

DEMONSTRATIVO DA CARTEIRA DE ATIVOS (DCA)
Posição em: 31/07/2021

Programa de Emissão de LIG: 1º PROGRAMA DE EMISSÃO DE LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS DO BANCO

Tabela 1: Dados individuais e consolidados (em R\$ mil)

ATIVOS/LIGs	VALOR NOMINAL	VALOR PRESENTE SOB ESTRESSE	VALOR PARA NEGOCIAÇÃO
1. CRÉDITOS IMOBILIÁRIOS (valor contábil, líquido de provisão para perdas, observado o art. 9º da Res. 2.682/1999 e arts. 19, I, e 20, I, II, III e IV, da Res. 4.598/2017)	1.410.256,94	1.322.480,04	
1.1 Montante Elegível (arts. 20 e 24 da Res. 4.598/2017)	1.410.256,94	1.322.480,04	
1.1.1 Aquisição	1.410.256,94	1.322.480,04	
1.1.1.1 Residencial	1.410.256,94	1.322.480,04	
1.1.1.2 Não Residencial	-	-	
1.1.2 Construção	-	-	
1.1.2.1 Residencial	-	-	
1.1.2.2 Não Residencial	-	-	
1.1.3 Produção	-	-	
1.1.3.1 Residencial	-	-	
1.1.3.2 Não Residencial	-	-	
1.1.4 Home Equity	-	-	
1.2 Montante Inelegível (arts. 20 e 24 da Res. 4.598/2017)			
2. TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOUREIRO NACIONAL (art. 19, II, da Res. 4.598/2017)	-	-	-
2.1 LFT	-	-	-
2.2 NTN	-	-	-
2.2.1 NTN – A	-	-	-
2.2.2 NTN – B	-	-	-
2.2.3 NTN – C	-	-	-
2.3 LTN	-	-	-
3. INSTRUMENTOS DERIVATIVOS (art. 19, III, da Res. 4.598/2017)	-	-	
4. DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (art. 19, IV, da Res. 4.598/2017)	-		
5. TOTAL DA CARTEIRA DE ATIVOS (1+2+3+4)	1.410.256,94	1.322.480,04	
6. RESERVA DE LIQUIDEZ (art. 44 da Res. 4.598/2017)	-	-	-
7. TOTAL DA CARTEIRA DE ATIVOS AJUSTADA PARA A VERIFICAÇÃO DOS REQUISITOS (5-6-1.2)	1.410.256,94	1.322.480,04	

8. OBRIGAÇÕES DE LIG EM CIRCULAÇÃO	907.361,30	905.476,54
8.1 Série 1	-	-
8.2 Série 2	9.984,41	9.975,92
8.3 Série 3	-	-
8.4 Série 4	5.531,84	5.525,43
8.5 Série 5	6.638,21	6.630,51
8.6 Série 6	5.531,84	5.525,43
8.7 Série 7	7.885,72	7.878,41
8.8 Série 8	11.075,46	11.065,19
8.9 Série 9	-	-
8.10 Série 10	-	-
8.11 Série 11	11.075,46	11.065,19
8.12 Série 12	5.537,73	5.532,59
8.13 Série 13	5.537,73	5.532,59
8.14 Série 14	5.537,73	5.532,59
8.15 Série 15	5.537,73	5.532,59
8.16 Série 16	38.764,09	38.728,15
8.17 Série 17	5.537,73	5.532,59
8.18 Série 18	11.075,46	11.065,19
8.19 Série 19	11.087,24	11.079,53
8.20 Série 20	5.537,73	5.532,59
8.21 Série 21	55.414,97	55.386,25
8.22 Série 22	-	-
8.23 Série 23	27.487,42	27.457,19
8.24 Série 24	-	-
8.25 Série 25	10.947,81	10.933,88
8.26 Série 26	-	-
8.27 Série 27	10.904,05	10.883,48
8.28 Série 28	10.916,74	10.899,27
8.29 Série 29	-	-
8.30 Série 30	10.906,07	10.890,17
8.31 Série 31	54.552,78	54.499,35
8.32 Série 55	5.242,11	5.231,24
8.32 Série 56	0,16	0,16
8.33 Série 57	3.264,70	3.257,03
8.34 Série 58	1.087,06	1.084,79
8.35 Série 59	-	-
8.36 Série 60	10.877,46	10.860,42
8.37 Série 61	6.643,66	6.629,79
8.38 Série 62	2.173,61	2.169,07
8.39 Série 63	1.087,49	1.085,77
8.40 Série 64	1.629,82	1.626,39
8.41 Série 65	-	-
8.42 Série 66	3.258,87	3.251,88
8.43 Série 67	3.530,44	3.522,87
8.44 Série 68	3.261,68	3.256,43
8.45 Série 70	6.516,20	6.502,12
8.46 Série 72	-	-
8.47 Série 73	-	-
8.48 Série 74	2.635,89	2.631,62
8.49 Série 75	-	-
8.50 Série 76	-	-
8.51 Série 77	1.628,66	1.625,15
8.52 Série 78	-	-
8.53 Série 79	1.301,82	1.298,30
8.54 Série 80	7.170,56	7.158,94

