

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)	31/10/2019		
	Valor Nominal	Valor Presente sob Estresse	Valor para Negociação
1 Créditos Imobiliários	305.747	315.754	
1.1. Montante Elegível	303.301	315.754	
Aquisição	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Construção	-	-	
Residencial	-	-	
Não Residencial	-	-	
Produção	303.301	315.754	
Residencial	303.301	315.754	
Não Residencial	-	-	
Empréstimos com Garantia de Bens Imóveis Residenciais	-	-	
1.2. Montante Inelegível	2.446	-	
2 Títulos Públicos - Brasil	75.698	65.775	91.527
Notas do Tesouro Nacional	75.698	65.775	91.527
NTN-B	75.698	65.775	91.527
----	-	-	-
3 Instrumentos Financeiros Derivativos	-	-	
4 Disponibilidades	-	-	
5 Total da Carteira de Ativos	381.445	381.529	
6 Reserva de Liquidez	-	-	
7 Total da Carteira de Ativos ajustada para a Verificação dos Requisitos	378.999	381.529	
8 Obrigações por Emissão de LIGs	360.645	359.980	
----	-	-	
9 Remuneração do Agente Fiduciário	38	32	

Tabela 2: Verificação dos Requisitos de Composição e Suficiência

Requisitos de Composição e Suficiência	31/10/2019
	Resultado (%)
10 Composição	80,0%
11 Suficiência	
11.1. Nominal	105,1%
11.2. Valor Presente Sob Estresse	106,0%

Tabela 3: Verificação do Requisito de Prazo

Prazo Médio Ponderado	31/10/2019
	Resultado (Meses)
12 Da Carteira de Ativos	57,1 meses
13 Das LIGs em Circulação	30,2 meses

Tabela 4: Verificação do Requisito de Liquidez

Requisitos de Liquidez	31/10/2019
	Valor
14 Ativos Líquidos	75.698
15 Necessidade de Liquidez	-

São Paulo, 30 de novembro de 2019
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