

Extrato para Simples Conferência - Termo de Moedas - Accrual

Data: 30/6/2020

Cliente: COPERSUCAR S/A

CNPJ: 10.265.949/0001-77

End: AV DAS NACOES UNIDAS , 14261 - VILA GERTRUDES - SAO PAULO

CEP: 04794-000

Prezados senhores, conforme sua solicitação, segue extrato para simples referência com detalhes das operações efetivadas entre esta instituição e V.Sas.. As informações aqui apresentadas representam valores apurados conforme 'visão do cliente'. Exceto quando assinado, os valores apresentados estão em reais.

Operação	Posição	Moeda	Taxa PRE	Taxa Forward (R\$)	Valor Principal (ME)	Início	Vencimento	Accrual Cambial (R\$)	Accrual PRE (R\$)	Resultado Accrual (R\$)	Cetip ID
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,7008	5,726200	12.000.000,00	20/05/2020	01/07/2020	65.299.200,00	68.712.495,81	3.413.295,81	20E00922514
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,6397	5,725800	136.690.701,52	20/05/2020	01/07/2020	743.816.121,39	782.643.815,14	38.827.693,75	20E00922515
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,6397	5,725800	100.000.000,00	20/05/2020	01/07/2020	544.160.000,00	572.565.512,09	28.405.512,09	20E00922518
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-10,1936	5,377900	1.000.000,00	01/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.380.194,94	-61.405,06	20F00010506
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-18,6007	5,277000	1.000.000,00	02/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.281.311,37	160.288,63	20F00028083
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-29,7781	5,215500	4.500.000,00	02/06/2020	01/07/2020	24.487.200,00	23.502.696,89	984.503,11	20F00030196
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-42,8385	5,042900	2.000.000,00	03/06/2020	01/07/2020	10.883.200,00	10.108.209,34	-774.990,66	20F00045955
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	11,4292	5,090800	1.500.000,00	04/06/2020	01/07/2020	8.162.400,00	7.632.921,39	-529.478,61	20F00058446
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	16,2423	5,106200	939.472,88	04/06/2020	01/07/2020	5.112.235,62	4.794.272,19	-317.963,43	20F00059580
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-9,7761	5,068800	1.000.000,00	05/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.070.869,69	370.730,31	20F00148938
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-32,3477	4,971300	1.000.000,00	05/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	4.979.015,22	462.584,78	20F00148939
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-26,5340	4,881000	1.000.000,00	08/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	4.886.976,05	554.623,95	20F00167262
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-1,3411	4,912000	4.471.014,13	09/06/2020	01/10/2020	24.329.470,49	22.039.421,38	-2.290.049,11	20F00183816
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-4,4342	4,919800	1.000.000,00	09/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	4.920.685,55	-520.914,45	20F00183817

Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-0,3297	4,904800	1.000.000,00	10/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	4.904.864,28	-536.735,72	20F00598985
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	82,6564	5,183900	3.000.000,00	15/06/2020	01/07/2020	16.324.800,00	15.514.566,19	810.233,81	20F00639893
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-41,1254	5,069700	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.080.368,84	-361.231,16	20F00658779
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-30,6091	5,106200	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.113.609,64	-327.990,36	20F00658780
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-18,3100	5,142700	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.146.828,84	-294.771,16	20F00658781
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-9,4860	5,119000	939.472,88	16/06/2020	03/08/2020	5.112.235,62	4.855.027,51	-257.208,11	20F00658782
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	76,1182	5,357100	1.000.000,00	18/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.345.081,60	-96.518,40	20F00692293
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	2,4959	5,453000	2.900.000,00	18/06/2020	03/01/2022	15.780.640,00	15.236.629,76	-544.010,24	20F00692294
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	2,2632	5,350600	1.000.000,00	19/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.350.124,85	-91.475,15	20F00705972
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-48,7287	5,248300	1.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.262.231,42	179.368,58	20F00719063
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-57,8554	5,219800	1.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.237.728,48	203.871,52	20F00719064
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-55,9243	5,226300	3.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	16.324.800,00	15.729.955,66	594.844,34	20F00719065
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-38,6993	5,162100	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.172.134,44	269.465,56	20F00735265
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-44,8594	5,149100	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.161.277,77	280.322,23	20F00735266
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-46,4118	5,145600	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.158.354,04	283.245,96	20F00735966
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	19.652.774,31	25/06/2020	01/07/2020	106.942.536,69	104.248.278,97	2.694.257,72	20F00770415
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	19.652.774,31	25/06/2020	03/08/2020	106.942.536,69	103.237.266,85	-3.705.269,84	20F00770416
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	22.306.944,55	25/06/2020	03/08/2020	121.385.469,46	117.179.791,04	4.205.678,42	20F00770417
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	22.306.944,55	25/06/2020	01/07/2020	121.385.469,46	118.327.343,59	-3.058.125,87	20F00770418
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	800.000,00	25/06/2020	03/08/2020	4.353.280,00	4.202.450,61	150.829,39	20F00770419
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	800.000,00	25/06/2020	01/07/2020	4.353.280,00	4.243.605,60	-109.674,40	20F00770420
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	619,8593	5,455400	1.000.000,00	26/06/2020	01/07/2020	5.441.600,00	5.412.835,42	-28.764,58	20F00785826
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	386,4060	5,430000	100.000.000,00	26/06/2020	01/07/2020	544.160.000,00	539.602.115,02	4.557.884,98	20F00785827
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	20,9487	5,434300	100.000.000,00	26/06/2020	03/08/2020	544.160.000,00	533.674.971,03	-10.485.028,97	20F00785828

