD EUR CR SHR	195.60	138.05	138.05		27 002.58
LYXOR UCITS ETF S&P	1 402.00	48.93	44.28		62 081.32
VANGUARD S&P 500 UCI	375.00	90.74	82.12		30 794.12
ISHARES CORE S&P 500	68.00	498.75	451.36		30 692.31
DBX S&P 500 ACC	738.00	93.99	85.06		62 773.41
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	161.98	161.98		132 175.68

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: 2023-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	131.95	131.95		49 070.98
AMUNDI S&P500 UCITS	746.00	92.36	83.58		62 353.45
JPMORGAN F-EM MAR LO	27.00	128.90	128.90		3 480.30
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	145.42	145.42		132 913.88
SCHRODER IE CORP BON	1 409.00	24.85	24.85		35 012.38
PICTET-EMERG LCL CCY	29.00	112.26	112.26		3 255.54
GS EMRG MKT CORP BD	52.00	103.66	103.66		5 390.32
X EUR CORPORATE BOND	1 634.00	151.13	151.13		246 946.42
VONTOBEL EUR CRP MDY	163.96	107.24	107.24		17 583.18
BLACKROCK GIF I EMMK	390.00	99.74	99.74		38 898.60
JPM EMERG MKTS CORP	8.00	101.03	101.03		808.24
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	111.16	111.16		4 335.24
PICTE-S/T EM CRP BD	81.00	70.90	70.90		5 742.90
AMUNDI PRI EURO COPR	13 232.00	18.32	18.32		242 416.86
INVESCO S&P 500 ACC	74.00	931.37	842.87		62 372.29
ISHARES JPM EM LCL G	1 216.00	4.90	4.43		5 387.27
DPAM L-BONDS EMK SU	23.00	151.01	151.01		3 473.23
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	104.95	104.95		3 988.10
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	169.75	169.75		3 904.25
AMUNDI MSCI EUROPE	2 296.00	85.12	85.12		195 435.52
INVESCO EUR CORP BON	3 241.00	10.79	10.79		34 983.35
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	54.76	49.56		146 092.74
ISHARES USD TRS 1-3Y	31 383.00	4.82	4.82		151 407.28
Sub-total:					2 256 021.75
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					184 183.90
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-10 611.09
Sub-total:					173 572.81
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0324	2.00				
FUT EUR/USD CME 0324					-250 565.61
FUT EUR/USD CME 0324	2.00	138 437.50	125 282.81		250 565.61
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 885 847.32
Unidades de Participação em circulação:				587 842.46	
Valor Unitário de Unidades de Participação:				6.6104	

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 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	48 000.00	0.93	0.93	50.49	44 762.49
BTPS 1.6% 01062026	30.00	941.56	941.56	158.69	28 405.49
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		6 932.71
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.77	0.77		29 987.10
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.90	0.90	236.32	48 065.11
SPGB 0 31012027	68.00	891.46	891.46		60 619.28
SPBG 1.4% 30072028	59.00	907.78	907.78	139.92	53 698.94
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	122.95	44 266.45
SPGB 1.45% 30042029	44.00	895.38	895.38	266.70	39 663.42
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 460.80
BTPS 0.85 15012027	20.00	904.77	904.77	35.42	18 130.82
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	21.66	9 278.91
BTPS 2.8% 01122028	33.00	937.15	937.15	305.48	31 231.43
BTPS 0.6% 01082031	30.00	745.83	745.83	29.35	22 404.25
FRTR 0 25022027	113 000.00	0.90	0.90		101 598.30
SPGB 0 31/01/2028	67.00	861.65	861.65		57 730.55
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		34 399.12
BTPS 0 01082026	42.00	895.11	895.11		37 594.62
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.80	0.80		24 710.72
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	910.52	910.52	66.80	27 382.40
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	423.19	24 945.35
NETHER 2.5 15072033	12 706.00	0.95	0.95	67.34	12 134.87
RFGB 0.5 15092028	57.00	876.55	876.55	11.68	49 975.03
RAGB 0.5 20022029	54.00	865.96	865.96	164.22	46 926.06
SPGB 0.8 30072029	66.00	855.55	855.55	89.69	56 555.99
DBR 2.1 15112029	2 700 000.00	0.01	0.01	535.93	26 538.28
BTPS 3.85 15122029	16.00	973.50	973.50	180.09	15 756.09
OBL 2.2 13042028	8 000 000.00	0.01	0.01	1 224.77	79 227.17
DBR 2.3 15022033	2 100 000.00	0.01	0.01	344.05	20 460.37
BTPS 4 30102031	48.00	966.67	966.67	802.62	47 202.78
SPGB 3.55% 10/31/33	24.00	967.92	967.92	252.10	23 482.18
SGLT 0 12/08/2023	100.00	993.05	993.05		99 305.00
BTPS 2.8 15062029	46.00	926.10	926.10	376.55	42 977.15
NETHER 2.5% 15012030	25 000.00	0.97	0.97	303.08	24 484.33
FRTR 2.75 25022029	24 000.00	0.98	0.98	392.38	23 871.58
Sub-total:					1 326 165.14
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	30.00	844.20	844.20		25 326.00
Sub-total:					1 351 491.14
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	102.31	102.31		72 026.24
ISHARES MSCI EUROPE	6 690.00	28.09	28.09		187 888.65
DBX MSCI EUROPE	2 431.00	77.33	77.33		187 989.23
AXA WORLD EUR CR SHR	195.60	134.39	134.39		26 286.68
LYXOR UCITS ETF S&P	1 458.00	44.41	41.92		61 112.41
VANGUARD S&P 500 UCI	396.00	81.68	77.10		30 531.70
ISHARES CORE S&P 500	73.00	450.20	424.96		31 021.90
DBX S&P 500 ACC	767.00	84.37	79.64		61 083.43
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	156.60	156.60		127 785.60
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	128.33	128.33		47 724.33
AMUNDI S&P500 UCITS	776.00	83.40	78.72		61 086.01
JPMORGAN F-EM MAR LO	27.00	123.05	123.05		3 322.35
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	139.18	139.18		127 210.52
SCHRODER IE CORP BON	643.00	23.33	23.33		15 001.77