62

8.55 Série 81	1.085,52	1.083,18
8.56 Série 82	1.086,45	1.084,69
8.57 Série 83	-	-
8.58 Série 84	-	-
8.59 Série 85	-	-
8.60 Série 86	542,38	541,16
8.61 Série 87	1.175,96	1.172,67
8.62 Série 88	-	-
8.63 Série 89	-	-
8.64 Série 90	5.393,79	5.384,75
8.65 Série 91	-	-
8.66 Série 92	-	-
8.67 Série 93	-	-
8.68 Série 94	1.627,13	1.623,49
8.69 Série 95	2.932,08	2.925,53
8.70 Série 96	3.253,48	3.246,21
8.71 Série 97	892,20	889,71
8.72 Série 98	1.126,92	1.123,78
8.73 Série 99	3.253,48	3.246,21
8.74 Série 100	4.337,98	4.328,28
8.75 Série 101	1.083,32	1.080,30
8.76 Série 104	-	-
8.77 Série 105	1.083,73	1.081,24
8.78 Série 106	2.169,27	2.165,53
8.79 Série 107	3.243,90	3.234,36
8.80 Série 108	2.164,38	2.159,29
8.81 Série 109	2.164,38	2.159,29
8.82 Série 110	6.493,14	6.477,86
8.83 Série 111	-	-
8.84 Série 112	2.166,16	2.162,34
8.85 Série 113	1.423,08	1.419,73
8.86 Série 114	541,09	539,82
8.87 Série 116	28.139,93	28.089,00
8.88 Série 117	-	-
8.89 Série 118	66,61	-
8.90 Série 119	5.399,45	5.385,97
8.91 Série 120	4.319,56	4.308,77
8.92 Série 121	5.399,45	5.385,97
8.93 Série 122	1.080,76	1.078,73
8.94 Série 123	-	-
8.95 Série 124	1.619,84	1.615,79
8.96 Série 125	-	-
8.97 Série 126	1.305,59	1.302,33
8.98 Série 127	2.548,54	2.542,18
8.99 Série 128	-	-
8.100 Série 129	-	-
8.101 Série 130	3.714,82	3.705,54
8.102 Série 131	1.783,98	1.779,52
8.103 Série 132	2.065,83	2.060,67
8.104 Série 133	-	-
8.105 Série 134	-	-
8.106 Série 135	-	-
8.107 Série 136	-	-
8.108 Série 137	-	-
8.109 Série 138	10.802,39	10.781,92
8.110 Série 139	1.619,07	1.614,98