=====

As avaliações a preço de mercado (mark-to-market) expressas acima aplicam-se a transações pendentes entre V.Sas. e o Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A. e suas subsidiárias e afiliadas (coletivamente, "Bank of America Merrill Lynch"). Tais avaliações foram calculadas pelo Bank of America Merrill Lynch com base nas melhores práticas e suposições comerciais razoáveis. Preços, opiniões e estimativas refletem o julgamento razoável do Bank of America Merrill Lynch e estão sujeitas a modificações sem aviso prévio. Esta é apenas uma estimativa de avaliação a preços de mercado (mark-to-market); a eventual liquidação ou resolução antecipada das referidas transações poderá em preços, opiniões, custos e estimativas distintos daqueles ora apresentados. Toda informação aqui contida é tida por confiável, entretanto o Bank of America Merrill Lynch não pode garantir sua completude ou precisão. Esta não é uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro.

O Bank of America atua como parte independente, não tendo prestado assessoria financeira, legal ou fiscal a V.Sas. V.Sas devem realizar uma revisão independente das questões ora apresentadas com vistas a chegar a conclusões próprias acerca dos cálculos referentes às circunstâncias particulares de V.Sas. A Merrill Lynch não tem qualquer responsabilidade ou obrigação junto à sociedade ou qualquer outra pessoa por estes termos. Toda informação aqui contida é confidencial e de propriedade do Bank of America Merrill Lynch e V.Sas. encontram-se autorizadas a comunicá-las tão somente a seus funcionários e diretores delas necessitem saber em decorrência da avaliação a preços de mercado (mark-to-market) aplicáveis a transações pendentes realizadas entre as partes.

=====

Ouvidoria Bank of America: 0800-8862000
Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A.

Extrato para Simples Conferência - Termo de Moedas - MTM

Data: 30/6/2020

Cliente: COPERSUCAR S/A

CNPJ: 10.265.949/0001-77

End: AV DAS NACOES UNIDAS , 14261 - VILA GERTRUDES - SAO PAULO

CEP: 04794-000

Prezados senhores, conforme sua solicitação, segue extrato para simples referência com detalhes das operações efetivadas entre esta instituição e V.Sas.. As informações aqui apresentadas representam valores apurados conforme 'visão do cliente'. Exceto quando assinado, os valores apresentados estão em reais.

