

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: 2024-12-31

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 | | | | | |
| DBR 0 08/15/31 | 858 200.00 | 0.01 | 0.01 | | 7 448.32 |
| FRTR 0 25/11/2031 | 39 000.00 | 0.82 | 0.82 | | 32 051.37 |
| FRTR 0.75 25022028 | 53 000.00 | 0.95 | 0.95 | 336.68 | 50 605.06 |
| SPBG 1.4% 30072028 | 58.00 | 965.30 | 965.30 | 342.60 | 56 330.00 |
| BGB 0.9% 22062029 | 5 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | 236.71 | 46 929.21 |
| RFGB 0.5% 15092029 | 23.00 | 913.95 | 913.95 | 33.71 | 21 054.56 |
| BGB 0 22102027 | 1 300 000.00 | 0.01 | 0.01 | | 12 201.80 |
| BTPS 0.85 15012027 | 20.00 | 970.77 | 970.77 | 78.07 | 19 493.47 |
| IRISH 0.2% 18102030 | 1 139 200.00 | 0.01 | 0.01 | 4.62 | 10 051.22 |
| BTPS 2.8% 01122028 | 33.00 | 1 007.09 | 1 007.09 | 75.95 | 33 309.92 |
| SPGB 0.5% 31102031 | 15.00 | 861.59 | 861.59 | 12.53 | 12 936.38 |
| FRTR 0 25022027 | 59 000.00 | 0.95 | 0.95 | | 56 160.92 |
| FRTR 0 25/11/2030 | 31 000.00 | 0.85 | 0.85 | | 26 359.61 |
| RAGB 0 0.5 24042027 | 12.00 | 961.50 | 961.50 | 41.92 | 11 579.92 |
| OBL 2.2 13042028 | 2 249 100.00 | 0.01 | 0.01 | 355.17 | 22 945.13 |
| BTPS 2.8 15062029 | 46.00 | 1 002.30 | 1 002.30 | 56.46 | 46 162.26 |
| FRTR 2.75 25022029 | 72 000.00 | 1.00 | 1.00 | 1 677.05 | 74 025.53 |
| FRTR 2.5% 25052030 | 32 000.00 | 0.99 | 0.99 | 482.19 | 32 115.47 |
| FRTR 5.5% 25042029 | 16 000.00 | 1.12 | 1.12 | 602.74 | 18 447.54 |
| BTPS 4 15112030 | 46.00 | 1 052.52 | 1 052.52 | 230.00 | 48 645.92 |
| EU 2.875 06122027 | 29 630.00 | 1.02 | 1.02 | 58.35 | 30 152.95 |
| BTPS 0.95 01062032 | 37.00 | 855.11 | 855.11 | 28.89 | 31 667.96 |
| SPGB 3.45 31102034 | 62.00 | 1 032.15 | 1 032.15 | 357.48 | 64 350.78 |
| FRTR 3 25112034 | 27 000.00 | 0.98 | 0.98 | 79.89 | 26 625.48 |
| SPGB 3.1% 30072031 | 43.00 | 1 021.15 | 1 021.15 | 562.42 | 44 471.87 |
| RFGB 2.5 15042030 | 39.00 | 1 000.15 | 1 000.15 | 336.58 | 39 342.43 |
