

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)	31/07/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	330.778	341.798	
1.1. Montante Elegível	330.778	341.798	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	330.778	341.798	
Residencial	319.308	329.856	
Não Residencial	11.470	11.943	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	5.362	4.738	6.057
Notas do Tesouro Nacional	5.362	4.738	6.057
NTN-B	5.362	4.738	6.057
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	336.140	346.536	
6 Reserva de Liquidez	-	-	-
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	336.140	346.536	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	231.581	232.797	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	32	29	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/07/2020
	Resultado (%)
10 Composição	98,4%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	145,1%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	148,8%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/07/2020
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	27,19
13 Das LIGs em Circulação	22,13

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/07/2020
	Valor
14 Ativos Líquidos	5.362
15 Necessidade de Liquidez	-

São Paulo, 28 de agosto de 2020
Local e Data

Diretor Responsável Pela Operação De Emissão de LIG

Profissional de Contabilidade
Rodrigo Andrade de Moraes
CRC: 1 SP - 220.814/O-6 CPF: 261.282.248-81