Operação	Posição	Moeda	Taxa PRE	Taxa Forward (R\$)	Valor Principal (ME)	Início	Vencimento	MTM Cambial (R\$)	MTM PRE (R\$)	Resultado MTM (R\$)	Cetip ID
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,7008	5,726200	12.000.000,00	20/05/2020	01/07/2020	65.706.453,27	68.708.599,84	3.002.146,57	20E00922514
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,6397	5,725800	136.690.701,52	20/05/2020	01/07/2020	748.455.099,34	782.597.554,38	34.142.455,04	20E00922515
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	0,6397	5,725800	100.000.000,00	20/05/2020	01/07/2020	547.553.777,26	572.531.668,71	24.977.891,45	20E00922518
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-10,1936	5,377900	1.000.000,00	01/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.377.446,05	-98.091,72	20F00010506
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-18,6007	5,277000	1.000.000,00	02/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.276.554,57	198.983,20	20F00028083
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-29,7781	5,215500	4.500.000,00	02/06/2020	01/07/2020	24.639.919,98	23.467.768,93	1.172.151,05	20F00030196
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-42,8385	5,042900	2.000.000,00	03/06/2020	01/07/2020	10.951.075,55	10.084.948,66	-866.126,89	20F00045955
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	11,4292	5,090800	1.500.000,00	04/06/2020	01/07/2020	8.213.306,66	7.635.555,43	-577.751,23	20F00058446
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	16,2423	5,106200	939.472,88	04/06/2020	01/07/2020	5.144.119,24	4.796.731,50	-347.387,74	20F00059580
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-9,7761	5,068800	1.000.000,00	05/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.068.372,14	407.165,63	20F00148938
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-32,3477	4,971300	1.000.000,00	05/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	4.970.880,37	504.657,40	20F00148939
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-26,5340	4,881000	1.000.000,00	08/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	4.880.588,00	594.949,77	20F00167262
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-1,3411	4,912000	4.471.014,13	09/06/2020	01/10/2020	24.238.052,63	21.843.808,99	-2.394.243,64	20F00183816
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-4,4342	4,919800	1.000.000,00	09/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	4.919.384,72	-556.153,05	20F00183817

Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-0,3297	4,904800	1.000.000,00	10/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	4.904.385,99	-571.151,78	20F00598985
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	82,6564	5,183900	3.000.000,00	15/06/2020	01/07/2020	16.426.613,32	15.550.387,29	876.226,03	20F00639893
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-41,1254	5,069700	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.069.272,07	-406.265,70	20F00658779
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-30,6091	5,106200	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.105.768,99	-369.768,78	20F00658780
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-18,3100	5,142700	1.000.000,00	16/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.142.265,91	-333.271,86	20F00658781
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	-9,4860	5,119000	939.472,88	16/06/2020	03/08/2020	5.100.433,79	4.799.437,52	-300.996,27	20F00658782
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	76,1182	5,357100	1.000.000,00	18/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.356.647,81	-118.889,96	20F00692293
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	2,4959	5,453000	2.900.000,00	18/06/2020	03/01/2022	15.495.522,39	15.142.048,21	-353.474,18	20F00692294
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	2,2632	5,350600	1.000.000,00	19/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.350.148,36	-125.389,41	20F00705972
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-48,7287	5,248300	1.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.247.856,99	227.680,78	20F00719063
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-57,8554	5,219800	1.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.219.359,40	256.178,37	20F00719064
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-55,9243	5,226300	3.000.000,00	22/06/2020	01/07/2020	16.426.613,32	15.677.576,55	749.036,77	20F00719065
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-38,6993	5,162100	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.161.664,27	313.873,50	20F00735265
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-44,8594	5,149100	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.148.665,37	326.872,40	20F00735266
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	-46,4118	5,145600	1.000.000,00	23/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.145.165,66	330.372,11	20F00735966
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	19.652.774,31	25/06/2020	01/07/2020	107.609.508,07	104.642.189,64	2.967.318,43	20F00770415
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	19.652.774,31	25/06/2020	03/08/2020	106.695.654,80	104.541.406,00	-2.154.248,80	20F00770416
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	22.306.944,55	25/06/2020	03/08/2020	121.105.245,38	118.660.058,37	2.445.187,01	20F00770417
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	22.306.944,55	25/06/2020	01/07/2020	122.142.517,48	118.774.453,17	-3.368.064,31	20F00770418
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	16,5398	5,330200	800.000,00	25/06/2020	03/08/2020	4.343.230,25	4.255.537,84	87.692,41	20F00770419
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	164,2381	5,325000	800.000,00	25/06/2020	01/07/2020	4.380.430,22	4.259.640,41	-120.789,81	20F00770420
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	619,8593	5,455400	1.000.000,00	26/06/2020	01/07/2020	5.475.537,77	5.454.939,51	-20.598,26	20F00785826
Non Deliverable Forward	Comprador	USD PTAX VENDA	386,4060	5,430000	100.000.000,00	26/06/2020	01/07/2020	547.553.777,26	542.954.165,55	4.599.611,71	20F00785827
Non Deliverable Forward	Vendedor	USD PTAX VENDA	20,9487	5,434300	100.000.000,00	26/06/2020	03/08/2020	542.903.780,97	542.331.181,31	-572.599,66	20F00785828