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

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
AXA WF-FRM EUROPE R	28.00	211.59	211.59		5 924.52
UBAM GHYS AHC EUR	225.32	165.93	165.93		37 388.01
BNP INSTICASH-EUR-1D	710.28	101.24	101.24		71 908.23
PICTET-EMERG LCL CCY	29.00	107.43	107.43		3 115.47
GS EMRG MKT CORP BD	52.00	98.19	98.19		5 105.88
X EUR CORPORATE BOND	1 443.00	142.92	142.92		206 233.56
VONTOBEL EUR CRP MDY	73.96	99.72	99.72		7 375.39
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	91.82	91.82		18 088.54
JPM EMERG MKTS CORP	8.00	95.51	95.51		764.08
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	107.76	107.76		4 202.64
PICTE-S/T EM CRP BD	81.00	69.12	69.12		5 598.72
AMUNDI PRI EURO COPR	11 673.00	17.64	17.64		205 952.58
INVESCO S&P 500 ACC	77.00	835.76	788.90		60 745.25
ISHARES JPM EM LCL G	1 216.00	4.52	4.26		5 185.85
DPAM L-BONDS EMK SU	23.00	143.83	143.83		3 308.09
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	101.66	101.66		3 863.08
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	164.00	164.00		3 772.00
AMUNDI MSCI EUROPE	2 414.00	80.22	80.22		193 639.01
INVESCO EUR CORP BON	1 466.00	10.14	10.14		14 858.64
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	53.21	50.22		148 053.94
X FTSE EUROPE REAL	79.00	19.45	19.45		1 536.39
Sub-total:					2 046 690.69
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					
Sub-total:					
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
Sub-total:					
Sub-total:					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 1223	1.00				
EURO-BUND FUT DEZ23	-1.00				
FUT EUR/USD CME 1223					-125 218.28
EURO-BUND FUT DEZ23					128 640.00
FUT EUR/USD CME 1223	1.00	132 656.25	125 218.28		125 218.28
EURO-BUND FUT DEZ23	-1.00	128 640.00	128 640.00		-128 640.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 695 192.48
Unidades de Participação em circulação:			582 288.06		
Valor Unitário de Unidades de Participação:			6.3460		

