



CITIBANK DEL PERU S.A.

ESTADO DE SITUACION FINANCIERA
AL 31 DE MARZO 2021
(Expresado en miles de soles)ESTADO DE RESULTADOS
AL 31 DE MARZO 2021
(Expresado en miles de soles)REPORTE N° 2 - D
REQUERIMIENTO DE PATRIMONIO EFECTIVO POR RIESGOS DE
CREDITO, MERCADO Y OPERACIONAL Y CALCULO DEL LIMITE
GLOBAL A QUE SE REFIERE EL PRIMER PARRAFO DEL
ARTICULO 199° Y LA VIGESIMA CUARTA DISPOSICION
TRANSITORIA DE LA LEY GENERAL
(Articulos 186° al 194°, artículo 199° y Vigésima Cuarta Disposición
Transitoria de la Ley General Nº 26702)
(Expresado en miles de soles)

AL 31 DE MARZO 2021

Empresa: Citibank del Perú S.A.

(I) Requerimiento de Patrimonio

Efectivo por Riesgo de Crédito:

	APR	Total
Método Estándar	2,637,473	263,747
Métodos Basados en Calificaciones Internas		
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito	2,637,473	263,747

(II) Requerimiento de Patrimonio

Efectivo por Riesgo de Mercado:

	APR	Total
Método Estándar	576,512	57,651
Riesgo de Tasa de Interés	337,103	33,710
Riesgo de Precio		
Riesgo Cambiario	239,409	23,941
Riesgo de Commodities		
Método de Modelos Internos		
VAR Total		
Promedio VAR últimos 60 días útiles		
Factor		
Total de Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado	576,512	57,651

(III) Requerimiento de Patrimonio

Efectivo por Riesgo Operacional:

	APR	Total
Método del Indicador Básico	543,534	54,353
Método Estándar Alternativo		
Métodos Avanzados		
Total de Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional	543,534	54,353

(IV) Requerimiento de Patrimonio

Efectivo Total:

	3,757,519
--	-----------

(V) Patrimonio Efectivo

	Total
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1	699,375
Asignado a cubrir el riesgo de crédito	490,905
Asignado a cubrir el riesgo de mercado	107,304
Asignado a cubrir el riesgo operacional	101,166
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2	240,203
Asignado a cubrir el riesgo de crédito	168,603
Asignado a cubrir el riesgo de mercado	36,854
Asignado a cubrir el riesgo operacional	34,746
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 3	0
Asignado a cubrir el riesgo de mercado	0
Total Patrimonio Efectivo	939,578

(VI) Ratio de Capital Global (%):

	25.01
--	-------

FORMA "B-2"

Estado de Resultados y Otro Resultado Integral
CITIBANK DEL PERU S.A.
AL 31 DE MARZO 2021
(Expresado en miles de soles)

RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	43,346
Otro Resultado Integral:	
Diferencias de cambio al convertir negocios en el extranjero	
Inversiones disponibles para la venta	(23,408)
Coberturas de flujo de efectivo	
Coberturas de inversiones netas en negocios en el extranjero	
Participación en Otro Resultado Integral de subsid., asociad. y neg. conjuntos	
* Otros ajustes	
** Impto. a las ganancias relacion. con los component. de Otro Resultado Integral	
Otro Resultado Integral del ejercicio, neto de impuestos	(23,408)
RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO	19,938