=====

As avaliações a preço de mercado (mark-to-market) expressas acima aplicam-se a transações pendentes entre V.Sas. e o Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A. e suas subsidiárias e afiliadas (coletivamente, "Bank of America Merrill Lynch"). Tais avaliações foram calculadas pelo Bank of America Merrill Lynch com base nas melhores práticas e suposições comerciais razoáveis. Preços, opiniões e estimativas refletem o julgamento razoável do Bank of America Merrill Lynch e estão sujeitas a modificações sem aviso prévio. Esta é apenas uma estimativa de avaliação a preços de mercado (mark-to-market); a eventual liquidação ou resolução antecipada das referidas transações poderá em preços, opiniões, custos e estimativas distintos daqueles ora apresentados. Toda informação aqui contida é tida por confiável, entretanto o Bank of America Merrill Lynch não pode garantir sua completude ou precisão. Esta não é uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro.

O Bank of America atua como parte independente, não tendo prestado assessoria financeira, legal ou fiscal a V.Sas. V.Sas devem realizar uma revisão independente das questões ora apresentadas com vistas a chegar a conclusões próprias acerca dos cálculos referentes às circunstâncias particulares de V.Sas. A Merrill Lynch não tem qualquer responsabilidade ou obrigação junto à sociedade ou qualquer outra pessoa por estes termos. Toda informação aqui contida é confidencial e de propriedade do Bank of America Merrill Lynch e V.Sas. encontram-se autorizadas a comunicá-las tão somente a seus funcionários e diretores delas necessitem saber em decorrência da avaliação a preços de mercado (mark-to-market) aplicáveis a transações pendentes realizadas entre as partes.

=====

Ouvidoria Bank of America: 0800-8862000
Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A.

Extrato para Simples Conferência - Swaps - Accrual

Data: 30/6/2020
Cliente: COPERSUCAR S/A
CNPJ: 10.265.949/0001-77
End: AV DAS NACOES UNIDAS , 14261 - VILA GERTRUDES - SAO PAULO
CEP: 04794-000

Prezados senhores, conforme sua solicitação, segue extrato para simples referência com detalhes das operações efetivadas entre esta instituição e V.Sas.. As informações aqui apresentadas representam valores apurados conforme 'visão do cliente'. Exceto quando assinado, os valores apresentados estão em reais.

Operação	Moeda/Indexador ativo Cliente	Moeda/Indexador ativo Banco	Valor do Principal (R\$)	Início	Vencimento	Accrual Ativo (R\$)	Accrual Passivo (R\$)	Resultado Accrual (R\$)	Cetip ID
CDI + SPREAD X PRE	CDI + SPREAD	PRE	100.000.000,00	10/10/2019	06/08/2021	101.618.135,14	102.218.040,70	-599.905,56	19J00153747
CDI + SPREAD X PRE	CDI + SPREAD	PRE	300.000.000,00	07/02/2022	06/02/2023	0,00	0,00	0,00	20C00067334
USD X CDI + SPREAD	USD	CDI + SPREAD	513.300.000,00	31/03/2020	03/04/2023	551.459.457,41	519.055.480,73	32.403.976,68	20C00937794
						653.077.592,55	621.273.521,43	31.804.071,12	

As avaliações a preço de mercado (mark-to-market) expressas acima aplicam-se a transações pendentes entre V.Sas. e o Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A. e suas subsidiárias e afiliadas (coletivamente, "Bank of America Merrill Lynch"). Tais avaliações foram calculadas pelo Bank of America Merrill Lynch com base nas melhores práticas e suposições comerciais razoáveis. Preços, opiniões e estimativas refletem o julgamento razoável do Bank of America Merrill Lynch e estão sujeitas a modificações sem aviso prévio. Esta é apenas uma estimativa de avaliação a preços de mercado (mark-to-market); a eventual liquidação ou resolução antecipada das referidas transações poderá em preços, opiniões, custos e estimativas distintos daqueles ora apresentados. Toda informação aqui contida é tida por confiável, entretanto o Bank of America Merrill Lynch não pode garantir sua completude ou precisão. Esta não é uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro.

