

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 31 DE MARZO DE 2020

(Cifras en millones de pesos)

| OPERACIONES POR CUENTA DE TERCEROS | | Cuentas de Orden | | OPERACIONES POR CUENTA PROPIA | |
|--|-----------|------------------|--|---|-----------------|
| CLIENTES CUENTAS CORRIENTES | | | | ACTIVOS Y PASIVOS CONTINGENTES | |
| Bancos de clientes | \$ - | | | | \$ - |
| Dividendos cobrados de clientes | - | | | | |
| Intereses cobrados de clientes | - | | | | |
| Liquidación de operaciones de clientes | 125 | | | COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD | |
| Premios cobrados de clientes | - | | | Efectivo administrado en fideicomiso | \$ - |
| Liquidaciones con divisas de clientes | - | | | Deuda gubernamental | 1,076 |
| Cuentas de margen | - | | | Deuda bancaria | - |
| Otras cuentas corrientes | - | \$ 125 | | Otros títulos de deuda | - |
| | | | | Instrumentos de patrimonio neto | - |
| | | | | Otros valores | - |
| | | | | | 1,076 |
| OPERACIONES EN CUSTODIA | | | | | |
| Valores de clientes recibidos en custodia | \$ 66,271 | | | COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD | |
| Valores de clientes en el extranjero | - | 66,271 | | Deuda gubernamental | \$ - |
| | | | | Deuda bancaria | - |
| | | | | Otros títulos de deuda | - |
| | | | | Instrumentos de patrimonio neto | - |
| | | | | Otros valores | - |
| | | | | | - |
| OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN | | | | OTRAS CUENTAS DE REGISTRO | |
| Operaciones de reporto por cuenta de clientes | \$ - | | | | - |
| Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes | - | | | | |
| Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes | - | | | | |
| Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes | - | | | | |
| 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 | - | - | | | |
| | | | | | |
| TOTALES POR CUENTA DE TERCEROS | | \$ 66,396 | | TOTALES POR CUENTA PROPIA | \$ 1,076 |
| ACTIVO | | | | PASIVO Y CAPITAL | |
| DISPONIBILIDADES | \$ 112 | | | PASIVOS BURSÁTILES | \$ - |
| CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS) | - | | | PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS | |
| INVERSIONES EN VALORES | \$ 312 | | | De corto plazo | \$ - |
| Títulos para negociar | - | | | De largo plazo | - |
| Títulos disponibles para la venta | - | 312 | | ACREEDORES POR REPORTO | - |
| Títulos conservados a vencimiento | - | | | PRÉSTAMO DE VALORES | - |
| DEUDORES POR REPORTO (SALDO DEUDOR) | | 1,076 | | COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA | |
| PRÉSTAMO DE VALORES | - | | | Reportos (saldo acreedor) | \$ - |
| DERIVADOS | | | | Préstamos de valores | - |
| Con fines de negociación | \$ - | | | Derivados | - |
| Con fines de cobertura | - | | | Otros colaterales vendidos | - |
| AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS | - | | | DERIVADOS | |
| | | | | Con fines de negociación | \$ - |
| | | | | Con fines de cobertura | - |
| BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN | - | | | AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS | - |
| CUENTAS POR COBRAR (NETO) | | 214 | | OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN | - |
| | | | | OTRAS CUENTAS POR PAGAR | |
| INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO) | - | | | Impuestos a la utilidad por pagar | \$ - |
| | | | | Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar | - |
| INVERSIONES PERMANENTES | 0 | | | Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar en asamblea de accionistas | - |
| | | | | Acreedores por liquidación de operaciones | 174 |
| ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA | - | | | Acreedores por cuenta de margen | - |
| | | | | Acreedores por colaterales recibidos en efectivo | - |
| IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO) | 19 | | | Acreedores diversos y otras cuentas por pagar | 116 |
| | | | | | 290 |
| OTROS ACTIVOS | | | | OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN | - |
| Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles | \$ 3 | | | IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO) | - |
| Otros activos a corto y largo plazo | 120 | 123 | | CRÉDITOS DIFERIDOS Y CEBROS ANTICIPADOS | - |
| | | | | | - |
| TOTAL ACTIVO | | \$ 1,856 | | TOTAL PASIVO | \$ 290 |
| | | | | | |
| | | | | CAPITAL CONTABLE | |
| | | | | CAPITAL CONTRIBUIDO | |
| | | | | Capital social | \$ 816 |
| | | | | Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas en asamblea de accionistas | - |
| | | | | Prima en ventas de acciones | - |
| | | | | Obligaciones subordinadas en circulación | - |
| | | | | | \$ 816 |
| | | | | CAPITAL GANADO | |
| | | | | Reservas de capital | \$ 110 |
| | | | | Resultado de ejercicios anteriores | 550 |
| | | | | 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 | 90 |
| | | | | | 750 |
| | | | | TOTAL CAPITAL CONTABLE | \$ 1,566 |
| | | | | TOTAL PASIVO Y CAPITAL | \$ 1,856 |

"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 unas 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 29 de febrero de 2020 Riesgo de Crédito 590.69% Riesgo de Mercado 1,814.72% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 270.67%
 Calificación crediticia otorgada por: Fitch Largo Plazo: AAA(mex) Corto Plazo: F1+(mex)
 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 2020.
 Inflación del 31 de diciembre 2019 al 31 de marzo de 2020 1.57%
 Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 15.03%

El presente balance general y sus notas podrán ser consultados en las siguientes direcciones:
<https://www.jp.morgan.com.mx/country/mx/es/disclosures/mexico-casa> <http://www.cnbv.gob.mx>

Lic. Gerardo Vargas
Director General

L.C. Gabriela Martell
Director de Finanzas

L.C. Santiago Llica
Contador General

L.C. Marim Pacheco
Auditor Interno