8.111 Série 140	2.157,23	2.151,69
8.102 Série 141	4.314,46	4.303,38
8.103 Série 142	1.079,47	1.077,39
8.104 Série 143	4.317,86	4.309,54
8.105 Série 144	1.941,51	1.936,52
8.106 Série 145	5.233,44	5.220,00
8.107 Série 146	539,31	537,92
8.108 Série 148	2.693,35	2.686,25
8.109 Série 149	2.154,68	2.149,00
8.110 Série 150	1.669,23	1.664,28
8.111 Série 151	4.309,37	4.297,99
8.112 Série 152	-	-
8.113 Série 153	-	-
8.114 Série 154	4.952,26	4.938,91
8.115 Série 155	2.149,60	2.143,61
8.116 Série 156	1.075,61	1.073,36
8.117 Série 157	537,80	536,68
8.118 Série 158	1.368,22	1.364,41
8.119 Série 159	16.134,09	16.100,39
8.120 Série 160	2.348,43	2.341,89
8.121 Série 161	-	-
8.122 Série 162	1.612,20	1.607,71
8.123 Série 163	-	-
8.124 Série 164	4.514,15	4.501,58
8.125 Série 165	5.373,99	5.359,03
8.126 Série 166	2.235,58	2.229,36
8.127 Série 167	6.448,79	6.430,83
8.128 Série 168	4.299,19	4.287,22
8.129 Série 169	-	-
8.130 Série 170	1.074,29	1.071,28
8.131 Série 171	1.075,09	1.072,83
8.132 Série 172	1.786,35	1.781,24
8.133 Série 173	6.445,94	6.432,10
8.134 Série 174	1.127,21	1.123,98
8.135 Série 175	1.072,74	1.068,90
8.136 Série 176	5.371,61	5.360,08
8.137 Série 177	1.610,29	1.605,68
8.138 Série 178	3.220,59	3.211,37
8.139 Série 179	-	-
8.140 Série 180	1.381,63	1.377,68
8.141 Série 18.1	3.232,52	3.224,42
8.142 Série 182	8.578,09	8.553,01
8.143 Série 183	-	-
8.144 Série 184	-	-
8.145 Série 185	11.266,93	11.242,21
8.146 Série 186	5.365,20	5.353,43
8.147 Série 187	3.219,12	3.212,06
8.148 Série 188	10.730,41	10.706,87
8.149 Série 189	6.438,25	6.424,12
8.150 Série 190	10.730,41	10.706,87
8.151 Série 191	5.901,73	5.888,78
8.152 Série 192	6.433,57	6.414,76
8.153 Série 193	9.657,37	9.636,18
8.154 Série 194	2.165,97	2.159,63
8.155 Série 195	1.080,84	1.077,68
8.156 Série 196	5.361,31	5.345,63

8.157 Série 197	2.146,08	2.141,37	
8.158 Série 198	3.648,34	3.640,33	
8.159 Série 199	1.286,71	1.282,95	
8.160 Série 200	1.179,49	1.176,04	
8.161 Série 201	1.895,76	1.890,21	
8.162 Série 202	16.095,61	16.060,30	
8.163 Série 204	3.213,74	3.204,10	
8.164 Série 205	1.128,02	1.124,64	
8.165 Série 206	1.072,02	1.069,60	
8.166 Série 207	3.535,12	3.524,51	
8.167 Série 208	-	-	
8.168 Série 209	1.069,98	1.066,69	
8.169 Série 210	3.209,95	3.200,07	
8.170 Série 211	534,99	533,34	
8.171 Série 212	4.703,65	4.689,17	
8.172 Série 213	4.795,66	4.780,90	
8.173 Série 214	-	-	
8.174 Série 215	-	-	
8.175 Série 216	3.204,64	3.194,49	
8.176 Série 217	3.848,22	3.839,07	
8.177 Série 218	1.068,58	1.065,62	
8.178 Série 219	-	-	
8.179 Série 220	2.133,46	2.124,86	
8.180 Série 221	3.202,37	3.192,04	
8.181 Série 222	2.136,37	2.131,19	
8.182 Série 223	1.068,18	1.065,60	
8.183 Série 224	-	-	
8.184 Série 225	-	-	
8.185 Série 226	2.132,39	2.125,35	
8.186 Série 227	-	-	
8.187 Série 228	1.065,49	1.061,09	
8.188 Série 229	-	-	
8.189 Série 230	6.405,71	6.384,56	
8.190 Série 231	1.065,64	1.062,94	
8.191 Série 232	1.064,24	1.059,75	
8.192 Série 233	-	-	
8.193 Série 234	4.259,75	4.245,37	
8.194 Série 235	2.354,58	2.346,63	
8.195 Série 236	-	-	
8.196 Série 237	1.594,61	1.587,73	
8.197 Série 238	3.191,27	3.180,25	
8.198 Série 239	531,88	530,04	
8.199 Série 240	2.128,88	2.123,37	
8.200 Série 241	-	-	
8.201 Série 242	1.062,60	1.058,85	
8.202 Série 243	1.410,06	1.405,09	
8.203 Série 244	2.655,24	2.648,06	
8.204 Série 245	1.060,78	1.056,00	
8.205 Série 246	1.061,44	1.057,61	
8.206 Série 247	1.059,63	1.054,77	
8.207 Série 248	7.106,03	7.083,17	
8.208 Série 249	1.060,28	1.056,38	
8.209 Série 250	-	-	
8.210 Série 251	23.314,60	23.248,99	
8.211 Série 253	-	-	
8.212 Série 254	-	-	

