

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: 2025-03-31

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					
DBR 0 08/15/31	299 200.00	0.01	0.01		2 569.11
FRTR 0 25/11/2031	14 000.00	0.82	0.82		11 500.72
FRTR 0.75 25022028	20 000.00	0.96	0.96	13.97	19 119.97
SPBG 1.4% 30072028	22.00	968.12	968.12	205.90	21 504.54
BGB 0.9% 22062029	1 800 000.00	0.01	0.01	125.16	16 989.00
RFGB 0.5% 15092029	8.00	915.83	915.83	21.59	7 348.23
BTPS 0.85 15012027	7.00	977.55	977.55	12.40	6 855.25
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	3.54	3 455.37
BTPS 2.8% 01122028	12.00	1 008.60	1 008.60	110.47	12 213.67
SPGB 0.5% 31102031	6.00	857.14	857.14	12.41	5 155.25
FRTR 0 25022027	21 000.00	0.96	0.96		20 151.39
FRTR 0 25/11/2030	11 000.00	0.85	0.85		9 383.99
BTPS 3.85 15122029	14.00	1 044.52	1 044.52		14 623.28
OBL 2.2 13042028	768 000.00	0.01	0.01	162.94	7 860.99
BTPS 2.8 15062029	17.00	1 002.61	1 002.61	138.24	17 182.61
FRTR 2.75 25022029	25 000.00	1.01	1.01	64.04	25 226.79
FRTR 2.5% 25052030	12 000.00	0.99	0.99	254.79	12 104.79
FRTR 5.5% 25042029	6 000.00	1.11	1.11	307.40	6 971.90
BTPS 4 15112030	16.00	1 046.13	1 046.13	240.00	16 978.08
BTPS 0.95 01062032	13.00	848.84	848.84	40.60	11 075.52
SPGB 3.45 31102034	10.00	1 010.26	1 010.26	142.73	10 245.33
FRTR 3 25112034	9 000.00	0.97	0.97	93.21	8 803.68
SPGB 3.1% 30072031	15.00	1 011.50	1 011.50	310.85	15 483.35
RFGB 2.5 15042030	13.00	995.84	995.84	192.33	13 138.25
RAGB 2.5% 20102029	190.00	99.89	99.89	270.68	19 249.02
BKO 2.7 17092026	2 100 000.00	0.01	0.01	386.80	21 577.90
BTPS 3.15% 15112031	21.00	990.66	990.66	246.48	21 050.34
BTPS 3.35 01072029				123.54	123.54
DBR 2.6 15082034	500 000.00	0.01	0.01	95.81	5 054.31
BKO 2.16 12102026	300 000.00	0.01	0.01	28.05	3 025.20
EU 2.625 04/04/2028	14 845.00	1.01	1.01	73.67	15 026.15
SPGB 3.15 30042035	12.00	981.57	981.57	63.17	11 842.01
NETHER 2.5% 15072035	14 000.00	0.96	0.96	23.97	13 462.15
OBL 2.4 18042030	1 000 000.00	0.01	0.01	48.66	10 077.76
Sub-total:					416 429.44
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
Madrid 3.137 3004203	6.00	973.10	973.10	23.21	5 861.81
KFW 0 09112028	11.00	917.08	917.08		10 087.88
MADRID 3.462 300434	3.00	1 007.79	1 007.79	112.80	3 136.17
KFW 26042029	11.00	1 005.90	1 005.90	285.59	11 350.49
KFW 2.875 25052026	20.00	1 007.75	1 007.75	482.05	20 637.05
Sub-total:					51 073.40
1.2.3. Obrigações Diversas					
KFW 2.75 01102027	15.00	1 011.69	1 011.69	204.55	15 379.90
Sub-total:					482 882.74
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 2.375 15102028	94.00	108.12	99.97	97.50	9 495.05
TII 2.125 15042029	96.00	105.83	97.85	86.30	9 479.94
TII 1.25 15042028	96.00	105.98	98.00	53.52	9 461.11
Sub-total:					28 436.10
Sub-total:					511 318.84
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	107.19	107.19		33 228.90
ISHARES MSCI EUROPE	2 069.00	33.31	33.31		68 918.39

