

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Situación Financiera
Al 31 de Diciembre de 2020 y 2019
(En miles de soles)

	2020	2019	PASIVO	2020	2019
ACTIVO DISPONIBLE			ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS	108,644	82,964
Banco Central de Reserva del Perú	262,913	102,048	Fondos disponibles	440	1,485
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	262,353	100,204	Fondos interbancarios	164	601
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	539	1,341	Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	2,361	4,232
	21	503	TOTAL INGRESOS POR INTERESES	2,965	6,318
FONDOS INTERBANCARIOS	-	1,400	GASTOS POR INTERESES		
INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS EN RESULTADOS	71,922	93,308	Fondos interbancarios	-18	-166
Instrumentos de Deuda	71,922	93,308	Adeudos y obligaciones financieras	-492	-1,914
DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN	697	608	Intereses de cuentas por pagar	-3	-9
CUENTAS POR COBRAR	2,332	677	TOTAL GASTOS POR INTERESES	-513	-2,089
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	999	1,721	MARGEN FINANCIERO BRUTO	2,452	4,229
ACTIVO INTANGIBLE	135	158	INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	12,010	9,424
IMPUUESTOS CORRIENTES	2,428	-	GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	-9	-20
IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO	2,879	1,802	MARGEN FINANCIERO NETO DE INGRESOS Y GASTOS	14,453	13,633
OTROS ACTIVOS	4,532	78,705	RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	40,563	27,919
TOTAL DEL ACTIVO	348,837	280,427	Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	13,109	20,791
RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES	417,324	598,440	Derivados de negociación	16,620	5,654
			Utilidad- pérdida en diferencia de cambio	10,834	1,474
			MARGEN OPERACIONAL	55,016	41,552
			GASTOS DE ADMINISTRACION		
			Gastos de Personal y Directorio	-13,283	-9,399
			Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	-4,437	-5,027
			Impuestos y Contribuciones	-747	-389
			DEPRECIAZIONES Y AMORTIZACIONES	-1,411	-1,162
			MARGEN OPERACIONAL NETO	35,138	25,575
			Otros ingresos y egresos	23	32
			RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	35,161	25,607
			IMPUESTO A LA RENTA	-6,967	-2,071
			RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	28,194	23,536
			Publicado en cumplimiento a los dispuesto por la Superintendencia de Banca y Seguros y AFP's		
			DEPARTAMENTO DE CONTABILIDAD		

Contratos de Financiamiento con Garantía de Cartera Credicia
RESOLUCION SBS N° 1027-2001 ARTº5
Al 31 de Diciembre del 2020 y 2019
(En miles de soles)

	2020	2019		2020	2019
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	28,194	23,536	Contraparte	-	-
RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO	28,194	23,536	Monto de Cartera Cedida en Garantía	-	-

J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION
Estado de Resultados
Por el período terminado al 31 de Diciembre de 2020 y 2019
(En miles de soles)

	2020	2019	
INGRESOS POR INTERESES			
Fondos disponibles	440	1,485	
Fondos interbancarios	164	601	
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	2,361	4,232	
TOTAL INGRESOS POR INTERESES	2,965	6,318	
GASTOS POR INTERESES			
Fondos interbancarios	-18	-166	
Adeudos y obligaciones financieras	-492	-1,914	
Intereses de cuentas por pagar	-3	-9	
TOTAL GASTOS POR INTERESES	-513	-2,089	
MARGEN FINANCIERO BRUTO	2,452	4,229	
INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	12,010	9,424	
GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS	-9	-20	
MARGEN FINANCIERO NETO DE INGRESOS Y GASTOS	14,453	13,633	
RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)	40,563	27,919	
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	13,109	20,791	
Derivados de negociación	16,620	5,654	
Utilidad- pérdida en diferencia de cambio	10,834	1,474	
MARGEN OPERACIONAL	55,016	41,552	
GASTOS DE ADMINISTRACION			
Gastos de Personal y Directorio	-13,283	-9,399	
Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	-4,437	-5,027	
Impuestos y Contribuciones	-747	-389	
DEPRECIAZIONES Y AMORTIZACIONES	-1,411	-1,162	
MARGEN OPERACIONAL NETO	35,138	25,575	
Otros ingresos y egresos	23	32	
RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA	35,161	25,607	
IMPUESTO A LA RENTA	-6,967	-2,071	
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO	28,194	23,536	
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 de 2020 (En miles soles)

(I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito:	APR	Total
Método Estándar	16,654	1,665
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito	16,654	1,665
(II) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado:	APR	Total
Método Estándar	72,026	7,203
Riesgo de Tasa de Interés	16,947	1,695
Riesgo Cambiario	55,079	5,508
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado	72,026	7,203
(III) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional:	APR	Total
Método del Indicador Básico	57,916	2,217
Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional	57,916	2,217
(IV) Requerimiento de Patrimonio Efectivo Total:		11,085
(V) Patrimonio Efectivo		Total
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1	107,509	
Asignado a cubrir riesgo de crédito		1,665
Asignado a cubrir riesgo de mercado		103,627
Asignado a cubrir riesgo operacional		2,217
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2		-
Total Patrimonio Efectivo de Nivel 3		-
Total Patrimonio Efectivo		107,509
(VI) Ratio de Capital Global (%):		96.99%

