

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Situación Financiera
Al 31 de Diciembre de 2021 y 2020
(En miles de soles)

| | 2021 | 2020 | | 2021 | 2020 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|---------|
| ACTIVO | | | PASIVO | | |
| DISPONIBLE | 277,292 | 262,913 | ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS | 119,617 | 108,644 |
| Banco Central de Reserva del Perú | 275,477 | 262,353 | DERIVADOS PARA NEGOCIACION | 22,207 | 787 |
| Bancos y otras empresas del sistema financiero del país | 1,748 | 539 | CUENTAS POR PAGAR | 46,756 | 101,156 |
| Bancos y otras instituciones financieras del exterior | 67 | 21 | OTROS PASIVOS | 22 | 2,547 |
| FONDOS INTERBANCARIOS | - | - | TOTAL DEL PASIVO | 188,602 | 213,134 |
| INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS | 20,940 | 71,922 | PATRIMONIO | | |
| Instrumentos de Deuda | 20,940 | 71,922 | Capital social | 83,400 | 83,400 |
| DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN | 17,820 | 697 | Reservas | 52,303 | 24,109 |
| CUENTAS POR COBRAR | 4,616 | 2,332 | Resultado Neto del Ejercicio | 28,346 | 28,194 |
| INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO) | 485 | 999 | TOTAL DEL PATRIMONIO | 164,049 | 135,703 |
| ACTIVO INTANGIBLE | 42 | 135.00 | TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO | 352,651 | 348,837 |
| IMPUESTOS CORRIENTES | 27,845 | 2,428 | RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES | 2,136,695 | 417,324 |
| IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO | 3,558 | 2,879 | | | |
| OTROS ACTIVOS | 53 | 4,532 | | | |
| TOTAL DEL ACTIVO | 352,651 | 348,837 | | | |
| RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES | 2,136,695 | 417,324 | | | |
| Estado de Resultados y Otro Resultado Integral Al 31 de Diciembre de 2021 (En miles de soles) | | | Contratos de Financiamiento con Garantía de Cartera Crediticia RESOLUCION SBS N° 1027-2001 ART°5 Al 31 de Diciembre de 2021 (En miles de soles) | | |
| | 2021 | 2020 | | 2021 | 2020 |
| RESULTADO NETO DEL EJERCICIO | 28,346 | 28,194 | Contraparte | - | - |
| RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO | 28,346 | 28,194 | Monto de Cartera Cedida en Garantía | - | - |

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Resultados
Por el periodo terminado el 31 de Diciembre de 2021 y 2020
(En miles de soles)

| | 2021 | 2020 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|
| INGRESOS POR INTERESES | | |
| Fondos disponibles | 1,562 | 440 |
| Fondos interbancarios | 18 | 164 |
| Inversiones a valor razonable con cambios en resultados | 572 | 2,361 |
| TOTAL INGRESOS POR INTERESES | 2,152 | 2,965 |
| GASTOS POR INTERESES | | |
| Fondos interbancarios | -26 | -18 |
| Adeudos y obligaciones financieras | -288 | -492 |
| Otros | -2 | -3 |
| TOTAL GASTOS POR INTERESES | -316 | -513 |
| MARGEN FINANCIERO BRUTO | 1,836 | 2,452 |
| INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS | 29,446 | 12,010 |
| GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS | -274 | -9 |
| MARGEN FINANCIERO NETO | 31,008 | 14,453 |
| RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF) | 29,467 | 40,563 |
| Inversiones a valor razonable con cambios en resultados | 1,481 | 13,109 |
| Derivados de negociación | 110,892 | 16,620 |
| Utilidad- pérdida en diferencia de cambio | -82,906 | 10,834 |
| MARGEN OPERACIONAL | 60,475 | 55,016 |
| GASTOS DE ADMINISTRACION | | |
| Gastos de Personal y Directorio | -15,578 | -13,283 |
| Gastos por Servicios Recibidos de Terceros | -4,004 | -4,437 |
| Impuestos y Contribuciones | -1,283 | -747 |
| DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES | -806 | -1,411 |
| MARGEN OPERACIONAL NETO | 38,804 | 35,138 |
| Otros ingresos y egresos | -35 | 23 |
| RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA | 38,769 | 35,161 |
| IMPUESTO A LA RENTA | -10,423 | -6,967 |
| RESULTADO NETO DEL EJERCICIO | 28,346 | 28,194 |
| Publicado en cumplimiento a los dispuesto por la Superintendencia de Banca y Seguros y AFP's. DEPARTAMENTO DE CONTABILIDAD | | |

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
REPORTE N° 2 - D
Requerimientos de Patrimonio Efectivo por Riesgos de Crédito, Mercado y Operacional y Calculo del Limite Global
Al 31 de Diciembre 2021 (En miles soles)

| | APR | Total |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|
| (I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito: | | |
| Método Estándar | 28,144 | 2,814 |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito | 28,144 | 2,814 |
| (II) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado: | | |
| Método Estándar | 115,159 | 11,516 |
| Riesgo de Tasa de Interés | 79,324 | 7,932 |
| Riesgo Cambiario | 35,835 | 3,584 |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado | 115,159 | 11,516 |
| (III) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional: | | |
| Método del Indicador Básico | 35,826 | 3,583 |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional | 35,826 | 3,583 |
| (IV) Requerimiento de Patrimonio Efectivo Total: | | 17,913 |
| (V) Patrimonio Efectivo | | Total |
| Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1 | | 112,590 |
| Asignado a cubrir riesgo de crédito | | 2,814 |
| Asignado a cubrir riesgo de mercado | | 106,193 |
| Asignado a cubrir riesgo operacional | | 3,583 |
| Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2 | | 23,113 |
| Asignado a cubrir riesgo de crédito | | 23,113 |
| Total Patrimonio Efectivo de Nivel 3 | | - |
| Total Patrimonio Efectivo | | 135,703 |
| (VI) Ratio de Capital Global (%): | | 75.76% |