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: 2025-03-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
DBX MSCI EUROPE	727.00	94.95	94.95		69 028.65
AXA WORLD EUR CR SHR	68.41	145.87	145.87		9 979.26
LYXOR UCITS ETF S&P	528.00	56.94	52.65		27 798.72
VANGUARD S&P 500 UCI	92.00	105.05	97.13		8 935.87
ISHARES CORE S&P 500	16.00	589.50	545.08		8 721.22
BBVA CREDITO EUROPA	131.55	138.88	138.88		18 268.44
JPMORGAN F-EM MAR LO	19.13	131.95	131.95		2 524.34
SCHRODER IE CORP BON	433.91	26.50	26.50		11 497.18
PICTET-EMERG LCL CCY	21.96	115.29	115.29		2 532.21
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	111.79	111.79		2 347.59
X EUR CORPORATE BOND	652.00	157.62	157.62		102 768.24
VONTOBEL EUR CRP MDY	50.68	112.96	112.96		5 724.81
BLACKROCK GIF I EMMK	134.52	106.20	106.20		14 286.02
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	109.09	109.09		327.27
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	119.23	119.23		1 669.22
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	76.73	76.73		2 532.09
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.71	18.71		98 756.66
INVESCO S&P 500 ACC	27.00	1 097.83	1 015.10		27 407.68
DPAM L-BONDS EMK SU	19.71	156.84	156.84		3 090.69
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	113.28	113.28		1 585.92
GL EVO FDS FRT MRK-I	7.37	195.04	195.04		1 437.83
AMUNDI MSCI EUROPE	722.00	98.33	98.33		70 995.70
INVESCO EUR CORP BON	1 010.68	11.27	11.27		11 390.50
VAND USDCP1-3 USD	517.00	58.72	54.29		28 070.49
ISHARES USD TRS 1-3Y	8 677.00	5.00	5.00		43 385.00
CAP GRP EM LOCAL DEB	268.63	11.44	11.44		3 073.14
X S&P 500 SWAP 1D	2 474.00	12.16	11.25		27 821.35
SPDR S&P 500 UCITS	20.00	554.28	512.51		10 250.21
Sub-total:					718 353.60
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					167 222.51
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					1 345.43
Sub-total:					
168 567.94					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FT MINI EUR/USD 0625	2.00				
STOXX EUROPE600 0625	2.00				
FT MINI EUR/USD 0625					-125 543.23
STOXX EUROPE600 0625					-52 900.00
FT MINI EUR/USD 0625	2.00	67 887.50	62 771.61		125 543.23
STOXX EUROPE600 0625	2.00	26 450.00	26 450.00		52 900.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 398 240.37
Unidades de Participação em circulação:		102 084.47			
Valor Unitário de Unidades de Participação:		13.6969			

