

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)	31/12/2019		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	334.773	345.556	
1.1. Montante Elegível	334.773	345.556	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	334.773	345.556	
Residencial	334.773	345.556	
Não Residencial	-	-	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	77.733	65.284	90.306
Notas do Tesouro Nacional	77.733	65.284	90.306
NTN-B	77.733	65.284	90.306
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	412.506	410.840	
6 Reserva de Liquidez	-	-	
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	412.506	410.840	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	363.270	362.664	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	40	34	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/12/2019
	Resultado (%)
10 Composição	81,2%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	113,5%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	113,3%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/12/2019
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	54,6 meses
13 Das LIGs em Circulação	28,2 meses

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/12/2019
	Valor
14 Ativos Líquidos	77.733
15 Necessidade de Liquidez	-

Diretor Responsável Pela Operação De Emissão de LIG

São Paulo, 30 de janeiro de 2020
Local e Data

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