

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					305 698.71
Sub-total:					305 698.71
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-8 688.06
Sub-total:					-8 688.06
Sub-total:					297 010.65
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

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)
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					236 117.09
Sub-total:					236 117.09
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-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 Participação:		6.4105			

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: 2023-03-31

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					
SPGB 5.9% 30072026	56.00	1 094.16	1 094.16	2 208.70	63 481.66
BTPS 2% 01122025	5.00	965.97	965.97	32.97	4 862.82
NETHER 0.5% 15072026	48 000.00	0.93	0.93	170.30	45 040.70
BTPS 1.6% 01062026	30.00	947.66	947.66	157.81	28 587.61
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		7 127.78
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.79	0.79		30 893.46
SPGBEI 0.15 30112023	44.00	1 191.67	1 191.67	21.88	52 455.41
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.91	0.91	37.03	48 427.09
SPGB 0 31012027	68.00	895.35	895.35		60 883.80
BGB 0.9% 22062029	5 000 000.00	0.01	0.01	347.67	45 330.17
SPGB 1.45% 30042029	11.00	912.21	912.21	146.39	10 180.70
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 537.76
BTPS 0.85 15012027	20.00	910.20	910.20	35.42	18 239.42
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	10.24	9 476.08
BTPS 0.6% 01082031	30.00	768.99	768.99	28.84	23 098.54
FRTR 0 25022027	113 000.00	0.90	0.90		102 055.95
SPGB 0 31/01/2028	9.00	866.42	866.42		7 797.78
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		34 576.20
BTPS 0 01082026	42.00	894.29	894.29		37 560.18
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.82	0.82		25 296.00
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	915.55	915.55	141.78	27 608.28
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	253.73	25 091.79
BTPS 1.2 08/15/25	74.00	952.30	952.30	107.93	70 577.76
NETHER 0 15012026	31 000.00	0.93	0.93		28 829.69
SPGB 2.8% 31052026	40.00	996.13	996.13	224.00	40 069.20
NETHER 2.5 15072033	54 000.00	0.99	0.99	184.93	53 482.93
RFGb 0.5 15092028	57.00	888.53	888.53	153.82	50 800.03
RAGB 0.5 20022029	54.00	875.30	875.30	28.85	47 295.05
SPGB 0.8 30072029	66.00	871.81	871.81	352.96	57 892.42
DBR 2.1 15112029	2 700 000.00	0.01	0.01	251.65	26 920.09
BTPS 3.85 15122029	16.00	1 003.79	1 003.79	178.89	16 239.45
OBL 2.2 13042028	3 800 000.00	0.01	0.01	162.62	37 931.20
SGLT 009062023	120.00	994.93	994.93		119 391.60
SGLT 0 11082023	120.00	989.62	989.62		118 754.40
DBR 2.3 15022033	2 100 000.00	0.01	0.01		20 978.16
Sub-total:					1 408 771.16
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
KFW 0 09112028	30.00	854.66	854.66		25 639.80
EU 0 20281004	15 927.00	0.85	0.85		13 609.46
Sub-total:					39 249.26
Sub-total:					1 448 020.42
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	102.33	102.33		72 040.32
ISHARES MSCI EUROPE	6 897.00	28.69	28.69		197 840.45
DBX MSCI EUROPE	2 567.00	76.92	76.92		197 453.64
LYXOR UCITS ETF S&P	1 702.00	41.69	38.33		65 243.33
VANGUARD S&P 500 UCI	458.00	77.36	71.13		32 578.01
ISHARES CORE S&P 500	84.00	423.60	389.52		32 719.45
DBX S&P 500 ACC	894.00	79.27	72.89		65 165.41
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	157.55	157.55		128 560.80
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	126.50	126.50		47 043.24
AMUNDI S&P500 UCITS	909.00	78.42	72.11		65 547.80
GAM LOCAL EMERG BD-E	43.00	121.27	121.27		5 214.61
JPMORGAN F-EM MAR LO	28.00	121.54	121.54		3 403.12