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: 2024-12-31

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	299 200.00	0.01	0.01		2 596.76
FRTR 0 25/11/2031	14 000.00	0.82	0.82		11 505.62
FRTR 0.75 25022028	20 000.00	0.95	0.95	127.05	19 096.25
SPBG 1.4% 30072028	22.00	965.30	965.30	129.95	21 366.55
BGB 0.9% 22062029	1 800 000.00	0.01	0.01	85.22	16 894.52
RFGB 0.5% 15092029	8.00	913.95	913.95	11.73	7 323.33
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		4 693.00
BTPS 0.85 15012027	7.00	970.77	970.77	27.32	6 822.71
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	1.60	3 479.81
BTPS 2.8% 01122028	12.00	1 007.09	1 007.09	27.62	12 112.70
SPGB 0.5% 31102031	6.00	861.59	861.59	5.01	5 174.55
FRTR 0 25022027	21 000.00	0.95	0.95		19 989.48
FRTR 0 25/11/2030	11 000.00	0.85	0.85		9 353.41
RAGB 0 0.5 24042027	5.00	961.50	961.50	17.47	4 824.97
OBL 2.2 13042028	768 000.00	0.01	0.01	121.28	7 835.07
BTPS 2.8 15062029	17.00	1 002.30	1 002.30	20.87	17 059.97
FRTR 2.75 25022029	25 000.00	1.00	1.00	582.31	25 703.31
FRTR 2.5% 25052030	12 000.00	0.99	0.99	180.82	12 043.30
FRTR 5.5% 25042029	6 000.00	1.12	1.12	226.03	6 917.83
BTPS 4 15112030	16.00	1 052.52	1 052.52	80.00	16 920.32
EU 2.875 06122027	10 546.00	1.02	1.02	20.77	10 732.13
BTPS 0.95 01062032	13.00	855.11	855.11	10.15	11 126.58
SPGB 3.45 31102034	22.00	1 032.15	1 032.15	126.85	22 834.15
FRTR 3 25112034	9 000.00	0.98	0.98	26.63	8 875.16
SPGB 3.1% 30072031	15.00	1 021.15	1 021.15	196.19	15 513.44
RFGB 2.5 15042030	13.00	1 000.15	1 000.15	112.19	13 114.14
RAGB 2.5% 20102029	190.00	100.24	100.24	153.56	19 199.73
BKO 2.7 17092026	2 100 000.00	0.01	0.01	246.99	21 449.43
BTPS 3.15% 15112031	21.00	998.95	998.95	83.37	21 061.32
BTPS 3.35 01072029	15.00	1 022.89	1 022.89	249.88	15 593.23
DBR 2.6 15082034	500 000.00	0.01	0.01	63.75	5 158.25
BKO 2.16 12102026	1 700 000.00	0.01	0.01	68.41	17 036.79
Sub-total:					413 407.81
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	11.00	912.83	912.83		10 041.13
MADRID 3.462 300434	9.00	1 023.33	1 023.33	260.52	9 470.49
KFW 26042029	11.00	1 007.70	1 007.70	214.39	11 299.09
Sub-total:					30 810.71
1.2.3. Obrigações Diversas					
KFW 2.75 01102027	15.00	1 012.28	1 012.28	102.84	15 287.04
Sub-total:					459 505.56
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 2.375 15102028	94.00	104.70	100.78	46.80	9 520.04
TII 2.125 15042029	96.00	102.24	98.42	41.42	9 489.36
TII 1.25 15042028	96.00	102.56	98.72	25.69	9 502.49
Sub-total:					28 511.88
Sub-total:					488 017.44
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	108.03	108.03		33 489.30
ISHARES MSCI EUROPE	2 200.00	31.49	31.49		69 278.00
DBX MSCI EUROPE	776.00	88.99	88.99		69 056.24
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	144.66	144.66		12 498.62
LYXOR UCITS ETF S&P	411.00	60.67	58.40		24 000.71
VANGUARD S&P 500 UCI	112.00	112.41	108.20		12 118.78

