

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Situación Financiera
Al 31 de Diciembre de 2022 y 2021
(En miles de soles)

	2022	2021		2022	2021
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE	142,272	277,292	ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS	0	119,617
Banco Central de Reserva del Perú	140,318	275,477			
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	1,744	1,748	DERIVADOS PARA NEGOCIACION	23,309	22,207
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	210	67			
FONDOS INTERBANCARIOS	44,018	0	CUENTAS POR PAGAR	31,494	46,756
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	0	20,940	OTROS PASIVOS	0	22
Instrumentos de Deuda	0	20,940			
DERIVADOS PARA NEGOCIACION	11,671	17,820	TOTAL DEL PASIVO	54,803	188,602
CUENTAS POR COBRAR	33,389	4,616			
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	517	485	PATRIMONIO		
ACTIVO INTANGIBLE	14	42.00	Capital social	83,400	83,400
IMPUESTOS CORRIENTES	8,566	27,845	Reservas	80,649	52,303
IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO	3,332	3,558	Resultado Neto del Ejercicio	26,934	28,346
OTROS ACTIVOS	2,007	53			
TOTAL DEL ACTIVO	245,786	352,651	TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO	245,786	352,651
RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	1,313,713	2,136,695	RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	1,313,713	2,136,695
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)		
	2022	2021		2022	2021
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	26,934	28,346	Contraparte	-	-
RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO	26,934	28,346	Monto de Cartera Cedida en Garantía	-	-

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Resultados
Por el periodo terminado el 31 de Diciembre de 2022 y 2021
(En miles de soles)

	2022	2021		2022	2021
INGRESOS POR INTERESES			INGRESOS POR INTERESES		
Fondos disponibles	7,670	1,562			
Fondos interbancarios	3,513	16			
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	2,034	572			
TOTAL INGRESOS POR INTERESES	13,217	2,152			
GASTOS POR INTERESES			GASTOS POR INTERESES		
Fondos interbancarios	-15	-26			
Adeudos y obligaciones financieras	-837	-288			
Otros	-64	-2			
TOTAL GASTOS POR INTERESES	-916	-316			
MARGEN FINANCIERO BRUTO	12,301	1,836			
INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	15,058	29,446			
GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	-296	-274			
MARGEN FINANCIERO NETO	27,063	31,008			
RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	29,194	29,467			
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	1,217	1,481			
Derivados de negociación	21,088	110,892			
Utilidad- pérdida en diferencia de cambio	6,889	-82,906			
MARGEN OPERACIONAL	56,257	60,475			
GASTOS DE ADMINISTRACION					
Gastos de Personal y Directorio	-15,476	-15,578			
Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	-4,304	-4,004			
Impuestos y Contribuciones	-1,391	-1,283			
DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES	-125	-806			
MARGEN OPERACIONAL NETO	34,961	38,804			
Otros ingresos y egresos	8	-35			
RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	34,969	38,769			
IMPUESTO A LA RENTA	-8,035	-10,423			
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	26,934	28,346			
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 Límite Global
Al 31 de Diciembre 2022 (En miles soles)

	APR	Total
(I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito:		
Método Estándar	51,525	5,153
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito	51,525	5,153
(II) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado:		
Método Estándar	122,827	12,283
Riesgo de Tasa de Interés	11,839	1,184
Riesgo Cambiario	110,988	11,099
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado	122,827	12,283
(III) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional:		
Método del Indicador Básico	43,588	4,359
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional	43,588	4,359
(IV) Requerimiento de Patrimonio Efectivo Total:		21,794
(V) Patrimonio Efectivo		
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1		112,590
Asignado a cubrir riesgo de crédito		5,153
Asignado a cubrir riesgo de mercado		103,079
Asignado a cubrir riesgo operacional		4,359
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2		51,459
Asignado a cubrir riesgo de crédito		51,459
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 3		-
Total Patrimonio Efectivo		164,049
(VI) Ratio de Capital Global (%):		75.27%