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2023-03-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	140.34	140.34		128 270.76
SCHRODER IE CORP BON	967.00	22.92	22.92		22 166.15
BNP INSTICASH-EUR-1D	710.28	99.53	99.53		70 697.27
AXA WORLD EUR CR SHD	265.00	97.50	97.50		25 837.50
PICTET-EMERG LCL CCY	30.00	106.64	106.64		3 199.20
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	97.47	97.47		17 934.48
X EUR CORPORATE BOND	1 753.00	142.62	142.62		250 012.86
VONTOBEL EUR CRP MDY	109.96	99.35	99.35		10 924.63
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	92.97	92.97		18 315.09
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	96.55	96.55		3 282.70
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	106.74	106.74		4 162.86
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	68.18	68.18		4 227.16
AMUNDI PRI EURO COPR	13 956.00	17.62	17.62		245 841.92
INVESCO S&P 500 ACC	90.00	785.31	722.12		64 991.17
DPAM L-BONDS EMK SU	25.00	137.28	137.28		3 432.00
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	101.09	101.09		3 841.42
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	158.85	158.85		3 653.55
AMUNDI MSCI EUROPE	2 547.00	79.95	79.95		203 635.20
INVESCO EUR CORP BON	2 180.00	10.06	10.06		21 936.90
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	52.61	48.38		142 615.43
Sub-total:					2 161 788.44
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					130 334.24
Sub-total:					130 334.24
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-17 171.61
Sub-total:					-17 171.61
Sub-total:					113 162.63
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BUND FUT jun23	1.00				
FUT EUR/USD CME 0623	1.00				
EURO-BUND FUT jun23					-135 840.00
FUT EUR/USD CME 0623					-125 327.59
EURO-BUND FUT jun23	1.00	135 840.00	135 840.00		135 840.00
FUT EUR/USD CME 0623	1.00	136 293.75	125 327.59		125 327.59
Sub-total:					0.00
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 722 971.49

Unidades de Participação em circulação: 584 167.67
Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.3731

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: 2022-12-31

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 0.1% 15042023	2 000 000.00	0.01	0.01	17.25	24 762.61
BTPS 2% 01122025	5.00	957.08	957.08	8.22	4 793.62
NETHER 0.5% 15072026	73 000.00	0.93	0.93	169.00	67 787.44
SPGB 1.3% 31102026	54.00	937.84	937.84	117.32	50 760.68
BTPS 1.6% 01062026	30.00	933.48	933.48	39.45	28 043.85
DBR 0 08/15/31	858 200.00	0.01	0.01		6 946.96
FRTR 0 25/11/2020	39 000.00	0.77	0.77		29 951.61
SPGBEI 0.15 30112023	33.00	1 192.87	1 192.87	4.20	39 368.88
FRTR 0.75 25022028	53 000.00	0.90	0.90	336.51	48 011.07
SPGB 0 31012027	102.00	881.50	881.50		89 913.00
BGB 0 22102027	1 300 000.00	0.01	0.01		11 328.59
BTPS 0.85 15012027	20.00	893.10	893.10	77.92	17 939.92
IRISH 0.2% 18102030	1 139 200.00	0.01	0.01	4.62	9 222.46
BTPS 0.6% 01082031	30.00	728.43	728.43	74.35	21 927.25
FRTR 0 25022027	139 000.00	0.89	0.89		123 825.37
SPGB 0 31/01/2028	9.00	853.63	853.63		7 682.67
SPGB 0.7 30/04/2032	55.00	774.46	774.46	258.42	42 853.72
OBL 0 14/04/2027	3 800 000.00	0.01	0.01		34 136.16
FRTR 0 25/05/2032	74 000.00	0.75	0.75		55 676.12
FRTR 0 25022025	14 000.00	0.94	0.94		13 164.06
BTPS 0 01082026	42.00	876.88	876.88		36 828.96
FRTR 0 25/11/2030	31 000.00	0.79	0.79		24 618.34
DBR 0 15022032	3 700 000.00	0.01	0.01		29 531.18
RAGB 0 0.5 24042027	30.00	904.50	904.50	104.79	27 239.79
OBL 1.3 15102027	2 600 000.00	0.01	0.01	170.39	24 740.13
BUBILL 0 13042023	6 500 000.00	0.01	0.01		64 640.55
BTPS 1.2 08/15/25	74.00	941.41	941.41	333.00	69 997.34
BGTB 0 09112023	1 900 000.00	0.01	0.01		18 555.97
Sub-total:					1 024 248.30
1.2.2. Outros Fundos Públicos e Equiparados					
EU 0.8 04/04/2025	85 000.00	0.95	0.95	422.90	81 065.80
KFW CUP 0 02/18/25	49.00	940.44	940.44		46 081.56
KFW 0 09112028	30.00	837.45	837.45		25 123.50
EU 0 20281004	15 927.00	0.84	0.84		13 414.36
ESM 1% 23092025	2 489 800.00	0.01	0.01	67.53	23 700.96
Sub-total:					189 386.18
Sub-total:					1 213 634.48
3. Unidades Particip. Inst.Invest.Colectivo					
3.1. Fundos Harmonizados					
ISCHARES BARC EU CP	704.00	101.92	101.92		71 751.68
ISHARES MSCI EUROPE	6 994.00	26.46	26.46		185 061.24
DBX MSCI EUROPE	2 612.00	71.17	71.17		185 896.04
LYXOR UCITS ETF S&P	1 603.00	38.95	36.52		58 534.45
VANGUARD S&P 500 UCI	431.00	72.55	68.02		29 316.08
ISHARES CORE S&P 500	79.00	395.45	370.76		29 289.85
DBX S&P 500 ACC	850.00	74.06	69.43		59 016.27
ISHARES EURO GB 3-5Y	816.00	155.04	155.04		126 512.64
BBVA CREDITO EUROPA	371.88	125.70	125.70		46 744.49
AMUNDI S&P500 UCITS	860.00	73.16	68.59		58 984.99
GAM LOCAL EMERG BD-E	43.00	117.70	117.70		5 061.10
JPMORGAN F-EM MAR LO	28.00	117.30	117.30		3 284.40
LYXOR EUROMTS 3-5Y D	914.00	138.26	138.26		126 369.64
SCHRODER IE CORP BON	967.00	22.56	22.56		21 814.17
BNP INSTICASH-EUR-1D	710.28	98.96	98.96		70 291.20
AXA WORLD EUR CR SHD	265.00	96.65	96.65		25 612.25

