

Extrato de Posição de NDF - Contábil & Mark to Market

Data Base:

26/02/2021

Visão: Cliente

Resumo da Operação										Valores Atuais - Contábil			Valores Atuais - MTM		
Contrato	Data Inicial	Data Operação	Vencimento	Valor Base - Moeda Estrangeira	Operação	Moeda	Taxa Termo	Cotação	Cotação Inicial	Cliente R\$	Banco R\$	Ajuste R\$	Cliente R\$	Banco R\$	Ajuste R\$
20A00868985	17/01/2020	17/01/2020	01/12/2021	1.000.000,00	Venda	DOLAR USA	4,37900	D-1	4,18820	4.300.102,80	5.460.000,00	-1.159.897,20	4.264.641,97	5.539.520,86	-1.274.878,89
20A00898758	22/01/2020	22/01/2020	01/12/2021	1.000.000,00	Venda	DOLAR USA	4,37200	D-1	4,18920	4.295.968,39	5.460.000,00	-1.164.031,61	4.257.824,78	5.539.520,86	-1.281.696,08
20B00754395	07/02/2020	07/02/2020	03/01/2022	3.400.000,00	Venda	DOLAR USA	4,50000	D-1	4,28870	14.972.734,56	18.564.000,00	-3.591.265,44	14.827.866,47	18.814.011,33	-3.986.144,86
20B00754397	07/02/2020	07/02/2020	03/01/2022	6.000.000,00	Venda	DOLAR USA	4,51550	D-1	4,30500	26.517.715,01	32.760.000,00	-6.242.284,99	26.256.953,35	33.201.196,46	-6.944.243,11
20B00754410	07/02/2020	07/02/2020	03/01/2022	1.400.000,00	Venda	DOLAR USA	4,52700	D-1	4,31500	6.202.602,07	7.644.000,00	-1.441.397,93	6.142.225,62	7.746.945,84	-1.604.720,22
20B00778963	11/02/2020	11/02/2020	03/01/2022	2.500.000,00	Venda	DOLAR USA	4,51280	D-1	4,30980	11.049.981,20	13.650.000,00	-2.600.018,80	10.933.855,52	13.833.831,86	-2.899.976,34
20B00778964	11/02/2020	11/02/2020	03/01/2022	2.500.000,00	Venda	DOLAR USA	4,53600	D-1	4,33270	11.107.649,12	13.650.000,00	-2.542.350,88	10.990.065,73	13.833.831,86	-2.843.766,13
20B00798359	12/02/2020	12/02/2020	03/01/2022	1.550.000,00	Venda	DOLAR USA	4,52300	D-1	4,33160	6.874.837,25	8.463.000,00	-1.588.162,75	6.794.312,55	8.576.975,75	-1.782.663,20
20B00881317	19/02/2020	19/02/2020	03/01/2022	1.500.000,00	Venda	DOLAR USA	4,55550	D-1	4,36730	6.702.685,33	8.190.000,00	-1.487.314,67	6.622.386,83	8.300.299,11	-1.677.912,28
20B00881318	19/02/2020	19/02/2020	03/01/2022	1.800.000,00	Venda	DOLAR USA	4,55650	D-1	4,37130	8.047.548,75	9.828.000,00	-1.780.451,25	7.948.608,65	9.960.358,94	-2.011.750,29
20B00881319	19/02/2020	19/02/2020	03/01/2022	1.100.000,00	Venda	DOLAR USA	4,55550	D-1	4,37140	4.917.412,10	6.006.000,00	-1.088.587,90	4.856.417,01	6.086.886,01	-1.230.469,00
20B00897977	20/02/2020	20/02/2020	03/01/2022	1.700.000,00	Venda	DOLAR USA	4,58600	D-1	4,39560	7.646.170,88	9.282.000,00	-1.635.829,12	7.555.621,73	9.407.005,66	-1.851.383,93
20B00910036	21/02/2020	21/02/2020	03/01/2022	3.200.000,00	Venda	DOLAR USA	4,59150	D-1	4,39700	14.403.629,84	17.472.000,00	-3.068.370,16	14.239.403,69	17.707.304,78	-3.467.901,09