| RAGB 2.5% 20102029 | 560.00 | 100.24 | 100.24 | 452.60 | 56 588.68 |
| BKO 2.7 17092026 | 6 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | 705.70 | 61 284.10 |
| BTPS 3.15% 15112031 | 60.00 | 998.95 | 998.95 | 238.19 | 60 175.19 |
| BTPS 3.35 01072029 | 44.00 | 1 022.89 | 1 022.89 | 732.99 | 45 740.15 |
| DBR 2.6 15082034 | 1 500 000.00 | 0.01 | 0.01 | 191.26 | 15 474.76 |
| BKO 2.16 12102026 | 4 900 000.00 | 0.01 | 0.01 | 197.18 | 49 106.04 |
| Sub-total: | | | | | 1 163 834.00 |
| 1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados | | | | | |
| KFW 0 09112028 | 30.00 | 912.83 | 912.83 | | 27 384.90 |
| MADRID 3.462 300434 | 26.00 | 1 023.33 | 1 023.33 | 752.60 | 27 359.18 |
| KFW 26042029 | 31.00 | 1 007.70 | 1 007.70 | 604.18 | 31 842.88 |
| Sub-total: | | | | | 86 586.96 |
| 1.2.3. Obrigações Diversas | | | | | |
| KFW 2.75 01102027 | 44.00 | 1 012.28 | 1 012.28 | 301.67 | 44 841.99 |
| Sub-total: | | | | | 1 295 262.95 |
| 1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE | | | | | |
| 1.3.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| TII 2.375 15102028 | 266.00 | 104.70 | 100.78 | 132.43 | 26 939.68 |
| TII 2.125 15042029 | 273.00 | 102.24 | 98.42 | 117.80 | 26 985.36 |
| TII 1.25 15042028 | 273.00 | 102.56 | 98.72 | 73.05 | 27 022.70 |
| Sub-total: | | | | | 80 947.74 |
| Sub-total: | | | | | 1 376 210.69 |
| 3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo | | | | | |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | |
| ISCHARES BARC EU CP | 704.00 | 108.03 | 108.03 | | 76 053.12 |
| ISHARES MSCI EUROPE | 6 435.00 | 31.49 | 31.49 | | 202 638.15 |
| DBX MSCI EUROPE | 2 269.00 | 88.99 | 88.99 | | 201 918.31 |
| AXA WORLD EUR CR SHR | 195.60 | 144.66 | 144.66 | | 28 295.50 |
| LYXOR UCITS ETF S&P | 1 189.00 | 60.67 | 58.40 | | 69 432.72 |
| VANGUARD S&P 500 UCI | 324.00 | 112.41 | 108.20 | | 35 057.90 |

