



# Índice de capitalización

\*(Cifras en millones de pesos)

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

| <b>REQUERIMIENTOS DE CAPITAL</b>                 |              |
|--|--------------|
| Requerimiento por riesgos de mercado             | 847          |
| Requerimiento por riesgos de crédito             | 1,419        |
| Requerimientos de Capital por Riesgo Operacional | 301          |
| <b>Requerimientos Totales</b>                    | <b>2,567</b> |

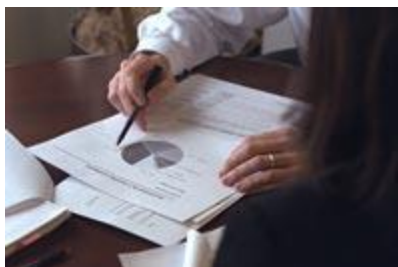
| <b>COMPUTO</b>                          |              |
|---|--------------|
| Requerimiento de Capital                | 2,567        |
| <b>Capital Neto</b>                     | <b>6,935</b> |
| Capital Básico                          | 6,935        |
| Capital Complementario                  | -            |
| <b>Sobrante o (Faltante) de capital</b> | <b>4,368</b> |

| <b>ACTIVOS EN RIESGO</b>  |               |
|---|---------------|
| Activos en Riesgos de Mercado                                       | 10,586        |
| Activos en Riesgos de Crédito                                       | 17,739        |
| Activos por Riesgo Operacional                                      | 3,764         |
| Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior | -             |
| <b>Activos en Riesgo Totales</b>                                    | <b>32,089</b> |

| <b>COEFICIENTES</b>  |        |
|--|--------|
| Capital Neto / Capital Requerido Total   | 2.70%  |
| Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito  | 39.10% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo Totales   | 21.61% |
| Capital Básico / Capital Requerido Total   | 2.70%  |
| Capital Básico / Activos en Riesgo Totales   | 21.61% |
| ICAP, incluyendo activos por riesgo operacional sin considerar la octava transitoria | 21.61% |

| <b>CALIFICACIÓN CREDITICIA</b> |             |             |
|--------------------------------|-------------|-------------|
|                                | 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 31 de mayo de 2016 dentro de la **Categoría I**.



# Índice de capitalización

\*(Cifras en millones de pesos)

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

## ACTIVOS EN RIESGO

|   |          |
|---|----------|
| Activos en Riesgos de Mercado                                       | 1,551    |
| Activos en Riesgos de Crédito                                       | 58       |
| Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior | 0        |
| Activos por Riesgo Operacional                                      | 189      |
| Activos Equivalentes por Requerimiento Adicional                    | <u>0</u> |
| Activos en Riesgo Totales   | 1,799    |

## COMPUTO

|                                  |              |
|----------------------------------|--------------|
| Requerimiento de Capital         | 144          |
| Capital Global                   | <u>1,607</u> |
| Sobrante o (Faltante) de capital | 1,463        |

## COEFICIENTES

|   |           |
|---|-----------|
| Capital Neto / Capital Requerido Total      | 11.17%    |
| Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito | 2,753.48% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo Totales    | 89.35%    |
| Capital Básico / Capital Requerido Total    | 11.17%    |
| Capital Básico / Activos en Riesgo Totales  | 89.35%    |

\* Autorizado por Banco de México con cifras al 31 de mayo de 2016.

El cómputo correspondiente al 30 de junio de 2016 se encuentra en revisión de Banco de México a la fecha de esta publicación.