

J.P. MORGAN CASA DE BOLSA, S.A. DE C.V., J.P. MORGAN GRUPO FINANCIERO

Paseo de las Palmas 405, Piso 16, Col. Lomas de Chapultepec

BALANCE GENERAL AL 30 DE JUNIO DE 2016

(Cifras en millones de pesos)

OPERACIONES POR CUENTA DE TERCEROS

CLIENTES CUENTAS CORRIENTES

Bancos de clientes	\$	-	
Dividendos cobrados de clientes		-	
Intereses cobrados de clientes		-	
Liquidación de operaciones de clientes		514	
Premios cobrados de clientes		-	
Liquidaciones con divisas de clientes		-	
Cuentas de margen		-	
Otras cuentas corrientes		-	
	\$		514

OPERACIONES EN CUSTODIA

Valores de clientes recibidos en custodia	\$	39,457	
Valores de clientes en el extranjero		-	39,457

OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN

Operaciones de reporte por cuenta de clientes	\$	-	
Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes		106	
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes		-	
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes		106	
Operaciones de compra de derivados		-	
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)		-	
De opciones		-	
De swaps		-	
De paquete de instrumentos derivados de clientes		-	
Operaciones de venta de derivados		-	
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)		-	
De opciones		-	
De swaps		-	
De paquete de instrumentos derivados de clientes		-	
Fideicomisos administrados		-	212

TOTALES POR CUENTA DE TERCEROS

\$ 40,183

CUENTAS DE ORDEN

OPERACIONES POR CUENTA PROPIA

ACTIVOS Y PASIVOS CONTINGENTES

	\$	-	
<b>COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD</b>			
Efectivo administrado en fideicomiso	\$	-	
Deuda gubernamental		1,069	
Deuda bancaria		-	
Otros títulos de deuda		-	
Instrumentos de patrimonio neto		-	
Otros valores		-	
	\$		1,069

COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD

Deuda gubernamental	\$	-	
Deuda bancaria		-	
Otros títulos de deuda		-	
Instrumentos de patrimonio neto		-	
Otros valores		-	

OTRAS CUENTAS DE REGISTRO

	\$	-	
--	----	---	--

TOTALES POR CUENTA PROPIA

\$ 1,069

ACTIVO

<b>DISPONIBILIDADES</b>	\$	144	
<b>CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)</b>		-	
<b>INVERSIONES EN VALORES</b>	\$	446	
Títulos para negociar		-	
Títulos disponibles para la venta		-	
Títulos conservados a vencimiento		-	446
<b>DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)</b>		-	1,069
<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>		-	
<b>DERIVADOS</b>	\$	-	
Con fines de negociación		-	
Con fines de cobertura		-	
<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>		-	
<b>BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>		-	
<b>CUENTAS POR COBRAR (NETO)</b>		233	
<b>INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)</b>		-	
<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>		0	
<b>ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA</b>		-	
<b>IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)</b>		-	
<b>OTROS ACTIVOS</b>	\$	-	
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles		-	
Otros activos a corto y largo plazo		75	
	\$		1,967

TOTAL ACTIVO

\$ 1,967

PASIVO Y CAPITAL

<b>PASIVOS BURSÁTILES</b>	\$	-	
<b>PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	\$	-	
De corto plazo		-	
De largo plazo		-	
<b>ACREEDORES POR REPORTE</b>		-	
<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>		-	
<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	\$	-	
Reportos (saldo acreedor)		-	
Préstamos de valores		-	
Derivados		-	
Otros colaterales vendidos		-	
<b>DERIVADOS</b>	\$	-	
Con fines de negociación		-	
Con fines de cobertura		-	
<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>		-	
<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>		-	
<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	\$	-	
Impuestos a la utilidad por pagar		-	
Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar		-	
Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar en asamblea de accionistas		-	
Acreedores por liquidación de operaciones		-	
Acreedores por cuenta de margen		-	
Acreedores por colaterales recibidos en efectivo		-	
Acreedores diversos y otras cuentas por pagar		328	
	\$		328
<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>		-	
<b>IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)</b>		-	28
<b>CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS</b>		-	
<b>TOTAL PASIVO</b>	\$		356
<b>CAPITAL CONTABLE</b>			
<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	\$	816	
Capital social		-	
Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas en asamblea de accionistas		-	
Prima en ventas de acciones		-	
Obligaciones subordinadas en circulación		-	816
<b>CAPITAL GANADO</b>	\$	77	
Reservas de capital		633	
Resultado de ejercicios anteriores		-	
Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta		-	
Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo		-	
Efecto acumulado por conversión		-	
Resultado por tenencia de activos no monetarios		-	
Resultado neto		85	
	\$		795
<b>TOTAL CAPITAL CONTABLE</b>	\$		1,611
<b>TOTAL PASIVO Y CAPITAL</b>	\$		1,967

"El presente balance general se formuló de conformidad con los Criterios de Contabilidad para Casas de Bolsa, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores con fundamento en lo dispuesto por los artículos 205, último párrafo, 210, segundo párrafo, y 211 de la Ley del Mercado de Valores, de observancia general y obligatoria, aplicados de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones efectuadas por la casa de bolsa hasta la fecha arriba mencionada, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas bursátiles y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

El presente balance general fue aprobado por el consejo de administración bajo la responsabilidad de los directivos que lo suscriben."

A la fecha del presente balance general el monto histórico del capital social es por \$686 millones de pesos.

Índice de suficiencia del capital global al 31 de mayo de 2016: Riesgo de Crédito 2,753.48%, Riesgo de Mercado 103.59% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 89.35%

Cálificación crediticia otorgada por: Fitch Largo Plazo: AAA(امت) Corto Plazo: F1 (امت) Standard and Poor's Largo Plazo: mxAAA Corto Plazo: mxA-1+

A la fecha del presente balance general no se llevó a cabo la reexpresión de estados financieros al haberse operado en un entorno no inflacionario, siendo el último reconocimiento de los efectos de la inflación en la información financiera el 31 de diciembre de 2007. Inflación del 31 de diciembre 2015 al 30 de junio de 2016 0.63% Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 10.39%

El presente balance general y sus notas podrán ser consultados en las siguientes direcciones:

<https://www.jpmorgan.com.mx/country/mx/es/disclosures/mexico-casa> <http://www.cbmv.gov.mx>