

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 DISPONIBLE			PASIVO		
Banco Central de Reserva del Perú	142,272	277,292	ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS	0	119,617
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	140,318	275,477	DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	23,309	22,207
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	1,744	1,748	CUENTAS POR PAGAR	31,494	46,756
FONDOS INTERBANCARIOS	210	67	OTROS PASIVOS	0	22
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	44,018	0	TOTAL DEL PASIVO	54,803	188,602
Instrumentos de Deuda	0	20,940			
EN RESULTADOS	0	20,940			
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	11,671	17,820			
CUENTAS POR COBRAR	33,389	4,616	PATRIMONIO		
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	517	485	Capital social	83,400	83,400
ACTIVO INTANGIBLE	14	42.00	Reservas	80,649	52,303
IMPUESTOS CORRIENTES	8,586	27,845	Resultado Neto del Ejercicio	26,934	28,346
IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO	3,332	3,558	TOTAL DEL PATRIMONIO	190,983	164,049
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'S 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
INGRESOS POR INTERESES		
Fondos disponibles	7,670	1,562
Fondos interbancarios	3,513	18
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	2,034	572
TOTAL INGRESOS POR INTERESES	13,217	2,152
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	34,951	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 Cálculo del Límite Global
Al 31 de Diciembre 2022 (En miles soles)

(I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito:		
	APR	Total
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:		
	APR	Total
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:		
	APR	Total
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
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%