

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2025-03-31

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		7 369.02
FRTR 0 25/11/2031	39 000.00	0.82	0.82		32 037.72
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.96	0.96	37.03	50 667.93
SPBG 1.4% 30072028	58.00	968.12	968.12	542.82	56 693.78
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	347.67	47 191.67
RFGB 0.5% 15092029	23.00	915.83	915.83	62.07	21 126.16
BTPS 0.85 15012027	20.00	977.55	977.55	35.42	19 586.42
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	10.24	9 980.63
BTPS 2.8% 01122028	33.00	1 008.60	1 008.60	303.78	33 587.58
SPGB 0.5% 31102031	15.00	857.14	857.14	31.03	12 888.13
FRTR 0 25022027	59 000.00	0.96	0.96		56 615.81
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.85	0.85		26 445.79
BTPS 3.85 15122029	40.00	1 044.52	1 044.52		41 780.80
OBL 2.2 13042028	2 249 100.00	0.01	0.01	477.18	23 021.03
BTPS 2.8 15062029	46.00	1 002.61	1 002.61	374.05	46 494.11
FRTR 2.75 25022029	72 000.00	1.01	1.01	184.44	72 653.16
FRTR 2.5% 25052030	32 000.00	0.99	0.99	679.45	32 279.45
FRTR 5.5% 25042029	16 000.00	1.11	1.11	819.73	18 591.73
BTPS 4 15112030	46.00	1 046.13	1 046.13	690.00	48 811.98
BTPS 0.95 01062032	37.00	848.84	848.84	115.56	31 522.64
SPGB 3.45 31102034	30.00	1 010.26	1 010.26	428.18	30 735.98
FRTR 3 25112034	27 000.00	0.97	0.97	279.62	26 411.03
SPGB 3.1% 30072031	43.00	1 011.50	1 011.50	891.10	44 385.60
RFGB 2.5 15042030	39.00	995.84	995.84	576.99	39 414.75
RAGB 2.5% 20102029	560.00	99.89	99.89	797.81	56 733.97
BKO 2.7 17092026	6 000 000.00	0.01	0.01	1 105.15	61 651.15
BTPS 3.15% 15112031	60.00	990.66	990.66	704.22	60 143.82
BTPS 3.35 01072029				362.39	362.39
DBR 2.6 15082034	1 500 000.00	0.01	0.01	287.42	15 162.92
BKO 2.16 12102026	800 000.00	0.01	0.01	74.80	8 067.20
EU 2.625 04/04/2028	42 529.00	1.01	1.01	211.04	43 047.95
SPGB 3.15 30042035	33.00	981.57	981.57	173.72	32 565.53
NETHER 2.5% 15072035	39 000.00	0.96	0.96	66.78	37 501.71
OBL 2.4 18042030	3 000 000.00	0.01	0.01	145.97	30 233.27
Sub-total:					1 175 762.81
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
Madrid 3.137 3004203	18.00	973.10	973.10	69.62	17 585.42
KFW 0 09112028	30.00	917.08	917.08		27 512.40
MADRID 3.462 300434	7.00	1 007.79	1 007.79	263.21	7 317.74
KFW 26042029	31.00	1 005.90	1 005.90	804.83	31 987.73
KFW 2.875 25052026	58.00	1 007.75	1 007.75	1 397.96	59 847.46
Sub-total:					144 250.75
1.2.3. Obrigações Diversas					
KFW 2.75 01102027	44.00	1 011.69	1 011.69	600.03	45 114.39
Sub-total:					1 365 127.95
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 2.375 15102028	266.00	108.12	99.97	275.90	26 868.97
TII 2.125 15042029	273.00	105.83	97.85	245.43	26 958.58
TII 1.25 15042028	273.00	105.98	98.00	152.18	26 905.02
Sub-total:					80 732.58
Sub-total:					1 445 860.53
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	107.19	107.19		75 461.76
ISHARES MSCI EUROPE	6 009.00	33.31	33.31		200 159.79

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2025-03-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DBX MSCI EUROPE	2 110.00	94.95	94.95		200 344.50
AXA WORLD EUR CR SHR	195.60	145.87	145.87		28 532.17
LYXOR UCITS ETF S&P	1 542.00	56.94	52.65		81 184.91
VANGUARD S&P 500 UCI	267.00	105.05	97.13		25 933.44
ISHARES CORE S&P 500	48.00	589.50	545.08		26 163.66
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	162.06	162.06		132 240.96
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	138.88	138.88		51 645.69
JPMORGAN F-EM MAR LO	54.64	131.95	131.95		7 209.88
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	149.32	149.32		136 478.48
SCHRODER IE CORP BON	1 255.63	26.50	26.50		33 270.05
PICTET-EMERG LCL CCY	62.73	115.29	115.29		7 232.24
GS EMRG MKT CORP BD	52.00	111.79	111.79		5 813.08
X EUR CORPORATE BOND	1 634.00	157.62	157.62		257 551.08
VONTOBEL EUR CRP MDY	146.66	112.96	112.96		16 566.37
BLACKROCK GIF I EMMK	382.81	106.20	106.20		40 654.42
JPM EMERG MKTS CORP	8.00	109.09	109.09		872.72
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	119.23	119.23		4 649.97
PICTE-S/T EM CRP BD	81.00	76.73	76.73		6 215.13
AMUNDI PRI EURO COPR	13 232.00	18.71	18.71		247 583.95
INVESCO S&P 500 ACC	80.00	1 097.83	1 015.10		81 207.95
DPAM L-BONDS EMK SU	56.28	156.84	156.84		8 827.43
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	113.28	113.28		4 304.64
GL EVO FDS FRT MRK-I	21.05	195.04	195.04		4 106.18
AMUNDI MSCI EUROPE	2 098.00	98.33	98.33		206 300.54
INVESCO EUR CORP BON	2 924.71	11.27	11.27		32 961.72
VAND USDCP1-3 USD	1 470.00	58.72	54.29		79 813.59
ISHARES USD TRS 1-3Y	24 692.00	5.00	5.00		123 460.00
CAP GRP EM LOCAL DEB	767.24	11.44	11.44		8 777.19
X S&P 500 SWAP 1D	7 217.00	12.16	11.25		81 158.72
SPDR S&P 500 UCITS	57.00	554.28	512.51		29 213.09
Sub-total:					2 245 895.31
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					382 920.21
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-4 506.02
Sub-total:					378 414.19
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT EUR/USD CME 0625	1.00				
STOXX EUROPE600 0625	5.00				
FUT EUR/USD CME 0625					-125 543.23
STOXX EUROPE600 0625					-132 250.00
FUT EUR/USD CME 0625	1.00	135 775.00	125 543.23		125 543.23
STOXX EUROPE600 0625	5.00	26 450.00	26 450.00		132 250.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					4 070 170.02

Unidades de Participação em circulação:	591 292.64
Valor Unitário de Unidades de Participação:	6.8835

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-12-31

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

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-12-31

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

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-09-30

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					
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

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-09-30

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

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-06-30

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					
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

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2024-06-30

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