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: 2024-12-31

Pág. 2 de 2

| Designação | Quantidade | Cotação | Cotação (EUR) | Montante Juros (EUR) | Montante Global (EUR) |
|--|------------|------------|---------------|----------------------|-----------------------|
| ISHARES CORE S&P 500 | 58.00 | 627.10 | 603.62 | | 35 009.91 |
| ISHARES EURO GB 3-5Y | 816.00 | 161.55 | 161.55 | | 131 824.80 |
| BBVA CREDITO EUROPA | 371.88 | 137.77 | 137.77 | | 51 235.46 |
| AMUNDI S&P500 UCITS | 481.00 | 116.39 | 112.03 | | 53 885.57 |
| JPMORGAN F-EM MAR LO | 54.64 | 132.41 | 132.41 | | 7 235.01 |
| LYXOR EUROMTS 3-5Y D | 914.00 | 148.56 | 148.56 | | 135 783.84 |
| SCHRODER IE CORP BON | 1 255.63 | 26.44 | 26.44 | | 33 200.99 |
| PICTET-EMERG LCL CCY | 62.73 | 115.72 | 115.72 | | 7 259.22 |
| GS EMRG MKT CORP BD | 52.00 | 109.53 | 109.53 | | 5 695.56 |
| X EUR CORPORATE BOND | 1 634.00 | 157.51 | 157.51 | | 257 363.17 |
| VONTOBEL EUR CRP MDY | 146.66 | 112.88 | 112.88 | | 16 554.64 |
| BLACKROCK GIF I EMMK | 382.81 | 104.69 | 104.69 | | 40 076.38 |
| JPM EMERG MKTS CORP | 8.00 | 106.87 | 106.87 | | 854.96 |
| MUZIN EMERG MKTS SHO | 39.00 | 117.54 | 117.54 | | 4 584.06 |
| PICTE-S/T EM CRP BD | 81.00 | 75.59 | 75.59 | | 6 122.79 |
| AMUNDI PRI EURO COPR | 13 232.00 | 18.71 | 18.71 | | 247 511.18 |
| INVESCO S&P 500 ACC | 63.00 | 1 169.46 | 1 125.67 | | 70 916.99 |
| DPAM L-BONDS EMK SU | 56.28 | 156.06 | 156.06 | | 8 783.53 |
| AXA WORLD EMMK SH DU | 38.00 | 111.91 | 111.91 | | 4 252.58 |
| GL EVO FDS FRT MRK-I | 21.05 | 192.10 | 192.10 | | 4 044.28 |
| AMUNDI MSCI EUROPE | 2 251.00 | 92.75 | 92.75 | | 208 780.25 |
| INVESCO EUR CORP BON | 2 924.71 | 11.29 | 11.29 | | 33 019.33 |
| VAND USDCP1-3 USD | 1 470.00 | 57.80 | 55.63 | | 81 777.51 |
| ISHARES USD TRS 1-3Y | 24 692.00 | 4.94 | 4.94 | | 122 046.38 |
| CAP GRP EM LOCAL DEB | 767.24 | 11.43 | 11.43 | | 8 769.52 |
| X S&P 500 SWAP 1D | 5 359.00 | 12.99 | 12.50 | | 66 996.53 |
| Sub-total: | | | | | 2 256 980.14 |
| 5. Liquidez | | | | | |
| 5.1. A Vista | | | | | |
| 5.1.2. Depósitos à Ordem | | | | | |
| Depositos a Ordem | | | | | 451 054.54 |
| 5.2. A Prazo | | | | | |
| 5.2.1. Depósitos e Outros Equipados | | | | | |
| Outros | | | | | -10 697.48 |
| Sub-total: | | | | | 440 357.06 |
| PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS | | | | | |
| 7. Operações com produtos derivados | | | | | |
| 7.1. Em Mercado Regulamentado | | | | | |
| 7.1.1. Futuros | | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0325 | 1.00 | | | | |
| STOXX EUROPE600 0325 | 5.00 | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0325 | | | | | -124 993.98 |
| STOXX EUROPE600 0325 | | | | | -126 375.00 |
| FUT EUR/USD CME 0325 | 1.00 | 129 856.25 | 124 993.98 | | 124 993.98 |
| STOXX EUROPE600 0325 | 5.00 | 25 275.00 | 25 275.00 | | 126 375.00 |
| Sub-total: | | | | | 0.00 |
| TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA | | | | | 4 073 547.88 |
| Unidades de Participação em circulação: | | | | 592 359.81 | |
| Valor Unitário de Unidades de Participação: | | | | 6.8768 | |

