

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Situación Financiera
Al 31 de Diciembre de 2019 y 2018
(En miles de soles)

	2019	2018		2019	2018
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE	102,048	3,847	ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS	82,964	84,434
Banco Central de Reserva del Perú	100,204	2,897			
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	1,341	907	DERIVADOS PARA NEGOCIACION	5,619	2,265
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	503	43			
FONDOS INTERBANCARIOS	1,400	15,201	CUENTAS POR PAGAR	4,332	4,028
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	93,308	156,476	PROVISIONES	-	54
Instrumentos de Deuda	93,308	156,476	IMPUESTOS CORRIENTES	1,461	
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	608	387	OTROS PASIVOS	78,542	51,737
CUENTAS POR COBRAR	677	1,990	TOTAL DEL PASIVO	172,918	142,518
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	1,721	2,582	PATRIMONIO		
			Capital social	83,400	83,400
ACTIVO INTANGIBLE	158	227	Reservas	573	44
			Resultados Acumulados	23,536	529
IMPUESTOS CORRIENTES	-	1,517			
			TOTAL DEL PATRIMONIO	107,509	83,973
IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO	1,802	778			
OTROS ACTIVOS	78,705	43,486	TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO	280,427	226,491
TOTAL DEL ACTIVO	280,427	226,491			
RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	598,440	558,520	RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	598,440	558,520

Estado de Resultados y Otro Resultado Integral
Al 31 de Diciembre del 2019 y 2018
(En miles de soles)

	2019	2018
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	23,536	2,518
RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO	23,536	2,518

Contratos de Financiamiento con Garantía de Cartera Crediticia
RESOLUCION SBS N° 1027-2001 ART°5
Al 31 de Diciembre del 2019 y 2018
(En miles de soles)

	2019	2018
Contraparte	-	-
Monto de Cartera Cedida en Garantía	-	-

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Resultados
Por el periodo terminado al 31 de Diciembre de 2019 y 2018
(En miles de soles)

	2019	2018
INGRESOS POR INTERESES		
Fondos disponibles	1,485	1,124
Fondos interbancarios	601	1,070
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	4,232	4,836
TOTAL INGRESOS POR INTERESES	6,318	7,030
GASTOS POR INTERESES		
Fondos interbancarios	-166	-165
Adeudos y obligaciones financieras	-1,914	-1,894
Intereses de cuentas por pagar	-9	-7
TOTAL GASTOS POR INTERESES	-2,089	-2,066
MARGEN FINANCIERO BRUTO	4,229	4,964
GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	9,424	
MARGEN FINANCIERO NETO DE INGRESOS Y GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	-20	-45
	13,633	4,919
RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	27,919	14,339
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	20,791	3,443
Derivados de negociación	5,654	10,654
Utilidad- pérdida en diferencia de cambio	1,474	242
MARGEN OPERACIONAL	41,552	19,258
GASTOS DE ADMINISTRACION		
Gastos de Personal y Directorio	-9,399	-10,092
Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	-5,027	-4,891
Impuestos y Contribuciones	-389	-368
DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES	-1,162	-1,081
MARGEN OPERACIONAL NETO	25,575	2,826
Otros ingresos y egresos	32	-115
RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	25,607	2,711
IMPUESTO A LA RENTA	-2,071	-193
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	23,536	2,518
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
REPORT E N° 2 - D
Requerimientos de Patrimonio Efectivo por Riesgos de Crédito, Mercado y Operacional y Calculo del Límite Global
Al 31 de Diciembre de 2019 (En miles soles)

(I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito:			
	APR	Total	
Método Estándar	89,906	8,991	
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito	89,906	8,991	
(II) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado:			
	APR	Total	
Método Estándar	63,347	6,334	
Riesgo de Tasa de Interés	38,564	3,856	
Riesgo Cambiario	24,783	2,478	
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado	63,347	6,334	
(III) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional:			
	APR	Total	
Método del Indicador Básico	45,609	3,831	
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional	45,609	3,831	
(IV) Requerimiento de Patrimonio Efectivo Total:			
		19,156	
(V) Patrimonio Efectivo			
		Total	
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1		83,973	
Asignado a cubrir riesgo de crédito		8,991	
Asignado a cubrir riesgo de mercado		71,151	
Asignado a cubrir riesgo operacional		3,831	
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2		-	
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 3		-	
Total Patrimonio Efectivo		83,973	
(VI) Ratio de Capital Global (%):			43.83%