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: 2024-12-31

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CORE S&P 500	20.00	627.10	603.62		12 072.38
BBVA CREDITO EUROPA	131.55	137.77	137.77		18 123.33
AMUNDI S&P500 UCITS	166.00	116.39	112.03		18 596.68
JPMORGAN F-EM MAR LO	19.13	132.41	132.41		2 533.14
SCHRODER IE CORP BON	433.91	26.44	26.44		11 473.32
PICTET-EMERG LCL CCY	21.96	115.72	115.72		2 541.65
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	109.53	109.53		2 300.13
X EUR CORPORATE BOND	652.00	157.51	157.51		102 693.26
VONTOBEL EUR CRP MDY	50.68	112.88	112.88		5 720.76
BLACKROCK GIF I EMMK	134.52	104.69	104.69		14 082.90
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	106.87	106.87		320.61
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	117.54	117.54		1 645.56
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	75.59	75.59		2 494.47
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.71	18.71		98 727.63
INVESCO S&P 500 ACC	22.00	1 169.46	1 125.67		24 764.66
DPAM L-BONDS EMK SU	19.71	156.06	156.06		3 075.32
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	111.91	111.91		1 566.74
GL EVO FDS FRT MRK-I	7.37	192.10	192.10		1 416.16
AMUNDI MSCI EUROPE	770.00	92.75	92.75		71 417.50
INVESCO EUR CORP BON	1 010.68	11.29	11.29		11 410.41
VAND USDCP1-3 USD	517.00	57.80	55.63		28 761.20
ISHARES USD TRS 1-3Y	8 677.00	4.94	4.94		42 888.24
CAP GRP EM LOCAL DEB	268.63	11.43	11.43		3 070.45
X S&P 500 SWAP 1D	1 849.00	12.99	12.50		23 115.61
Sub-total:					725 253.78
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					194 226.78
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-2 492.49
Sub-total:					191 734.29
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT MINI EUR/USD M25	2.00				
STOXX EUROPE600 0325	2.00				
FUT MINI EUR/USD M25					-124 993.98
STOXX EUROPE600 0325					-50 550.00
FUT MINI EUR/USD M25	2.00	64 928.13	62 496.99		124 993.98
STOXX EUROPE600 0325	2.00	25 275.00	25 275.00		50 550.00
Sub-total:					0.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 405 005.51

Unidades de Participação em circulação: 103 120.04
Valor Unitário de Unidades de Participação: 13.6250

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: 2024-09-30

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	299 200.00	0.01	0.01		2 621.83
FRTR 0 25/11/2031	14 000.00	0.83	0.83		11 617.34
FRTR 0.75 25022028	20 000.00	0.95	0.95	89.59	19 053.39
SPBG 1.4% 30072028	22.00	965.55	965.55	52.32	21 294.42
BGB 0.9% 22062029	1 800 000.00	0.01	0.01	44.38	16 927.84
RFGB 0.5% 15092029	8.00	916.13	916.13	1.64	7 330.68
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		4 677.40
BTPS 0.85 15012027	7.00	965.80	965.80	12.40	6 773.00
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	7.50	3 499.32
BTPS 2.8% 01122028	12.00	1 008.50	1 008.50	111.39	12 213.39
BTPS 0.6% 01082031	11.00	853.60	853.60	10.76	9 400.36
SPGB 0.5% 31102031	6.00	864.85	864.85	27.46	5 216.56
FRTR 0 25022027	21 000.00	0.95	0.95		19 881.96
FRTR 0 25/11/2030	11 000.00	0.86	0.86		9 415.56
RAGB 0 0.5 24042027	5.00	959.60	959.60	11.16	4 809.16
OBL 2.2 13042028	768 000.00	0.01	0.01	78.69	7 831.34
BTPS 4 30102031	16.00	1 064.70	1 064.70	268.27	17 303.47
BTPS 2.8 15062029	17.00	1 003.93	1 003.93	139.54	17 206.35
FRTR 2.75 25022029	25 000.00	1.01	1.01	409.49	25 707.24
FRTR 2.5% 25052030	12 000.00	1.00	1.00	105.21	12 090.81
FRTR 5.5% 25042029	6 000.00	1.13	1.13	142.85	6 913.31
BTPS 4 15112030	16.00	1 058.46	1 058.46	240.00	17 175.36
EU 2.875 06122027	10 546.00	1.02	1.02	127.09	10 840.67
EU 0 04072029	16.00	896.54	896.54		14 344.64
BTPS 0.95 01062032	13.00	856.20	856.20	40.94	11 171.54
SPGB 3.45 31102034	17.00	1 044.30	1 044.30	188.00	17 941.10
FRTR 3 25112034	9 000.00	1.01	1.01	228.69	9 285.12
SPGB 3.1% 30072031	15.00	1 029.66	1 029.66	78.99	15 523.89
RFGB 2.5 15042030	13.00	1 008.29	1 008.29	30.27	13 138.04
RAGB 2.5% 20102029	190.00	100.84	100.84	33.84	19 193.25
BKO 2.7 17092026	5 300 000.00	0.01	0.01	262.68	53 887.07
EU 3% 04122034	9 550.00	1.02	1.02	169.08	9 903.87
Sub-total:					434 189.28
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	11.00	910.48	910.48		10 015.28
MADRID 3.462 300434	9.00	1 035.20	1 035.20	182.68	9 499.48
KFW 26042029	11.00	1 012.65	1 012.65	141.61	11 280.76
Sub-total:					30 795.52
1.2.3. Obrigações Diversas					
KFW 2.75 01102027	15.00	1 013.70	1 013.70	99.45	15 304.95
Sub-total:					480 289.75
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15072030	132.00	114.12	101.93	3.71	13 458.51
TII 0.125 15012031	136.00	111.08	99.21	3.80	13 496.74
TII 0.125 15072031	141.00	107.41	95.94	3.88	13 530.76
Sub-total:					40 486.01
Sub-total:					520 775.76
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	107.29	107.29		33 259.90
ISHARES MSCI EUROPE	2 140.00	32.59	32.59		69 731.90
DBX MSCI EUROPE	758.00	91.97	91.97		69 713.26
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	143.24	143.24		12 375.94
LYXOR UCITS ETF S&P	434.00	59.22	52.89		22 954.01
VANGUARD S&P 500 UCI	118.00	108.69	97.07		11 454.83