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: 2024-09-30

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.UE | | | | | |
| 1.2.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| DBR 0 08/15/31 | 858 200.00 | 0.01 | 0.01 | | 7 520.24 |
| FRTR 0 25/11/2031 | 39 000.00 | 0.83 | 0.83 | | 32 362.59 |
| FRTR 0.75 25022028 | 53 000.00 | 0.95 | 0.95 | 237.41 | 50 491.48 |
| SPBG 1.4% 30072028 | 58.00 | 965.55 | 965.55 | 137.93 | 56 139.83 |
| BGB 0.9% 22062029 | 5 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | 123.29 | 47 021.79 |
| RFGB 0.5% 15092029 | 23.00 | 916.13 | 916.13 | 4.73 | 21 075.72 |
| BGB 0 22102027 | 1 300 000.00 | 0.01 | 0.01 | | 12 161.24 |
| BTPS 0.85 15012027 | 20.00 | 965.80 | 965.80 | 35.42 | 19 351.42 |
| IRISH 0.2% 18102030 | 1 139 200.00 | 0.01 | 0.01 | 21.66 | 10 107.57 |
| BTPS 2.8% 01122028 | 33.00 | 1 008.50 | 1 008.50 | 306.31 | 33 586.81 |
| BTPS 0.6% 01082031 | 30.00 | 853.60 | 853.60 | 29.35 | 25 637.35 |
| SPGB 0.5% 31102031 | 15.00 | 864.85 | 864.85 | 68.65 | 13 041.40 |
| FRTR 0 25022027 | 59 000.00 | 0.95 | 0.95 | | 55 858.84 |
| FRTR 0 25/11/2030 | 31 000.00 | 0.86 | 0.86 | | 26 534.76 |
| RAGB 0 0.5 24042027 | 12.00 | 959.60 | 959.60 | 26.79 | 11 541.99 |
| OBL 2.2 13042028 | 2 249 100.00 | 0.01 | 0.01 | 230.46 | 22 934.22 |
| BTPS 4 30102031 | 48.00 | 1 064.70 | 1 064.70 | 804.82 | 51 910.42 |
| BTPS 2.8 15062029 | 46.00 | 1 003.93 | 1 003.93 | 377.58 | 46 558.36 |
| FRTR 2.75 25022029 | 72 000.00 | 1.01 | 1.01 | 1 179.34 | 74 036.86 |
| FRTR 2.5% 25052030 | 32 000.00 | 1.00 | 1.00 | 280.55 | 32 242.15 |
| FRTR 5.5% 25042029 | 16 000.00 | 1.13 | 1.13 | 380.93 | 18 435.49 |
| BTPS 4 15112030 | 46.00 | 1 058.46 | 1 058.46 | 690.00 | 49 379.16 |
| EU 2.875 06122027 | 29 630.00 | 1.02 | 1.02 | 357.08 | 30 457.90 |
| EU 0 04072029 | 46.00 | 896.54 | 896.54 | | 41 240.84 |
| BTPS 0.95 01062032 | 37.00 | 856.20 | 856.20 | 116.52 | 31 795.92 |
