



CHINA CONSTRUCTION BANK (BRASIL) BANCO MULTIPLO SA

POSIÇÃO DE TÍTULOS EM 30/06/2020

MTM VISÃO BANCO

SISTEMA SWAP

CLIENTE: COPERSUCAR SA  
 CNPJ: 010.265.949.000-1-77

Operação	Data da Operação	Data de Vencimento	Valor da Operação	Taxa Termo (FWD)	Valor da Curva Dado	Valor da Curva Tomado	Ajuste	Valor MTM Dado	Valor MTM Tomado	Ajuste MTM
Compra Termo Moeda	10/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	4,9051	5.441.600,00	4.905.100,00	536.500,00	5.475.537,77	4.904.685,96	570.851,81
Venda Termo Moeda	15/06/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,1080	10.216.000,00	10.883.200,00	-667.200,00	10.215.137,67	10.951.075,55	-735.937,88
Venda Termo Moeda	30/06/2020	03/08/2020	1.500.000,00	5,4530	8.179.500,00	8.162.400,00	17.100,00	8.162.961,00	8.143.500,43	19.460,57
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3520	5.352.000,00	5.441.600,00	-89.600,00	5.351.548,24	5.475.537,77	-123.989,53
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3000	5.300.000,00	5.441.600,00	-141.600,00	5.299.552,63	5.475.537,77	-175.985,14
Venda Termo Moeda	08/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	4,9170	4.917.000,00	5.441.600,00	-524.600,00	4.916.584,96	5.475.537,77	-558.952,81
Venda Termo Moeda	09/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	4,8945	4.894.500,00	5.441.600,00	-547.100,00	4.894.086,86	5.475.537,77	-581.450,91
Venda Termo Moeda	21/05/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,5990	11.198.000,00	10.883.200,00	314.800,00	11.197.054,78	10.951.075,55	245.979,23
Venda Termo Moeda	21/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,5930	5.593.000,00	5.441.600,00	151.400,00	5.592.527,90	5.475.537,77	116.990,13
Compra Termo Moeda	04/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,1170	5.441.600,00	5.117.000,00	324.600,00	5.475.537,77	5.116.568,08	358.969,69
Compra Termo Moeda	04/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,0911	5.441.600,00	5.091.100,00	350.500,00	5.475.537,77	5.090.670,26	384.867,51
Venda Termo Moeda	02/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3020	5.302.000,00	5.441.600,00	-139.600,00	5.301.552,46	5.475.537,77	-173.985,31
Venda Termo Moeda	02/06/2020	01/07/2020	200.000,00	5,2679	1.053.580,00	1.088.320,00	-34.740,00	1.053.491,07	1.095.107,55	-41.616,48
Venda Termo Moeda	05/06/2020	01/07/2020	100.000,00	5,0350	503.500,00	544.160,00	-40.660,00	503.457,50	547.553,78	-44.096,28
Venda Termo Moeda	05/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	4,9765	4.976.500,00	5.441.600,00	-465.100,00	4.976.079,94	5.475.537,77	-499.457,83
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,3215	10.643.000,00	10.883.200,00	-240.200,00	10.642.101,63	10.951.075,55	-308.973,92
Compra Termo Moeda	28/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3340	5.441.600,00	5.334.000,00	107.600,00	5.475.537,77	5.333.549,76	141.988,01
Venda Termo Moeda	03/06/2020	01/07/2020	1.500.000,00	5,0900	7.635.000,00	8.162.400,00	-527.400,00	7.634.355,53	8.213.306,66	-578.951,13
Venda Termo Moeda	03/06/2020	01/07/2020	100.000,00	5,0825	508.250,00	544.160,00	-35.910,00	508.207,10	547.553,78	-39.346,68
Compra Termo Moeda	26/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3895	5.441.600,00	5.389.500,00	52.100,00	5.475.537,77	5.389.045,07	86.492,70
Venda Termo Moeda	26/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3645	5.364.500,00	5.441.600,00	-77.100,00	5.364.047,18	5.475.537,77	-111.490,59
Venda Termo Moeda	18/06/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,3774	10.754.800,00	10.883.200,00	-128.400,00	10.753.892,19	10.951.075,55	-197.183,36
Venda Termo Moeda	23/06/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,2150	5.215.000,00	5.441.600,00	-226.600,00	5.214.559,80	5.475.537,77	-260.977,97