

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

	2021	2020	PASIVO	2021	2020
<b>ACTIVO DISPONIBLE</b>			<b>ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS</b>	<b>119,617</b>	<b>108,644</b>
Banco Central de Reserva del Perú	277,292	262,913	Fondos disponibles	1,562	440
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	275,477	262,353	Fondos interbancarios	18	164
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	1,748	539	Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	572	2,361
<b>FONDOS INTERBANCARIOS</b>	<b>67</b>	<b>21</b>	<b>TOTAL INGRESOS POR INTERESES</b>	<b>2,152</b>	<b>2,965</b>
<b>INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS</b>			<b>GASTOS POR INTERESES</b>		
Instrumentos de Deuda	20,940	71,922	Fondos interbancarios	-26	-18
	20,940	71,922	Adeudos y obligaciones financieras	-288	-492
<b>DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN</b>	<b>17,820</b>	<b>697</b>	Otros	-2	-3
<b>CUENTAS POR COBRAR</b>	<b>4,616</b>	<b>2,332</b>	<b>TOTAL GASTOS POR INTERESES</b>	<b>-316</b>	<b>-513</b>
<b>INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)</b>	<b>485</b>	<b>999</b>	<b>MARGEN FINANCIERO BRUTO</b>	<b>1,836</b>	<b>2,452</b>
<b>ACTIVO INTANGIBLE</b>	<b>42</b>	<b>135.00</b>	<b>INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>29,446</b>	<b>12,010</b>
<b>IMPUUESTOS CORRIENTES</b>	<b>27,845</b>	<b>2,428</b>	<b>GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>-274</b>	<b>-9</b>
<b>IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO</b>	<b>3,558</b>	<b>2,879</b>	<b>MARGEN FINANCIERO NETO</b>	<b>31,008</b>	<b>14,453</b>
<b>OTROS ACTIVOS</b>	<b>53</b>	<b>4,532</b>	<b>RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)</b>	<b>29,467</b>	<b>40,563</b>
<b>TOTAL DEL ACTIVO</b>	<b>352,651</b>	<b>348,837</b>	Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	1,481	13,109
<b>RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES</b>	<b>2,136,695</b>	<b>417,324</b>	Derivados de negociación	110,892	16,620
			Utilidad- pérdida en diferencia de cambio	-82,906	10,834
			<b>MARGEN OPERACIONAL</b>	<b>60,475</b>	<b>55,016</b>
			<b>GASTOS DE ADMINISTRACIÓN</b>		
			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
			<b>DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES</b>	<b>-806</b>	<b>-1,411</b>
			<b>MARGEN OPERACIONAL NETO</b>	<b>38,804</b>	<b>35,138</b>
			Otros ingresos y egresos	-35	23
			<b>RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>38,769</b>	<b>35,161</b>
			<b>IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>-10,423</b>	<b>-6,967</b>
			<b>RESULTADO NETO DEL EJERCICIO</b>	<b>28,346</b>	<b>28,194</b>

Estado de Resultados y Otro Resultado Integral  
Al 31 de Diciembre de 2021  
(En miles de soles)

	2021	2020		2021	2020
<b>RESULTADO NETO DEL EJERCICIO</b>	<b>28,346</b>	<b>28,194</b>	Contraparte	-	-
<b>RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO</b>	<b>28,346</b>	<b>28,194</b>	Monto de Cartera Cedida en Garantía	-	-

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

	2021	2020
<b>INGRESOS POR INTERESES</b>		
Fondos disponibles	1,562	440
Fondos interbancarios	18	164
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	572	2,361
<b>TOTAL INGRESOS POR INTERESES</b>	<b>2,152</b>	<b>2,965</b>
<b>GASTOS POR INTERESES</b>		
Fondos interbancarios	-26	-18
Adeudos y obligaciones financieras	-288	-492
Otros	-2	-3
<b>TOTAL GASTOS POR INTERESES</b>	<b>-316</b>	<b>-513</b>
<b>MARGEN FINANCIERO BRUTO</b>	<b>1,836</b>	<b>2,452</b>
<b>INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>29,446</b>	<b>12,010</b>
<b>GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>-274</b>	<b>-9</b>
<b>MARGEN FINANCIERO NETO</b>	<b>31,008</b>	<b>14,453</b>
<b>RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)</b>	<b>29,467</b>	<b>40,563</b>
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
<b>MARGEN OPERACIONAL</b>	<b>60,475</b>	<b>55,016</b>
<b>GASTOS DE ADMINISTRACIÓN</b>		
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
<b>DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES</b>	<b>-806</b>	<b>-1,411</b>
<b>MARGEN OPERACIONAL NETO</b>	<b>38,804</b>	<b>35,138</b>
Otros ingresos y egresos	-35	23
<b>RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>38,769</b>	<b>35,161</b>
<b>IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>-10,423</b>	<b>-6,967</b>
<b>RESULTADO NETO DEL EJERCICIO</b>	<b>28,346</b>	<b>28,194</b>
<b>Publicado en cumplimiento a los dispuesto por la Superintendencia de Banca y Seguros y AFP's.</b>		
<b>DEPARTAMENTO DE CONTABILIDAD</b>		

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

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