| SPGB 3.45 31102034 | 51.00 | 1 044.30 | 1 044.30 | 564.00 | 53 823.30 |
| FRTR 3 25112034 | 27 000.00 | 1.01 | 1.01 | 686.07 | 27 855.36 |
| SPGB 3.1% 30072031 | 43.00 | 1 029.66 | 1 029.66 | 226.43 | 44 501.81 |
| RFGB 2.5 15042030 | 39.00 | 1 008.29 | 1 008.29 | 90.82 | 39 414.13 |
| RAGB 2.5% 20102029 | 560.00 | 100.84 | 100.84 | 99.73 | 56 569.57 |
| BKO 2.7 17092026 | 15 300 000.00 | 0.01 | 0.01 | 758.29 | 155 560.78 |
| EU 3% 04122034 | 28 000.00 | 1.02 | 1.02 | 495.74 | 29 037.54 |
| Sub-total: | | | | | 1 228 186.84 |
| 1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados | | | | | |
| KFW 0 09112028 | 30.00 | 910.48 | 910.48 | | 27 314.40 |
| MADRID 3.462 300434 | 26.00 | 1 035.20 | 1 035.20 | 527.74 | 27 442.94 |
| KFW 26042029 | 31.00 | 1 012.65 | 1 012.65 | 399.07 | 31 791.22 |
| Sub-total: | | | | | 86 548.56 |
| 1.2.3. Obrigações Diversas | | | | | |
| KFW 2.75 01102027 | 44.00 | 1 013.70 | 1 013.70 | 291.73 | 44 894.53 |
| Sub-total: | | | | | 1 359 629.93 |
| 1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE | | | | | |
| 1.3.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| TII 0.125 15072030 | 383.00 | 114.12 | 101.93 | 10.77 | 39 050.07 |
| TII 0.125 15012031 | 393.00 | 111.08 | 99.21 | 10.98 | 39 001.61 |
| TII 0.125 15072031 | 408.00 | 107.41 | 95.94 | 11.24 | 39 152.84 |
| Sub-total: | | | | | 117 204.52 |
| Sub-total: | | | | | 1 476 834.45 |
| 3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo | | | | | |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | |
| ISCHARES BARC EU CP | 704.00 | 107.29 | 107.29 | | 75 532.16 |
| ISHARES MSCI EUROPE | 6 188.00 | 32.59 | 32.59 | | 201 635.98 |
| DBX MSCI EUROPE | 2 192.00 | 91.97 | 91.97 | | 201 598.24 |
| AXA WORLD EUR CR SHR | 195.60 | 143.24 | 143.24 | | 28 017.74 |
| LYXOR UCITS ETF S&P | 1 257.00 | 59.22 | 52.89 | | 66 482.01 |
| VANGUARD S&P 500 UCI | 342.00 | 108.69 | 97.07 | | 33 199.60 |

