



Índice de Capitalización

(Cifras en millones de pesos)

REQUERIMIENTOS DE CAPITAL

| | |
|--|-------|
| Requerimiento por riesgos de mercado | 1,131 |
| Requerimiento por riesgos de crédito | 164 |
| Requerimientos de Capital por Riesgo Operacional | 62 |
| Requerimientos Totales | 1,357 |

COMPUTO

| | |
|----------------------------------|-------|
| Requerimiento de Capital | 1,357 |
| Capital Neto | 3,922 |
| Capital Básico | 3,917 |
| Capital Complementario | 5 |
| Sobrante o (Faltante) de capital | 2,565 |

ACTIVOS EN RIESGO

| | |
|---|--------|
| Activos en Riesgos de Mercado | 14,136 |
| Activos en Riesgos de Crédito | 2,056 |
| Activos por Riesgo Operacional | 778 |
| Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior | - |
| Activos en Riesgo Totales | 16,970 |

COEFICIENTES

| | |
|--|---------|
| Capital Neto / Capital Requerido Total | 2.89% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito | 190.74% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo Totales | 23.11% |
| Capital Básico / Capital Requerido Total | 2.89% |
| Capital Básico / Activos en Riesgo Totales | 23.08% |
| ICAP, incluyendo activos por riesgo operacional sin considerar la octava transitoria | 23.11% |

CALIFICACIÓN CREDITICIA

| | | |
|---------------------|-------------|-------------|
| Standard and Poor's | Largo plazo | Corto plazo |
| Fitch | mxAAA | mxA-1+ |
| | AAA(mex) | F1+(mex) |

De acuerdo con las "Reglas de carácter general a que se refiere el artículo 134 Bis de la Ley de Instituciones de Crédito", publicadas en el Diario Oficial de la Federación el 3 de diciembre de 2004, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, clasificó a Banco J.P. Morgan de acuerdo a su índice de capitalización al 29 de Febrero de 2012 dentro de la **Categoría I**.

* Cifras correspondientes al Índice de Capitalización al 29 de Febrero de 2012, por ser el último autorizado por Banco de Mexico.