

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

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)

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	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
DEPRECIAZIONES 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 lo 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 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%