

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)	30/04/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	452.252	461.168	
1.1. Montante Elegível	452.252	461.168	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	452.252	461.168	
Residencial	442.605	451.367	
Não Residencial	9.646	9.802	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	44.177	35.363	43.457
Notas do Tesouro Nacional	44.177	35.363	43.457
NTN-B	44.177	35.363	43.457
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	496.429	496.532	
6 Reserva de Liquidez	-	-	-
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	496.429	496.532	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	302.657	304.445	
----	-	-	-
9 Remuneração do Agente Fiduciário	70	41	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	30/04/2020
	Resultado (%)
10 Composição	91,1%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	164,0%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	163,1%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	30/04/2020
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	36,18
13 Das LIGs em Circulação	24,17

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	30/04/2020
	Valor
14 Ativos Líquidos	44.177
15 Necessidade de Liquidez	-

São Paulo, 29 de maio de 2020

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