O Bank of America atua como parte independente, não tendo prestado assessoria financeira, legal ou fiscal a V.Sas. V.Sas devem realizar uma revisão independente das questões ora apresentadas com vistas a chegar a conclusões próprias acerca dos cálculos referentes às circunstâncias particulares de V.Sas. A Merrill Lynch não tem qualquer responsabilidade ou obrigação junto à sociedade ou qualquer outra pessoa por estes termos. Toda informação aqui contida é confidencial e de propriedade do Bank of America Merrill Lynch e V.Sas. encontram-se autorizadas a comunicá-las tão somente a seus funcionários e diretores delas necessitem saber em decorrência da avaliação a preços de mercado (mark-to-market) aplicáveis a transações pendentes realizadas entre as partes.

Extrato para Simples Conferência - Swaps - MTM

Data: 30/6/2020
Cliente: COPERSUCAR S/A
CNPJ: 10.265.949/0001-77
End: AV DAS NACOES UNIDAS , 14261 - VILA GERTRUDES - SAO PAULO
CEP: 04794-000

Prezados senhores, conforme sua solicitação, segue extrato para simples referência com detalhes das operações efetivadas entre esta instituição e V.Sas.. As informações aqui apresentadas representam valores apurados conforme 'visão do cliente'. Exceto quando assinado, os valores apresentados estão em reais.

Operação	Moeda/Indexador ativo Cliente	Moeda/Indexador ativo Banco	Valor do Principal (R\$)	Início	Vencimento	MTM Ativo (R\$)	MTM Passivo (R\$)	Resultado MTM (R\$)	Cetip ID
CDI + SPREAD X PRE	CDI + SPREAD	PRE	100.000.000,00	10/10/2019	06/08/2021	102.479.826,43	105.823.867,48	-3.344.041,05	19J00153747
CDI + SPREAD X PRE	CDI + SPREAD	PRE	300.000.000,00	07/02/2022	06/02/2023	287.758.996,03	288.427.340,70	-668.344,67	20C00067334
USD X CDI + SPREAD	USD	CDI + SPREAD	513.300.000,00	31/03/2020	03/04/2023	567.644.453,57	536.592.913,97	31.051.539,60	20C00937794
						957.883.276,03	930.844.122,15	27.039.153,88	

As avaliações a preço de mercado (mark-to-market) expressas acima aplicam-se a transações pendentes entre V.Sas. e o Bank of America Merrill Lynch Banco Múltiplo S.A. e suas subsidiárias e afiliadas (coletivamente, "Bank of America Merrill Lynch"). Tais avaliações foram calculadas pelo Bank of America Merrill Lynch com base nas melhores práticas e suposições comerciais razoáveis. Preços, opiniões e estimativas refletem o julgamento razoável do Bank of America Merrill Lynch e estão sujeitas a modificações sem aviso prévio. Esta é apenas uma estimativa de avaliação a preços de mercado (mark-to-market); a eventual liquidação ou resolução antecipada das referidas transações poderá em preços, opiniões, custos e estimativas distintos daqueles ora apresentados. Toda informação aqui contida é tida por confiável, entretanto o Bank of America Merrill Lynch não pode garantir sua completude ou precisão. Esta não é uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro.

O Bank of America atua como parte independente, não tendo prestado assessoria financeira, legal ou fiscal a V.Sas. V.Sas devem realizar uma revisão independente das questões ora apresentadas com vistas a chegar a conclusões próprias acerca dos cálculos referentes às circunstâncias particulares de V.Sas. A Merrill Lynch não tem qualquer responsabilidade ou obrigação junto à sociedade ou qualquer outra pessoa por estes termos. Toda informação aqui contida é confidencial e de propriedade do Bank of America Merrill Lynch e V.Sas. encontram-se autorizadas a comunicá-las tão somente a seus funcionários e diretores delas necessitem saber em decorrência da avaliação a preços de mercado (mark-to-market) aplicáveis a transações pendentes realizadas entre as partes.