Entidade Gestora: BBVA Fundos - SGFP, SA
Sede: AV. DA LIBERDADE, NR. 222, 1250-148, LISBOA
Fundo: F.PENSOES BBVA PME
Data: 2022-12-31

Designação	Quantidade	Cotação	Cotação (EUR)	Montante Juros (EUR)	Montante Global (EUR)
PICTET-EMERG LCL CCY	30.00	104.97	104.97		3 149.10
GS EMRG MKT CORP BD	184.00	96.77	96.77		17 805.68
X EUR CORPORATE BOND	1 753.00	140.67	140.67		246 585.75
VONTOBEL EUR CRP MDY	109.96	98.71	98.71		10 854.25
BLACKROCK GIF I EMMK	197.00	92.21	92.21		18 165.37
JPM EMERG MKTS CORP	34.00	96.77	96.77		3 290.18
MUZIN EMERG MKTS SHO	39.00	106.29	106.29		4 145.31
PICTE-S/T EM CRP BD	62.00	68.75	68.75		4 262.50
AMUNDI PRI EURO COPR	13 956.00	17.37	17.37		242 373.85
INVESCO S&P 500 ACC	86.00	733.36	687.57		59 130.85
DPAM L-BONDS EMK SU	25.00	133.58	133.58		3 339.50
AXA WORLD EMMK SH DU	38.00	101.29	101.29		3 849.02
GL EVO FDS FRT MRK-I	23.00	157.39	157.39		3 619.97
AMUNDI MSCI EUROPE	2 590.00	73.72	73.72		190 937.39
INVESCO EUR CORP BON	2 180.00	9.97	9.97		21 739.18
VAND USDCP1-3 USD	2 948.00	51.96	48.72		143 613.43
Sub-total:					2 080 401.80
5. Liquidez					
5.1. A Vista					
5.1.2. Depósitos à Ordem					
Depositos a Ordem					378 864.51
Sub-total:					378 864.51
5.2. A Prazo					
5.2.1. Depósitos e Outros Equipados					
Outros					-28 927.21
Sub-total:					-28 927.21
Sub-total:					349 937.30
PARTE II - VALORES EXTRA-PATRIMONIAIS					
7. Operações com produtos derivados					
7.1. Em Mercado Regulamentado					
7.1.1. Futuros					
EURO-BUND FUT MAR23	1.00				
FUT EUR/USD CME 0312	1.00				
EURO-BUND FUT MAR23					-132 930.00
FUT EUR/USD CME 0312					-126 031.31
EURO-BUND FUT MAR23	1.00	132 930.00	132 930.00		132 930.00
FUT EUR/USD CME 0312	1.00	134 425.00	126 031.31		126 031.31
TOTAL DOS VALORES EM CARTEIRA					3 643 973.58

Unidades de Participação em circulação: 584 840.64
Valor Unitário de Unidades de Participação: 6.2307