



CHINA CONSTRUCTION BANK (BRASIL) BANCO MULTIPLO SA

SISTEMA SWAP

POSIÇÃO DE TÍTULOS EM 29/05/2020

MTM VISÃO BANCO

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	27/04/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,6190	5.340.500,00	5.619.000,00	-278.500,00	5.425.684,46	5.618.362,60	-192.678,14
Compra Termo Moeda	29/04/2020	01/06/2020	2.000.000,00	5,3951	10.681.000,00	10.790.200,00	-109.200,00	10.851.368,93	10.788.976,00	62.392,93
Venda Termo Moeda	07/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,8095	5.809.500,00	5.340.500,00	469.000,00	5.808.840,99	5.425.684,46	383.156,53
Compra Termo Moeda	07/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,8090	5.340.500,00	5.809.000,00	-468.500,00	5.425.684,46	5.808.341,05	-382.656,59
Compra Termo Moeda	05/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,5380	5.340.500,00	5.538.000,00	-197.500,00	5.425.684,46	5.537.371,79	-111.687,33
Compra Termo Moeda	06/05/2020	01/06/2020	2.000.000,00	5,6810	10.681.000,00	11.362.000,00	-681.000,00	10.851.368,93	11.360.711,14	-509.342,21
Compra Termo Moeda	11/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,8304	5.340.500,00	5.830.400,00	-489.900,00	5.425.684,46	5.829.738,62	-404.054,16
Compra Termo Moeda	13/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,9210	5.340.500,00	5.921.000,00	-580.500,00	5.425.684,46	5.920.328,35	-494.643,89
Venda Termo Moeda	14/05/2020	01/06/2020	2.000.000,00	5,9455	11.891.000,00	10.681.000,00	1.210.000,00	11.889.651,13	10.851.368,93	1.038.282,20
Venda Termo Moeda	14/05/2020	01/06/2020	2.000.000,00	5,8600	11.720.000,00	10.681.000,00	1.039.000,00	11.718.670,53	10.851.368,93	867.301,60
Venda Termo Moeda	15/05/2020	01/06/2020	200.000,00	5,7830	1.156.600,00	1.068.100,00	88.500,00	1.156.468,80	1.085.136,89	71.331,91
Venda Termo Moeda	19/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,7060	5.706.000,00	5.340.500,00	365.500,00	5.705.352,74	5.425.684,46	279.668,28
Compra Termo Moeda	19/05/2020	01/06/2020	1.000.000,00	5,7535	5.340.500,00	5.753.500,00	-413.000,00	5.425.684,46	5.752.847,35	-327.162,89
Venda Termo Moeda	21/05/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,5990	11.198.000,00	10.681.000,00	517.000,00	11.172.555,02	10.746.325,74	426.229,28
Venda Termo Moeda	21/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,5930	5.593.000,00	5.340.500,00	252.500,00	5.580.291,14	5.373.162,87	207.128,27
Compra Termo Moeda	26/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3895	5.340.500,00	5.389.500,00	-49.000,00	5.373.162,87	5.377.253,55	-4.090,68
Venda Termo Moeda	26/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3645	5.364.500,00	5.340.500,00	24.000,00	5.352.310,36	5.373.162,87	-20.852,51
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3520	5.352.000,00	5.340.500,00	11.500,00	5.339.838,76	5.373.162,87	-33.324,11
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3000	5.300.000,00	5.340.500,00	-40.500,00	5.287.956,92	5.373.162,87	-85.205,95
Venda Termo Moeda	27/05/2020	01/07/2020	2.000.000,00	5,3215	10.643.000,00	10.681.000,00	-38.000,00	10.618.816,14	10.746.325,74	-127.509,60
Compra Termo Moeda	28/05/2020	01/07/2020	1.000.000,00	5,3340	5.340.500,00	5.334.000,00	6.500,00	5.373.162,87	5.321.879,66	51.283,21