Área de Finanzas

ACTIVO	TOTAL
DISPONIBLE	2,938,302
Caja	13,980
Banco Central de Reserva del Perú	2,732,918
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	7,175
Bancos y otras Instituciones Financieras del Exterior	39,904
Canje	1,961
Otras Disponibilidades	142,363
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	186,068
Instrumentos de deuda	186,068
INVERSIONES DISPONIBLES PARA LA VENTA	3,271,028
Instrumentos Representativos de Capital	213
Instrumentos Representativos de Deuda	3,270,814
CARTERA DE CREDITOS	1,272,959
Cartera de Créditos Vigentes	1,290,045
- S/ _Provisiones para créditos.....	(17,086)
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	267,700
CUENTAS POR COBRAR	73,081
Cuentas por Cobrar por Bienes y Servicios y Fideicomiso	10
Otras Cuentas por Cobrar	73,071
INMUEBLES MOBILIARIO Y EQUIPO	25,779
ACTIVO INTANGIBLE	1,355
Otros Activos intangibles	1,355
IMPUESTOS CORRIENTES	110,574
IMPUESTO DIFERIDO	12,617
OTROS ACTIVOS	402,914
TOTAL DEL ACTIVO	8,562,377
PASIVO	
OBLIGACIONES CON EL PUBLICO	5,183,894
Obligaciones a la Vista	4,949,883
Obligaciones por Cuentas de Ahorro	118,844
Obligaciones por Cuentas a Plazo	95,148
Otras Obligaciones	20,019
FONDOS INTERBANCARIOS	142,768
DEPOSITOS DE EMPRESAS DEL SISTEMA FINANCIERO Y ORGAN. FINAN. INTERNAC.	1,411,912
Depósitos a la Vista	1,411,907
Depósitos de Ahorro	5
ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS	66,012
Adeudos y Obligaciones con Empresas e instituciones financieras del país	48,994
Otros Adeudos y Obligaciones del país y del exterior	17,018
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	108,212
CUENTAS POR PAGAR	172,326
PROVISIONES	17,774
Provisión para Créditos Contingentes	16,606
Provisión para litigios y demandas	1,168
OTROS PASIVOS	492,063
TOTAL DEL PASIVO:	7,594,961
PATRIMONIO	967,415
Capital Social	443,175
Capital Adicional	17,130
Reservas	460,968
Ajustes al Patrimonio	2,794
Resultados Acumulados	2
Resultado Neto del Ejercicio	43,346
TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO	8,562,377
RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	1,490,712

INGRESOS POR INTERESES	TOTAL
Disponibles	1,615
Fondos Interbancarios	16
Inversiones a Valor Razonable con Cambios en Resultados	905
Inversiones Disponibles para la Venta	4,136
Cartera de Créditos Directos	11,690
GASTOS POR INTERESES	3,760
Obligaciones con el Público	566
Fondos Interbancarios	56
Depósitos de Empresas del Sistema Financiero y Organismos Financieros Intern.	1
Adeudos y Obligaciones Financieras	3,137
Adeudos y Obligaciones del Sistema Financiero del País	1,184
Adeudos y Obligaciones con Inst. Financieras del Ext. y Organ. Finan. Intern.	120
Otros Adeudos y Obligaciones del País y del Exterior	13
Comisiones y Otros Cargos por Adeudos y Obligaciones Financieras	1,821
MARGEN FINANCIERO BRUTO	14,661
Provisiones para Créditos Directos	(6,240)
MARGEN FINANCIERO NETO	20,901
INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	33,142
Ingresos por Créditos Indirectos	3,302
Ingresos por Fideicomisos y Comisiones de Confianza	1,238
Ingresos Diversos	28,602
GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	4,089
Primas al Fondo de Seguros de Depósito	66
Gastos Diversos	4,003
MARGEN FINANCIERO NETO DE INGRESOS Y GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	49,975
RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	35,326
Inversiones a Valor Razonable con Cambios en Resultados	(4,315)
Inversiones a Valor Razonable con Cambios en Resultados	(4,315)
Inversiones Disponibles para la Venta	11,620
Derivados de Negociación	121,606
Utilidad-Pérdida en Diferencia de Cambio	(94,220)
Otros	635
MARGEN OPERACIONAL	85,301
GASTOS DE ADMINISTRACIÓN	35,289
Gastos de Personal y Directorio	21,518
Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	10,171
Impuestos y Contribuciones	3,600
DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES	762
MARGEN OPERACIONAL NETO	49,249
VALUACIÓN DE ACTIVOS Y PROVISIONES	(6,960)
Provisión para Créditos Indirectos	(6,960)
RESULTADO DE OPERACIÓN	56,209
OTROS INGRESOS Y GASTOS	290
RESULTADOS DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	56,499
IMPUESTO A LA RENTA	(13,153)
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	43,346

UTILIDAD (PÉRDIDA) POR ACCIÓN BÁSICA	0.098
UTILIDAD (PÉRDIDA) POR ACCIÓN DILUIDA	0.098