

Demonstrativo da Carteira de Ativos
(Valores em Milhares de Reais)
1ª Emissão de Letras Imobiliárias Garantidas do Itaú Unibanco S.A.

Tabela 1: Dados Individuais

Ativos/Letras Imobiliárias Garantidas (LIG)	31/01/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	838.307	847.038	
1.1. Montante Elegível	838.307	847.038	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	838.307	847.038	
Residencial	774.029	782.511	
Não Residencial	64.278	64.526	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	140.708	186.919	153.728
Notas do Tesouro Nacional	140.708	186.919	153.728
NTN-B	140.708	186.919	153.728
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	979.015	1.033.957	
6 Reserva de Liquidez	-	-	-
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	979.015	1.033.957	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	743.427	747.694	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	108	86	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/01/2020 ⁽¹⁾
	Resultado (%)
10 Composição	85,6%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	131,7%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	138,3%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/01/2020 ⁽¹⁾
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	28,10
13 Das LIGs em Circulação	22,80

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/01/2020 ⁽¹⁾
	Valor
14 Ativos Líquidos	140.708
15 Necessidade de Liquidez	-

⁽¹⁾ Os dados acima já refletem as alterações realizadas até o 7º dia útil do mês de Fevereiro de 2020, conforme Resolução 4.598 de 2017, para atendimento ao requisito de composição que teve sua apuração recalculada de 79,8% para 85,6%.

Diretor Responsável Pela Operação De Emissão de LIG

São Paulo, 28 de fevereiro de 2020
Local e Data

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