

Demonstrativo da Carteira de Ativos
(Valores em Milhares de Reais)
2ª Emissão de Letras Imobiliárias Garantidas do Itaú Unibanco S.A.

Tabela 1: Dados Individuais

Ativos/Letras Imobiliárias Garantidas (LIG)	30/09/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	291.155	300.382	
1.1. Montante Elegível	291.155	300.382	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	291.155	300.382	
Residencial	277.852	286.669	
Não Residencial	13.303	13.713	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	1.811	1.640	-
Notas do Tesouro Nacional	1.811	1.640	-
NTN-B	1.811	1.640	-
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	292.966	302.022	
6 Reserva de Liquidez	-	-	-
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	292.966	302.022	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	220.620	221.664	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	29	25	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	30/09/2020
	Resultado (%)
10 Composição	99,4%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	132,8%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	136,2%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	30/09/2020
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	22,93
13 Das LIGs em Circulação	19,07

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	30/09/2020
	Valor
14 Ativos Líquidos	1.811
15 Necessidade de Liquidez	-

São Paulo, 30 de outubro de 2020

Local e Data

Diretor Responsável Pela Operação De Emissão de LIG

Profissional de Contabilidade
Arnaldo Alves dos Santos
CRC: 1 SP - 210.058/O-3 CPF: 143.170.828-37