

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)	31/01/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	358.312	363.980	
1.1. Montante Elegível	358.312	363.980	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	358.312	363.980	
Residencial	358.312	363.980	
Não Residencial	-	-	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	78.652	68.071	89.661
Notas do Tesouro Nacional	78.652	68.071	89.661
NTN-B	78.652	68.071	89.661
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	436.964	432.051	
6 Reserva de Liquidez	-	-	-
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	436.964	432.051	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	364.584	367.012	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	40	36	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/01/2020
	Resultado (%)
10 Composição	82,0%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	119,8%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	117,7%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/01/2020
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	52,60
13 Das LIGs em Circulação	27,20

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/01/2020
	Valor
14 Ativos Líquidos	78.652
15 Necessidade de Liquidez	-

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