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: 2024-09-30

Pág. 2 de 2

| Designação | Quantidade | Cotação | Cotação (EUR) | Montante Juros (EUR) | Montante Global (EUR) |
|--|------------|------------|------------------|-------------------------|--------------------------|
| ISHARES CORE S&P 500 | 61.00 | 606.50 | 541.71 | | 33 044.39 |
| DBX S&P 500 ACC | 655.00 | 113.63 | 101.49 | | 66 477.00 |
| ISHARES EURO GB 3-5Y | 816.00 | 163.34 | 163.34 | | 133 285.44 |
| BBVA CREDITO EUROPA | 371.88 | 136.67 | 136.67 | | 50 824.53 |
| AMUNDI S&P500 UCITS | 662.00 | 112.31 | 100.31 | | 66 405.59 |
| JPMORGAN F-EM MAR LO | 27.00 | 133.29 | 133.29 | | 3 598.83 |
| LYXOR EUROMTS 3-5Y D | 914.00 | 148.42 | 148.42 | | 135 655.88 |
| ISHARES JPM USD EM B | 7 641.00 | 5.85 | 5.22 | | 39 904.37 |
| SCHRODER IE CORP BON | 1 255.63 | 26.16 | 26.16 | | 32 848.66 |
| PICTET-EMERG LCL CCY | 29.00 | 117.09 | 117.09 | | 3 395.61 |
| GS EMRG MKT CORP BD | 52.00 | 110.93 | 110.93 | | 5 768.36 |
| X EUR CORPORATE BOND | 1 634.00 | 156.40 | 156.40 | | 255 557.60 |
| VONTOBEL EUR CRP MDY | 146.66 | 112.02 | 112.02 | | 16 428.52 |
| BLACKROCK GIF I EMMK | 390.24 | 106.87 | 106.87 | | 41 704.95 |
| JPM EMERG MKTS CORP | 8.00 | 108.16 | 108.16 | | 865.28 |
| MUZIN EMERG MKTS SHO | 39.00 | 117.53 | 117.53 | | 4 583.67 |
| PICTE-S/T EM CRP BD | 81.00 | 75.39 | 75.39 | | 6 106.59 |
| AMUNDI PRI EURO COPR | 13 232.00 | 18.96 | 18.96 | | 250 911.80 |
| INVESCO S&P 500 ACC | 66.00 | 1 127.16 | 1 006.75 | | 66 445.66 |
| DPAM L-BONDS EMK SU | 23.00 | 156.48 | 156.48 | | 3 599.04 |
| AXA WORLD EMMK SH DU | 38.00 | 111.24 | 111.24 | | 4 227.12 |
| GL EVO FDS FRT MRK-I | 23.00 | 186.27 | 186.27 | | 4 284.21 |
| AMUNDI MSCI EUROPE | 2 175.00 | 95.53 | 95.53 | | 207 782.10 |
| INVESCO EUR CORP BON | 2 924.71 | 11.19 | 11.19 | | 32 737.10 |
| VAND USDCP1-3 USD | 2 948.00 | 57.66 | 51.50 | | 151 823.58 |
| ISHARES USD TRS 1-3Y | 31 383.00 | 4.97 | 4.97 | | 155 910.74 |
| Sub-total: | | | | | 2 380 642.34 |
| 5. Liquidez | | | | | |
| 5.1. A Vista | | | | | |
| 5.1.2. Depósitos à Ordem | | | | | |
| Depositos a Ordem | | | | | 159 818.04 |
| 5.2. A Prazo | | | | | |
| 5.2.1. Depósitos e Outros Equipados | | | | | |
| Outros | | | | | 998.82 |
| Sub-total: | | | | | 160 816.86 |
| PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS | | | | | |
| 7. Operações com produtos derivados | | | | | |
| 7.1. Em Mercado Regulamentado | | | | | |
| 7.1.1. Futuros | | | | | |
| FUT EUR/USD CME 1224 | 2.00 | | | | |
| STOXX EUROPE600 1224 | 5.00 | | | | |
| FUT EUR/USD CME 1224 | | | | | -249 341.28 |
| STOXX EUROPE600 1224 | | | | | -131 475.00 |
| FUT EUR/USD CME 1224 | 2.00 | 139 581.25 | 124 670.64 | | 249 341.28 |
| STOXX EUROPE600 1224 | 5.00 | 26 295.00 | 26 295.00 | | 131 475.00 |
| Sub-total: | | | | | 0.00 |
| TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA | | | | | 4 018 293.65 |
| Unidades de Participação em circulação: | | | | 584 151.28 | |
| Valor Unitário de Unidades de Participação: | | | | 6.8789 | |