8.213 Série 255	-	-
8.214 Série 256	-	-
8.215 Série 257	1.057,96	1.053,93
8.216 Série 258	1.058,28	1.054,75
8.217 Série 259	3.788,66	3.773,89
8.218 Série 260	1.373,85	1.368,50
8.219 Série 261	5.281,65	5.265,96
8.220 Série 262	1.582,01	1.575,63
8.221 Série 263	1.054,68	1.050,42
8.222 Série 264	-	-
8.223 Série 265	-	-
8.224 Série 266	23.209,30	23.127,37
8.225 Série 267	4.064,72	4.048,33
8.226 Série 268	2.634,05	2.623,19
8.227 Série 269	6.521,07	6.496,84
8.228 Série 270	1.051,51	1.047,05
8.229 Série 271	3.655,05	3.639,53
8.230 Série 272	1.050,46	1.045,90
8.231 Série 273	1.830,95	1.823,04
8.232 Série 274	1.050,46	1.045,92
8.233 Série 275	3.085,48	3.071,96
8.234 Série 276	-	-
8.235 Série 277	-	-
8.236 Série 278	-	-
8.237 Série 279	1.040,10	1.034,68
8.237 Série 281	-	-
9. REMUNERAÇÃO DO AGENTE FIDUCIÁRIO (arts. 27 e 61 da Res. 4.598/2017)	70,81	66,18

Tabela 2: Verificação dos requisitos de composição e suficiência

REQUISITOS	RESULTADO (%)
10. COMPOSIÇÃO (art. 25 da Res. 4.598/2017)	100,00%
11. SUFICIÊNCIA	
11.1 Nominal (art. 28, I, da Res. 4.598/2017)	155,41%
11.2 Valor Presente sob Estresse (art. 28, II, da Res. 4.598/2017)	146,04%

Tabela 3: Verificação do requisito de prazo

PRAZO MÉDIO PONDERADO	RESULTADO (MESES)
12. DA CARTEIRA DE ATIVOS (art. 31 da Res. 4.598/2017)	293
13. DAS LIGs EM CIRCULAÇÃO (art. 7º, parágrafo único, da Res. 4.598/2017)	9

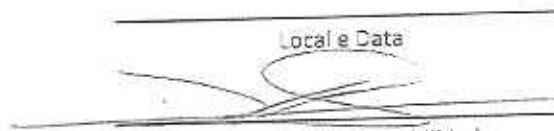
Tabela 4: Verificação do requisito de liquidez (R\$ mil)

COMPONENTES	VALOR
14. ATIVOS LÍQUIDOS (art. 32 da Res. 4.598/2017)	234.896,65
15. NECESSIDADE DE LIQUIDEZ (art. 33 da Res. 4.598/2017)	234.778,48

São Paulo, 31 de julho de 2021



Diretor responsável pela operação de
emissão de LIG
Vitor Ohtsuki



Local e Data
Profissional de Contabilidade
Diego Santos Almeida
CPF: 345.995.398-56
CRC: 1SP316054/O-4