20B00910037	21/02/2020	21/02/2020	03/01/2022	3.000.000,00	Venda	DOLAR USA	4,57300	D-1	4,38200	13.452.825,53	16.380.000,00	-2.927.174,47	13.295.653,60	16.600.598,23	-3.304.944,63
20B00929957	26/02/2020	26/02/2020	01/07/2021	12.400.000,00	Venda	DOLAR USA	4,53800	D-1	4,41500	55.877.988,07	67.704.000,00	-11.826.011,93	55.768.383,06	69.025.097,53	-13.256.714,47
20B00929960	26/02/2020	26/02/2020	02/08/2021	1.952.720,00	Venda	DOLAR USA	4,57500	D-1	4,43650	8.851.456,38	10.661.851,20	-1.810.394,82	8.827.114,13	10.859.023,39	-2.031.909,26
20B00947282	27/02/2020	27/02/2020	03/01/2022	6.867.403,20	Venda	DOLAR USA	4,70250	D-1	4,49050	31.614.148,08	37.496.021,47	-5.881.873,39	31.297.423,49	38.001.000,48	-6.703.576,99
20B00947283	27/02/2020	27/02/2020	03/01/2022	1.700.000,00	Venda	DOLAR USA	4,70150	D-1	4,48740	7.822.575,65	9.282.000,00	-1.459.424,35	7.745.912,69	9.407.005,66	-1.661.092,97
20B00947284	27/02/2020	27/02/2020	03/01/2022	7.682.124,80	Venda	DOLAR USA	4,66750	D-1	4,45880	35.107.765,98	41.944.401,40	-6.836.635,42	34.749.848,89	42.509.289,13	-7.759.440,24
20C00121381	05/03/2020	05/03/2020	03/01/2022	3.500.000,00	Venda	DOLAR USA	4,85100	D-1	4,62650	16.607.523,99	19.110.000,00	-2.502.476,01	16.454.570,64	19.367.364,60	-2.912.793,96
20C00820019	10/03/2020	10/03/2020	01/09/2021	3.000.000,00	Venda	DOLAR USA	4,85450	D-1	4,67080	14.368.490,16	16.380.000,00	-2.011.509,84	14.338.946,79	16.667.429,00	-2.328.482,21
21B00095900	05/02/2021	05/02/2021	01/03/2021	1.000.000,00	Venda	DOLAR USA	5,38650	D-1	5,39100	5.386.821,30	5.460.000,00	-73.178,70	5.386.500,00	5.530.189,26	-143.689,26
21B00117812	08/02/2021	08/02/2021	01/03/2021	1.000.000,00	Compra	DOLAR USA	5,34150	D-1	5,38840	5.460.000,00	5.345.093,15	114.906,85	5.341.500,00	5.152.814,10	188.685,90
21B00137471	09/02/2021	09/02/2021	01/03/2021	1.000.000,00	Venda	DOLAR USA	5,42650	D-1	5,36700	5.421.516,57	5.460.000,00	-38.483,43	5.426.500,00	5.530.192,25	-103.692,25
21B00137472	09/02/2021	09/02/2021	01/03/2021	2.000.000,00	Venda	DOLAR USA	5,37980	D-1	5,36700	10.757.464,33	10.920.000,00	-162.535,67	10.759.600,00	11.060.377,53	-300.777,53
21B00165811	10/02/2021	10/02/2021	01/03/2021	1.000.000,00	Compra	DOLAR USA	5,37030	D-1	5,42160	5.460.000,00	5.374.943,50	85.056,50	5.370.300,00	5.210.411,95	159.888,05
21B00633096	19/02/2021	19/02/2021	01/04/2021	2.200.000,00	Compra	DOLAR USA	5,39850	D-1	5,42380	12.012.000,00	11.922.744,87	89.255,13	12.277.130,27	11.852.995,29	424.134,98
TOTAL				76.952.248,00						355.239.613,34	419.870.055,59	-64.630.442,25	352.729.567,46	425.321.477,72	-72.591.910,26

Observação:

As taxas utilizadas na apuração do MTM são indicativas do mercado na data de referência.