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: 2024-06-30

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.U.E | | | | | |
| 1.2.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| NETHER 0.5% 15072026 | | | | 230.16 | 230.16 |
| DBR 0 08/15/31 | 858 200.00 | 0.01 | 0.01 | | 7 256.60 |
| FRTR 0 25/11/2031 | 39 000.00 | 0.80 | 0.80 | | 31 136.43 |
| FRTR 0.75 25022028 | 53 000.00 | 0.92 | 0.92 | 137.22 | 49 028.55 |
| SPGB 0 31012027 | 68.00 | 924.29 | 924.29 | | 62 851.72 |
| BGB 0.8% 22062028 | 4 900 000.00 | 0.01 | 0.01 | 8.59 | 45 319.38 |
| SPBG 1.4% 30072028 | 58.00 | 938.83 | 938.83 | 745.44 | 55 197.58 |
| BGB 0.9% 22062029 | 5 000 000.00 | 0.01 | 0.01 | 9.86 | 45 585.86 |
| RFGB 0.5% 15092029 | 23.00 | 885.86 | 885.86 | 90.81 | 20 465.59 |
| BGB 0 22102027 | 1 300 000.00 | 0.01 | 0.01 | | 11 844.30 |
| BTPS 0.85 15012027 | 20.00 | 939.50 | 939.50 | 77.99 | 18 867.99 |
| IRISH 0.2% 18102030 | 1 139 200.00 | 0.01 | 0.01 | 15.94 | 9 704.27 |
| BTPS 2.8% 01122028 | 33.00 | 974.23 | 974.23 | 73.41 | 32 223.00 |
| BTPS 0.6% 01082031 | 30.00 | 807.53 | 807.53 | 74.18 | 24 300.08 |
| SPGB 0.5% 31102031 | 15.00 | 828.88 | 828.88 | 49.80 | 12 483.00 |
| FRTR 0 25022027 | 59 000.00 | 0.92 | 0.92 | | 54 451.10 |
| FRTR 0 25/11/2030 | 31 000.00 | 0.83 | 0.83 | | 25 575.87 |
| RAGB 0 0.5 24042027 | 30.00 | 934.10 | 934.10 | 29.18 | 28 052.18 |
| RFGB 0.5 15092028 | 57.00 | 906.04 | 906.04 | 225.04 | 51 869.32 |
| RAGB 0.5 20022029 | 53.00 | 897.40 | 897.40 | 95.11 | 47 657.31 |
| SPGB 0.8 30072029 | 33.00 | 895.10 | 895.10 | 243.02 | 29 781.32 |
| OBL 2.2 13042028 | 2 249 100.00 | 0.01 | 0.01 | 105.74 | 22 334.72 |
| BTPS 4 30102031 | 48.00 | 1 016.80 | 1 016.80 | 320.88 | 49 127.28 |
| BTPS 2.8 15062029 | 46.00 | 967.39 | 967.39 | 52.93 | 44 552.87 |
| NETHER 2.5% 15012030 | | | | 285.18 | 285.18 |
| FRTR 2.75 25022029 | 24 000.00 | 0.99 | 0.99 | 227.21 | 23 927.71 |
| SPGB 3.5% 31052029 | 25.00 | 1 020.08 | 1 020.08 | 71.92 | 25 573.92 |
| FRTR 2.5% 25052030 | 32 000.00 | 0.97 | 0.97 | 78.90 | 31 161.14 |
| RFGB 0 15092026 | 29.00 | 936.54 | 936.54 | | 27 159.66 |
| FRTR 5.5% 25042029 | 16 000.00 | 1.11 | 1.11 | 159.12 | 17 871.60 |
| BTPS 4 15112030 | 46.00 | 1 016.86 | 1 016.86 | 230.00 | 47 005.56 |
| EU 2.875 06122027 | 29 630.00 | 1.00 | 1.00 | 142.37 | 29 641.70 |
| EU 0 04072029 | 46.00 | 865.30 | 865.30 | | 39 803.80 |
| BTPS 0.95 01062032 | 37.00 | 807.56 | 807.56 | 27.93 | 29 907.65 |
| SPGB 3.45 31102034 | 11.00 | 1 002.90 | 1 002.90 | 25.99 | 11 057.89 |
| FRTR 3 25112034 | 27 000.00 | 0.97 | 0.97 | | 26 284.50 |
| EU 3% 04122034 | 28 000.00 | 0.99 | 0.99 | 284.59 | 27 880.27 |
| Sub-total: | | | | | 1 117 457.06 |
| 1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados | | | | | |
| KFW 0 09112028 | 30.00 | 882.58 | 882.58 | | 26 477.40 |
| MADRID 3.462 300434 | 26.00 | 994.42 | 994.42 | 300.86 | 26 155.78 |
| KFW 26042029 | 31.00 | 988.13 | 988.13 | 193.96 | 30 825.99 |
| Sub-total: | | | | | 83 459.17 |
| 1.2.3. Obrigações Diversas | | | | | |
| KFW 2.75 01102027 | 44.00 | 994.45 | 994.45 | | 43 755.80 |
| Sub-total: | | | | | 1 244 672.03 |
| 1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE | | | | | |
| 1.3.1. Títulos de Dívida Pública | | | | | |
| TII 0.125 15072030 | 383.00 | 109.60 | 102.38 | 24.57 | 39 235.31 |
| TII 0.125 15012031 | 393.00 | 106.52 | 99.51 | 24.83 | 39 131.03 |
| TII 0.125 15072031 | 408.00 | 102.96 | 96.18 | 25.57 | 39 265.53 |
| Sub-total: | | | | | 117 631.86 |
| Sub-total: | | | | | 1 362 303.89 |
| 3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo | | | | | |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | |
| ISCHARES BARC EU CP | 704.00 | 105.83 | 105.83 | | 74 504.32 |

