

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Situación Financiera
Al 31 de Diciembre de 2023 y 2022
(En miles de soles)

ACTIVO	2023	2022	PASIVO	2023	2022
DISPONIBLE	3,779	142,272	DERIVADOS PARA NEGOCIACION	68,643	23,309
Banco Central de Reserva del Perú	3,118	140,318			
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	377	1,744	CUENTAS POR PAGAR	46,377	31,494
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	284	210			
FONDOS INTERBANCARIOS	86,547	44,018	IMPUESTOS CORRIENTES	701	-
			OTROS PASIVOS	48	-
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	234,843	-	TOTAL DEL PASIVO	115,769	54,803
Instrumentos de Deuda	234,843	-			
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	8,074	11,671	PATRIMONIO		
			Capital social	83,400	83,400
CUENTAS POR COBRAR	10,440	33,389	Reservas	80,649	80,649
			Resultado Acumulado	26,934	-
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	669	517	Resultado Neto del Ejercicio	41,410	26,934
			TOTAL DEL PATRIMONIO	232,393	190,983
ACTIVO INTANGIBLE	175	14,000			
			TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO	348,162	245,786
IMPUESTOS CORRIENTES	-	8,566			
IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO	3,376	3,332			
OTROS ACTIVOS	259	2,007			
TOTAL DEL ACTIVO	348,162	245,786			
RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	4,756,795	1,313,713	RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	4,756,795	1,313,713
Estado de Resultados y Otro Resultado Integral Al 31 de Diciembre de 2023 (En miles de soles)			Contratos de Financiamiento con Garantía de Cartera Credicia RESOLUCION SBS N° 1027-2001 ART°5 Al 31 de Diciembre de 2023 (En miles de soles)		
	2023	2022		2023	2022
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	41,410	26,934	Contraparte	-	-
RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO	41,410	26,934	Monto de Cartera Cedida en Garantía	-	-

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Resultados
Por el periodo terminado el 31 de Diciembre de 2023 y 2022
(En miles de soles)

	2023	2022
INGRESOS POR INTERESES		
Fondos disponibles	4,505	7,670
Fondos interbancarios	4,563	3,513
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	7,069	2,034
TOTAL INGRESOS POR INTERESES	16,137	2,152
GASTOS POR INTERESES		
Fondos interbancarios	-8	-15
Adeudos y obligaciones financieras	-12	-837
Otros	-374	-64
TOTAL GASTOS POR INTERESES	-394	-916
MARGEN FINANCIERO BRUTO	15,743	12,301
INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	16,087	15,058
GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	-296	-296
MARGEN FINANCIERO NETO	31,534	27,063
RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	44,308	29,194
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	10,985	1,217
Derivados de negociación	23,776	21,088
Utilidad-pérdida en diferencia de cambio	9,547	6,889
MARGEN OPERACIONAL	75,842	56,257
GASTOS DE ADMINISTRACION		
Gastos de Personal y Directorio	-18,302	-15,476
Gastos por Servicios Resbidos de Terceros	-5,038	-4,304
Impuestos y Contribuciones	-1,302	-1,300
DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES	-177	-125
MARGEN OPERACIONAL NETO	50,943	34,961
Otros ingresos y egresos	1,611	8
RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	52,554	34,969
IMPUESTO A LA RENTA	-11,144	-8,035
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	41,410	26,934

Publicado en cumplimiento a lo dispuesto por la Superintendencia de Banca y Seguros y AFPs.
DEPARTAMENTO DE CONTABILIDAD

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
REPORTE N° 4 - D
Requerimientos de Patrimonio Efectivo por Riesgos de Crédito, Mercado y Operacional y Calculo del Limite Global
Al 31 de Diciembre 2023 (En miles soles)

	APR	Total
Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito		
Método Estándar	56,596	5,094
Métodos Basados en Calificaciones Internas	-	-
Total APR por Riesgo de Crédito y Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito	56,596	5,094
Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado		
Método Estándar	-	28,268
Riesgo de Tasa de Interés	101,419	15,296
Riesgo de Precio	-	-
Riesgo Cambiario	129,717	12,972
Riesgo de Commodities	-	-
Total APR por Riesgo de Mercado y Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado	262,678	28,268
Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional		
Método del Indicador Básico	83,404	8,340
Método Estándar Alternativo	-	-
Total APR por Riesgo Operacional y Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional	83,404	8,340
Total APR por Riesgo Créd., Merc. y Oper. y Total Req. de Patrim. Efec. x Riesgo Créd., Merc. y Oper	422,678	41,702
Patrimonio Efectivo asignado a cubrir Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional	-	229,576
Requerimiento de Colchones	-	-
Total requerimiento de colchones	-	2,642
Capital ordinario de nivel I asignado a cubrir colchones	-	2,642
Requerimiento de patrimonio efectivo por riesgos adicionales		
Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo por concentración individual, sectorial y regional	-	-
Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo por tasa de interés en el libro bancario	-	-
Provisiones voluntarias aplicables para disminuir requerimiento de patrimonio efectivo por riesgos a	-	-
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgos Adicionales		
Patrimonio Efectivo asignado a cubrir riesgos adicionales	-	-
Patrimonio Efectivo		
Capital Ordinario de Nivel I	-	232,218
Patrimonio Efectivo de Nivel I	-	232,218
Patrimonio Efectivo de Nivel II	-	-
Patrimonio Efectivo Total		
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo	-	232,218
Superávit (déficit) global de Patrimonio Efectivo	-	44,344
Ratio de Capital Global (%)	-	187,874
		54,94%