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: 2024-09-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES CORE S&P 500	21.00	606.50	541.71		11 375.94
DBX S&P 500 ACC	226.00	113.63	101.49		22 937.10
BBVA CREDITO EUROPA	131.55	136.67	136.67		17 977.98
AMUNDI S&P500 UCITS	229.00	112.31	100.31		22 971.12
JPMORGAN F-EM MAR LO	11.00	133.29	133.29		1 466.19
ISHARES JPM USD EM B	2 640.00	5.85	5.22		13 787.14
SCHRODER IE CORP BON	433.91	26.16	26.16		11 351.56
PICTET-EMERG LCL CCY	12.00	117.09	117.09		1 405.08
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	110.93	110.93		2 329.53
X EUR CORPORATE BOND	652.00	156.40	156.40		101 972.80
VONTOBEL EUR CRP MDY	50.68	112.02	112.02		5 677.17
BLACKROCK GIF I EMMK	134.94	106.87	106.87		14 421.04
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	108.16	108.16		324.48
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	117.53	117.53		1 645.42
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	75.39	75.39		2 487.87
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.96	18.96		100 084.08
INVESCO S&P 500 ACC	23.00	1 127.16	1 006.75		23 155.31
DPAM L-BONDS EMK SU	9.00	156.48	156.48		1 408.32
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	111.24	111.24		1 557.36
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	186.27	186.27		1 862.70
AMUNDI MSCI EUROPE	752.00	95.53	95.53		71 840.06
INVESCO EUR CORP BON	1 010.68	11.19	11.19		11 312.88
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	57.66	51.50		66 332.69
ISHARES USD TRS 1-3Y	12 518.00	4.97	4.97		62 189.42
Sub-total:					791 363.07
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					77 889.56
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					1 716.83
Sub-total:					79 606.39
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
FUT MINI EUR/USD DEC	2.00				
STOXX EUROPE600 1224	2.00				
FUT MINI EUR/USD DEC					-124 670.64
STOXX EUROPE600 1224					-52 590.00
FUT MINI EUR/USD DEC	2.00	69 790.63	62 335.32		124 670.64
STOXX EUROPE600 1224	2.00	26 295.00	26 295.00		52 590.00
Sub-total:					0.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 391 745.23