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: 2024-06-30

Pág. 2 de 2

| Designação | Quantidade | Cotação | Cotação (EUR) | Montante Juros (EUR) | Montante Global (EUR) |
|--|------------|------------|---------------|----------------------|-----------------------|
| ISHARES MSCI EUROPE | 6 193.00 | 32.10 | 32.10 | | 198 795.30 |
| DBX MSCI EUROPE | 2 208.00 | 89.96 | 89.96 | | 198 631.68 |
| AXA WORLD EUR CR SHR | 195.60 | 139.91 | 139.91 | | 27 366.40 |
| LYXOR UCITS ETF S&P | 1 232.00 | 56.64 | 52.91 | | 65 179.19 |
| VANGUARD S&P 500 UCI | 342.00 | 104.28 | 97.41 | | 33 315.05 |
| ISHARES CORE S&P 500 | 60.00 | 579.90 | 541.71 | | 32 502.57 |
| DBX S&P 500 ACC | 642.00 | 108.73 | 101.57 | | 65 207.53 |
| ISHARES EURO GB 3-5Y | 816.00 | 158.31 | 158.31 | | 129 180.96 |
| BBVA CREDITO EUROPA | 371.88 | 133.69 | 133.69 | | 49 717.92 |
| AMUNDI S&P500 UCITS | 649.00 | 107.45 | 100.38 | | 65 144.08 |
| JPMORGAN F-EM MAR LO | 27.00 | 126.52 | 126.52 | | 3 416.04 |
| LYXOR EUROMTS 3-5Y D | 914.00 | 144.01 | 144.01 | | 131 625.14 |
| SCHRODER IE CORP BON | 1 255.63 | 25.38 | 25.38 | | 31 873.16 |
| PICTET-EMERG LCL CCY | 29.00 | 109.48 | 109.48 | | 3 174.92 |
| GS EMRG MKT CORP BD | 52.00 | 107.14 | 107.14 | | 5 571.28 |
| X EUR CORPORATE BOND | 1 634.00 | 151.54 | 151.54 | | 247 608.19 |
| VONTOBEL EUR CRP MDY | 146.66 | 108.21 | 108.21 | | 15 869.75 |
| BLACKROCK GIF I EMMK | 390.24 | 101.43 | 101.43 | | 39 582.04 |
| JPM EMERG MKTS CORP | 8.00 | 103.82 | 103.82 | | 830.56 |
| MUZIN EMERG MKTS SHO | 39.00 | 114.86 | 114.86 | | 4 479.54 |
| PICTE-S/T EM CRP BD | 81.00 | 73.16 | 73.16 | | 5 925.96 |
| AMUNDI PRI EURO COPR | 13 232.00 | 18.38 | 18.38 | | 243 138.00 |
| INVESCO S&P 500 ACC | 65.00 | 1 077.87 | 1 006.88 | | 65 447.50 |
| DPAM L-BONDS EMK SU | 23.00 | 151.28 | 151.28 | | 3 479.44 |
| AXA WORLD EMMK SH DU | 38.00 | 107.59 | 107.59 | | 4 088.42 |
| GL EVO FDS FRT MRK-I | 23.00 | 182.30 | 182.30 | | 4 192.90 |
| AMUNDI MSCI EUROPE | 2 197.00 | 93.04 | 93.04 | | 204 417.67 |
| INVESCO EUR CORP BON | 2 924.71 | 10.86 | 10.86 | | 31 750.31 |
| VAND USDCP1-3 USD | 2 948.00 | 55.95 | 52.27 | | 154 078.09 |
| ISHARES USD TRS 1-3Y | 31 383.00 | 4.85 | 4.85 | | 152 254.62 |
| Sub-total: | | | | | 2 292 348.53 |
| 5. Liquidez | | | | | |
| 5.1. A Vista | | | | | |
| 5.1.2. Depósitos à Ordem | | | | | |
| Depositos a Ordem | | | | | 317 373.76 |
| 5.2. A Prazo | | | | | |
| 5.2.1. Depósitos e Outros Equipados | | | | | |
| Outros | | | | | -27 418.29 |
| Sub-total: | | | | | 289 955.47 |
| PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS | | | | | |
| 7. Operações com produtos derivados | | | | | |
| 7.1. Em Mercado Regulamentado | | | | | |
| 7.1.1. Futuros | | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0924 | 2.00 | | | | |
| STOXX EUROPE600 0924 | 5.00 | | | | |
| FUT EUR/USD CME 0924 | | | | | -251 097.62 |
| STOXX EUROPE600 0924 | | | | | -128 550.00 |
| FUT EUR/USD CME 0924 | 2.00 | 134 400.00 | 125 548.81 | | 251 097.62 |
| STOXX EUROPE600 0924 | 5.00 | 25 710.00 | 25 710.00 | | 128 550.00 |
| TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA | | | | | 3 944 607.89 |

Unidades de Participação em circulação: 585 242.55
Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.7401

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 | |