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
 Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
 Fundo: F.PENSOES BBVA PME
 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	5.00	959.99	959.99	7.92	4 807.87
NETHER 0.5% 15072026	48 000.00	0.93	0.93	230.14	44 805.34
BTPS 1.6% 01062026	30.00	941.48	941.48	38.03	28 282.43
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		7 099.89
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.79	0.79		30 792.84
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.91	0.91	136.13	48 202.89
SPGB 0 31012027	68.00	889.96	889.96		60 517.28
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	9.84	44 685.84
SPGB 1.45% 30042029	44.00	907.15	907.15	106.33	40 020.93
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 470.55
BTPS 0.85 15012027	20.00	906.37	906.37	77.96	18 205.36
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	15.92	9 469.57
BTPS 2.8% 01122028	33.00	956.16	956.16	73.21	31 626.49
BTPS 0.6% 01082031	30.00	776.55	776.55	74.09	23 370.59
FRTR 0 25022027	113 000.00	0.90	0.90		101 498.86
SPGB 0 31/01/2028	27.00	863.85	863.85		23 323.95
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		34 336.80
BTPS 0 01082026	42.00	892.20	892.20		37 472.40
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.81	0.81		25 183.78
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	910.66	910.66	29.10	27 348.90
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	338.00	24 942.32
BTPS 1.2 08/15/25	74.00	947.50	947.50	331.16	70 446.16
NETHER 0 15012026	31 000.00	0.93	0.93		28 707.55
NETHER 2.5 15072033	12 706.00	0.98	0.98	122.71	12 556.55
RFGB 0.5 15092028	57.00	883.84	883.84	224.88	50 603.76
RAGB 0.5 20022029	54.00	871.99	871.99	96.16	47 183.62
SPGB 0.8 30072029	66.00	866.36	866.36	484.60	57 664.36
DBR 2.1 15112029	2 700 000.00	0.01	0.01	393.02	26 801.99
BTPS 3.85 15122029	16.00	1 002.30	1 002.30	25.25	16 062.05
OBL 2.2 13042028	8 000 000.00	0.01	0.01	781.15	79 397.15
SGLT 0 11082023	120.00	996.38	996.38		119 565.60
DBR 2.3 15022033	2 100 000.00	0.01	0.01	222.31	21 048.64
BTPS 4 30102031	48.00	1 008.28	1 008.28	320.00	48 717.44
SPGB 3.55% 10/31/33	36.00	1 008.82	1 008.82	56.02	36 373.54
SGLT 0 12/08/2023	100.00	984.62	984.62		98 462.00
FRTR 2.5% 09/24/26	54 000.00	0.98	0.98	1 031.92	54 064.24
Sub-total:					1 445 119.53
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	30.00	851.13	851.13		25 533.90
Sub-total:					1 470 653.43
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	102.40	102.40		72 089.60
ISHARES MSCI EUROPE	6 752.00	28.99	28.99		195 740.48
DBX MSCI EUROPE	2 480.00	78.85	78.85		195 548.00
LYXOR UCITS ETF S&P	1 517.00	45.55	41.92		63 590.52
VANGUARD S&P 500 UCI	409.00	84.07	77.37		31 645.18
ISHARES CORE S&P 500	75.00	462.85	425.96		31 947.13
DBX S&P 500 ACC	798.00	86.60	79.69		63 595.44
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	156.78	156.78		127 932.48
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	127.10	127.10		47 267.72
AMUNDI S&P500 UCITS	807.00	85.61	78.79		63 581.14
GAM LOCAL EMERG BD-E	43.00	125.09	125.09		5 378.87
JPMORGAN F-EM MAR LO	28.00	124.50	124.50		3 486.00
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	139.47	139.47		127 475.58

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: 2023-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
SCHRODER IE CORP BON	643.00	23.19	23.19		14 914.06
AXA WF-FRM EUROPE R	28.00	206.83	206.83		5 791.24
BNP INSTICASH-EUR-1D	710.28	100.31	100.31		71 250.86
AXA WORLD EUR CR SHD	265.00	97.87	97.87		25 935.55
PICTET-EMERG LCL CCY	30.00	108.77	108.77		3 263.10
GS EMRG MKT CORP BD	52.00	98.57	98.57		5 125.64
X EUR CORPORATE BOND	1 443.00	142.89	142.89		206 183.06
VONTOBEL EUR CRP MDY	73.96	100.35	100.35		7 421.99
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	94.43	94.43		18 602.71
JPM EMERG MKTS CORP	8.00	97.38	97.38		779.04
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	107.08	107.08		4 176.12
PICTE-S/T EM CRP BD	81.00	68.90	68.90		5 580.90
AMUNDI PRI EURO COPR	11 673.00	17.67	17.67		206 232.73
INVESCO S&P 500 ACC	80.00	857.52	789.18		63 134.18
DPAM L-BONDS EMK SU	25.00	145.22	145.22		3 630.50
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	101.73	101.73		3 865.74
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	165.08	165.08		3 796.84
AMUNDI MSCI EUROPE	2 461.00	81.90	81.90		201 543.60
INVESCO EUR CORP BON	1 466.00	10.17	10.17		14 915.96
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	52.76	48.56		143 140.51
X FTSE EUROPE REAL	79.00	18.69	18.69		1 476.19
Sub-total:					2 040 038.66
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					
Sub-total:					
236 117.09					
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
Sub-total:					
-8 327.57					
Sub-total:					
-8 327.57					
Sub-total:					
227 789.52					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0923	1.00				
FUT EUR/USD CME 0923					-126 000.83
FUT EUR/USD CME 0923	1.00	136 912.50	126 000.83		126 000.83
				TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA	3 738 481.61
Unidades de Participação em circulação:		583 181.53			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		6.4105			