Unidades de Participação em circulação: 102 128.27
Valor Unitário de Unidades de Participação: 13.6274

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: 2024-06-30

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.UE					
1.2.1. Títulos de Dívida Pública					
NETHER 0.5% 15072026				86.31	86.31
DBR 0 08/15/31	299 200.00	0.01	0.01		2 529.92
FRTR 0 25/11/2031	14 000.00	0.80	0.80		11 177.18
FRTR 0.75 25022028	20 000.00	0.92	0.92	51.78	18 501.34
SPGB 0 31012027	25.00	924.29	924.29		23 107.25
BGB 0.8% 22062028	1 800 000.00	0.01	0.01	3.16	16 647.94
SPBG 1.4% 30072028	22.00	938.83	938.83	282.75	20 937.01
BGB 0.9% 22062029	1 800 000.00	0.01	0.01	3.55	16 410.91
RFGB 0.5% 15092029	8.00	885.86	885.86	31.58	7 118.46
BGB 0 22102027	500 000.00	0.01	0.01		4 555.50
BTPS 0.85 15012027	7.00	939.50	939.50	27.30	6 603.80
IRISH 0.2% 18102030	394 400.00	0.01	0.01	5.52	3 359.69
BTPS 2.8% 01122028	12.00	974.23	974.23	26.70	11 717.46
BTPS 0.6% 01082031	11.00	807.53	807.53	27.20	8 910.03
SPGB 0.5% 31102031	6.00	828.88	828.88	19.92	4 993.20
FRTR 0 25022027	21 000.00	0.92	0.92		19 380.90
FRTR 0 25/11/2030	11 000.00	0.83	0.83		9 075.31
RAGB 0 0.5 24042027	11.00	934.10	934.10	10.70	10 285.80
RFGB 0.5 15092028	21.00	906.04	906.04	82.91	19 109.75
RAGB 0.5 20022029	20.00	897.40	897.40	35.89	17 983.89
SPGB 0.8 30072029	12.00	895.10	895.10	88.37	10 829.57
OBL 2.2 13042028	768 000.00	0.01	0.01	36.11	7 626.64
BTPS 4 30102031	16.00	1 016.80	1 016.80	106.96	16 375.76
BTPS 2.8 15062029	17.00	967.39	967.39	19.56	16 465.19
NETHER 2.5% 15012030				102.66	102.66
FRTR 2.75 25022029	9 000.00	0.99	0.99	85.20	8 972.89
SPGB 3.5% 31052029	10.00	1 020.08	1 020.08	28.77	10 229.57
FRTR 2.5% 25052030	12 000.00	0.97	0.97	29.59	11 685.43
RFGB 0 15092026	11.00	936.54	936.54		10 301.94
FRTR 5.5% 25042029	6 000.00	1.11	1.11	59.67	6 701.85
BTPS 4 15112030	16.00	1 016.86	1 016.86	80.00	16 349.76
EU 2.875 06122027	10 546.00	1.00	1.00	50.67	10 550.16
EU 0 04072029	16.00	865.30	865.30		13 844.80
BTPS 0.95 01062032	13.00	807.56	807.56	9.81	10 508.09
SPGB 3.45 31102034	3.00	1 002.90	1 002.90	7.09	3 015.79
FRTR 3 25112034	9 000.00	0.97	0.97		8 761.50
EU 3% 04122034	9 550.00	0.99	0.99	97.07	9 509.17
Sub-total:					404 322.42
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	11.00	882.58	882.58		9 708.38
MADRID 3.462 300434	9.00	994.42	994.42	104.14	9 053.92
KFW 26042029	11.00	988.13	988.13	68.83	10 938.26
Sub-total:					29 700.56
1.2.3. Obrigações Diversas					
KFW 2.75 01102027	15.00	994.45	994.45		14 916.75
Sub-total:					448 939.73
1.3. Mercado Cot.Oficiais de Bolsa V.Não UE					
1.3.1. Títulos de Dívida Pública					
TII 0.125 15072030	132.00	109.60	102.38	8.47	13 522.35
TII 0.125 15012031	136.00	106.52	99.51	8.59	13 541.53
TII 0.125 15072031	141.00	102.96	96.18	8.84	13 569.71
Sub-total:					40 633.58
Sub-total:					489 573.31
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	310.00	105.83	105.83		32 807.30

