

NDF - Extrato de Operações em Aberto



CLIENTE: COPERSUCAR S/A

CONTRAPARTE: BANCO CITIBANK S.A.

CNPJ: 10.265.949/0001-77

DATA BASE: 30/06/2020

Número da Operação	Data de Início	Data de Vencimento	Montante do Contrato	Tipo da Operação	Ativo Objeto	Paridade Inicial Contratada	Paridade Futura Contratada	Valor na Curva (BRL)	Paridade Futura a Mercado	Valor a Mercado (BRL)
41064898001	26/06/2020	01/07/2020	USD 100.000.000,00	Compra	R\$/USD	5,4500000000	5,4503000000	-863.999,87	5,4331000000	2.569.783,06
41064899001	26/06/2020	03/08/2020	USD 100.000.000,00	Vende	R\$/USD	5,4500000000	5,4551000000	893.661,75	5,4400350000	1.503.453,85
							Total	29.661,88		4.073.236,91

Qualquer divergência com relação ao presente deve ser comunicada o mais breve possível ao Citiservice.

São Paulo 2109-2484 - Outras localidades DDG 0800 709 2484.

Se a data-base deste extrato for o último dia útil do mês e o último dia corrido do mês recair em um dia não útil, então, os valores apropriados serão corrigidos até o último dia corrido do mês, enquanto os valores de mercado serão calculados até o último dia útil do mês.

Os valores acima informados representam estimativas do ponto médio de mercado, apurados com base em modelos e cotações disponíveis no mercado ou proprietários, que levam em conta condições de mercado presentes ou futuras, sendo valores brutos, anteriores à incidência de impostos, e pressupondo resgates ou liquidações apenas nos vencimentos originais das transações. Em função da variação das taxas de mercado, esses valores poderão sofrer alteração até o vencimento ou liquidação antecipada das transações, e serão tributados no momento da efetiva liquidação, respeitando-se a legislação em vigor. As avaliações baseadas em outros modelos ou pressupostos, que não os utilizados pelo Citibank, ou calculadas para outra data e hora podem gerar resultados significativamente diferentes. No caso de liquidações antecipadas por mútuo acordo das partes, os valores ora indicados serão recalculados, conforme previsão contratual específica.

Os valores são fornecidos exclusivamente para propósitos informativos, sem custos ao cliente, não valendo como comprovante de ativos perante terceiros.

Nós expressamente isentamos-nos de qualquer responsabilidade por (i) precisão dos modelos, informações de dados de mercado nos referidos modelos ou estimativas usadas para gerar as avaliações; (ii) quaisquer erros ou omissões em computar ou disseminar as avaliações; e (iii) quaisquer usos que sejam feitos com as avaliações. Devido à dimensão variada de spreads de oferta de compra, a avaliação do mercado médio pode ser significativamente maior (ou menor) do que os níveis em que novas transações poderiam ser efetuadas. Essas avaliações podem levar em conta fatores tais como a extensão de tempo decorrido desde que a transação foi iniciada, redução potencial para nós de mercado e outros riscos que possam ser realizáveis através de um desembaraço, e outras considerações de preços de produtos relevantes para a transação específica, que possam levar-nos a prever o lucro total potencialmente realizável se a transação ocorrer a termo total. Correspondentemente, essas transações podem ser avaliadas em níveis mais atrativos para você do que nós cotaríamos a outros ou do que estaria disponível em outros negociantes. Adicionalmente, essas avaliações não representam (i) os preços reais pelos quais novas transações poderiam ser efetuadas; (ii) os preços reais pelos quais a transação existente poderia ser liquidada ou revertida, ou (iii) uma estimativa de um valor que seria pagável após a data de término antecipada de qualquer transação. Essas avaliações podem diferir dos preços que usamos para avaliar nossas posições em nossos registros ou para fins de resgate de cauções.

* Para fins de apropriação do accrual mensal, as operações de NDF fechadas a partir de 03/05/2007 apresentam a taxa PREFIXADA na base exponencial 360.

Legenda - Tipo de Taxas ==> E = Exponencial ao ano 360 dias corridos - L = Linear ao ano - M = Linear ao mês - U = Exponencial ao ano 252 dias úteis