



Índice de Capitalización *

(Cifras en millones de pesos)

Correspondiente a Banco J.P. Morgan, S.A.

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	1,358

COMPUTO

Requerimiento de Capital	1,358
Capital Neto	3,921
Capital Básico	3,917
Capital Complementario	5
Sobrante o (Faltante) de capital	2,563

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

	Largo plazo	Corto plazo
Standard and Poor's	mxAAA	mxA-1+
Fitch	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 México.



Índice de Capitalización (Cont.)

Correspondiente a J.P. Morgan Casa de Bolsa, S.A. de C.V.

ACTIVOS EN RIESGO

Activos en Riesgos de Mercado	1,016.56
Activos en Riesgos de Crédito	11.39
Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior	-
Activos por Riesgo Operacional	115.37
Activos Equivalentes por Requerimiento Adicional	-
Activos en Riesgo Totales	1,143.32

COMPUTO

Requerimiento de Capital	91.47
Capital Global	898.85
Sobrante o (Faltante) de capital	807.38

COEFICIENTES

Capital Neto / Capital Requerido Total	9.83%
Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito	7,889.48%
Capital Neto / Activos en Riesgo Totales	78.62%
Capital Básico / Capital Requerido Total	9.83%
Capital Básico / Activos en Riesgo Totales	78.62%

* Último cómputo autorizado por Banco de México con cifras al 29 de febrero de 2012.

El cómputo correspondiente al 31 de Marzo de 2012 se encuentra en revisión de Banco de México a la fecha de esta publicación.

J.P.Morgan