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: 2024-06-30

Pág. 2 de 2

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
ISHARES MSCI EUROPE	2 143.00	32.10	32.10		68 790.30
DBX MSCI EUROPE	764.00	89.96	89.96		68 729.44
AXA WORLD EUR CR SHR	86.40	139.91	139.91		12 088.22
LYXOR UCITS ETF S&P	426.00	56.64	52.91		22 537.61
VANGUARD S&P 500 UCI	116.00	104.28	97.41		11 299.84
ISHARES CORE S&P 500	21.00	579.90	541.71		11 375.90
DBX S&P 500 ACC	222.00	108.73	101.57		22 548.40
BBVA CREDITO EUROPA	166.16	133.69	133.69		22 214.39
AMUNDI S&P500 UCITS	225.00	107.45	100.38		22 584.62
JPMORGAN F-EM MAR LO	11.00	126.52	126.52		1 391.72
SCHRODER IE CORP BON	433.91	25.38	25.38		11 014.46
PICTET-EMERG LCL CCY	12.00	109.48	109.48		1 313.76
GS EMRG MKT CORP BD	21.00	107.14	107.14		2 249.94
X EUR CORPORATE BOND	652.00	151.54	151.54		98 800.82
VONTOBEL EUR CRP MDY	50.68	108.21	108.21		5 484.08
BLACKROCK GIF I EMMK	134.94	101.43	101.43		13 686.96
JPM EMERG MKTS CORP	3.00	103.82	103.82		311.46
MUZIN EMERG MKTS SHO	14.00	114.86	114.86		1 608.04
PICTE-S/T EM CRP BD	33.00	73.16	73.16		2 414.28
AMUNDI PRI EURO COPR	5 278.00	18.38	18.38		96 983.25
INVESCO S&P 500 ACC	22.00	1 077.87	1 006.88		22 151.46
DPAM L-BONDS EMK SU	9.00	151.28	151.28		1 361.52
AXA WORLD EMMK SH DU	14.00	107.59	107.59		1 506.26
GL EVO FDS FRT MRK-I	10.00	182.30	182.30		1 823.00
AMUNDI MSCI EUROPE	760.00	93.04	93.04		70 713.44
INVESCO EUR CORP BON	1 010.68	10.86	10.86		10 971.87
VAND USDCP1-3 USD	1 288.00	55.95	52.27		67 317.70
ISHARES USD TRS 1-3Y	12 518.00	4.85	4.85		60 731.08
Sub-total:					766 811.12
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					
Sub-total:					
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BOBL FUT SET24	1.00				
FUT MINI EUR/USD CME	2.00				
STOXX EUROPE600 0924	2.00				
EURO-BOBL FUT SET24					-116 440.00
FUT MINI EUR/USD CME					-125 548.81
STOXX EUROPE600 0924					-51 420.00
EURO-BOBL FUT SET24	1.00	116 440.00	116 440.00		116 440.00
FUT MINI EUR/USD CME	2.00	67 200.00	62 774.40		125 548.81
STOXX EUROPE600 0924	2.00	25 710.00	25 710.00		51 420.00
Sub-total:					0.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					1 365 371.32

Unidades de Participação em circulação: 102 538.24
Valor Unitário de Unidades de Participação: 13.3157