

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

	2020	2019		2020	2019
<b>ACTIVO</b>			<b>PASIVO</b>		
<b>DISPONIBLE</b>	<b>262,913</b>	<b>102,048</b>	<b>ADEUDOS Y OBLIGACIONES FINANCIERAS</b>	<b>108,644</b>	<b>82,964</b>
Banco Central de Reserva del Perú	262,353	100,204			
Bancos y otras empresas del sistema financiero del país	539	1,341	<b>DERIVADOS PARA NEGOCIACION</b>	<b>787</b>	<b>5,619</b>
Bancos y otras instituciones financieras del exterior	21	503			
<b>FONDOS INTERBANCARIOS</b>	<b>-</b>	<b>1,400</b>	<b>CUENTAS POR PAGAR</b>	<b>101,156</b>	<b>4,332</b>
			<b>PROVISIONES</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>INVERSIONES A VALOR RAZONABLE CON CAMBIOS</b>			<b>IMPUESTOS CORRIENTES</b>	<b>-</b>	<b>1,461</b>
<b>EN RESULTADOS</b>	<b>71,922</b>	<b>93,308</b>			
Instrumentos de Deuda	71,922	93,308	<b>OTROS PASIVOS</b>	<b>2,547</b>	<b>78,542</b>
<b>DERIVADOS PARA NEGOCIACIÓN</b>	<b>697</b>	<b>608</b>	<b>TOTAL DEL PASIVO</b>	<b>213,134</b>	<b>172,918</b>
<b>CUENTAS POR COBRAR</b>	<b>2,332</b>	<b>677</b>			
			<b>PATRIMONIO</b>		
<b>INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)</b>	<b>999</b>	<b>1,721</b>	Capital social	83,400	83,400
			Reservas	24,109	573
<b>ACTIVO INTANGIBLE</b>	<b>135</b>	<b>158</b>	Resultados Acumulados	28,194	23,536
<b>IMPUESTOS CORRIENTES</b>	<b>2,428</b>	<b>-</b>	<b>TOTAL DEL PATRIMONIO</b>	<b>135,703</b>	<b>107,509</b>
<b>IMPUESTO A LA RENTA DIFERIDO</b>	<b>2,879</b>	<b>1,802</b>			
			<b>TOTAL DEL PASIVO Y PATRIMONIO</b>	<b>348,837</b>	<b>280,427</b>
<b>OTROS ACTIVOS</b>	<b>4,532</b>	<b>78,705</b>			
<b>TOTAL DEL ACTIVO</b>	<b>348,837</b>	<b>280,427</b>			
<b>RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES</b>	<b>417,324</b>	<b>598,440</b>	<b>RIESGOS Y COMPROMISOS CONTINGENTES</b>	<b>417,324</b>	<b>598,440</b>

**Estado de Resultados y Otro Resultado Integral**  
**Al 31 de Diciembre del 2020 y 2019**  
**(En miles de soles)**

	2020	2019
<b>RESULTADO NETO DEL EJERCICIO</b>	<b>28,194</b>	<b>23,536</b>
<b>RESULTADO INTEGRAL TOTAL DEL EJERCICIO</b>	<b>28,194</b>	<b>23,536</b>

**Contratos de Financiamiento con Garantía de Cartera Crediticia**  
**RESOLUCION SBS N° 1027-2001 ART°5**  
**Al 31 de Diciembre del 2020 y 2019**  
**(En miles de soles)**

	2020	2019
<b>Contraparte</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Monto de Cartera Cedida en Garantía</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

	2020	2019
<b>INGRESOS POR INTERESES</b>		
Fondos disponibles	440	1,485
Fondos interbancarios	164	601
Inversiones a valor razonable con cambios en resultados	2,361	4,232
<b>TOTAL INGRESOS POR INTERESES</b>	<b>2,965</b>	<b>6,318</b>
<b>GASTOS POR INTERESES</b>		
Fondos interbancarios	-18	-166
Adeudos y obligaciones financieras	-492	-1,914
Intereses de cuentas por pagar	-3	-9
<b>TOTAL GASTOS POR INTERESES</b>	<b>-513</b>	<b>-2,069</b>
<b>MARGEN FINANCIERO BRUTO</b>	<b>2,452</b>	<b>4,229</b>
<b>INGRESOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>12,010</b>	<b>9,424</b>
<b>GASTOS POR SERVICIOS FINANCIEROS</b>	<b>-9</b>	<b>-20</b>
<b>MARGEN FINANCIERO NETO DE INGRESOS Y GASTOS</b>	<b>14,453</b>	<b>13,633</b>
<b>RESULTADO POR OPERACIONES FINANCIERAS (ROF)</b>	<b>40,563</b>	<b>27,919</b>
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
<b>MARGEN OPERACIONAL</b>	<b>55,016</b>	<b>41,552</b>
<b>GASTOS DE ADMINISTRACION</b>		
Gastos de Personal y Directorio	-13,283	-9,399
Gastos por Servicios Recibidos de Terceros	-4,437	-5,027
Impuestos y Contribuciones	-747	-389
<b>DEPRECIACIONES Y AMORTIZACIONES</b>	<b>-1,411</b>	<b>-1,162</b>
<b>MARGEN OPERACIONAL NETO</b>	<b>35,138</b>	<b>25,575</b>
Otros ingresos y egresos	23	32
<b>RESULTADO DEL EJERCICIO ANTES DE IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>35,161</b>	<b>25,607</b>
<b>IMPUESTO A LA RENTA</b>	<b>-6,967</b>	<b>-2,071</b>
<b>RESULTADO NETO DEL EJERCICIO</b>	<b>28,194</b>	<b>23,536</b>
Publicado en cumplimiento a los dispuesto por la Superintendencia de Banca y Seguros y AFP's.		
<b>DEPARTAMENTO DE CONTABILIDAD</b>		

**J.P. MORGAN BANCO DE INVERSION**  
**REPORTE N° 2 - D**  
**Requerimientos de Patrimonio Efectivo por Riesgos de Crédito, Mercado y Operacional y Calculo del Limite 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%	

