

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)	31/03/2020		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	383.789	391.693	
1.1. Montante Elegível	383.789	391.693	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	383.789	391.693	
Residencial	375.649	383.324	
Não Residencial	8.140	8.369	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	-	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	44.177	35.452	42.123
Notas do Tesouro Nacional	44.177	35.452	42.123
NTN-B	44.177	35.452	42.123
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	427.966	427.144	
6 Reserva de Liquidez	-	-	
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	427.966	427.144	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	366.809	366.167	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	68	36	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/03/2020
	Resultado (%)
10 Composição	89,7%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	116,7%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	116,6%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/03/2020
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	40,90
13 Das LIGs em Circulação	25,17

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/03/2020
	Valor
14 Ativos Líquidos	44.177
15 Necessidade de Liquidez	-

São Paulo, 30 de abril de 2020
Local e Data

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