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 SEPTIEMBRE DE 2013

(Cifras en millones de pesos)

CUENTAS DE ORDEN

OPERACIONES POR CUENTA DE TERCEROS		
CLIENTES CUENTAS CORRIENTES		
Bancos de clientes	$ -	
Dividendos cobrados de clientes	-	
Intereses cobrados de clientes	-	
Liquidación de operaciones de clientes	5	
Premios cobrados de clientes	-	
Liquidaciones con divisas de clientes	-	
Cuentas de margen	-	
Otras cuentas corrientes	-	$ 5
OPERACIONES EN CUSTODIA		
Valores de clientes recibidos en custodia	$ 17,002	
Valores de clientes en el extranjero	-	17,002
OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN		
Operaciones de reporto por cuenta de clientes	$ -	
Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes	81	
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes	-	
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes	81	
Operaciones de compra de derivados	-	
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto nocional)	-	
De opciones	-	
De swaps	-	
De paquete de instrumentos derivados de clientes	-	
Operaciones de venta de derivados	-	
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto nocional)	-	
De opciones	-	
De swaps	-	
De paquete de instrumentos derivados de clientes	-	
Fideicomisos administrados	-	162
TOTALES POR CUENTA DE TERCEROS		$ 17,169

OPERACIONES POR CUENTA PROPIA		
ACTIVOS Y PASIVOS CONTINGENTES		$ -
COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD		
Efectivo administrado en fideicomiso	$ -	
Deuda gubernamental	616	
Deuda bancaria	-	
Otros títulos de deuda	-	
Instrumentos de patrimonio neto	-	
Otros valores	-	616
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		$ 616

ACTIVO

DISPONIBILIDADES		$ 19
CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)		-
INVERSIONES EN VALORES		
Títulos para negociar	$ 446	
Títulos disponibles para la venta	-	
Títulos conservados a vencimiento	-	446
DEUDORES POR REPORTO (SALDO DEUDOR)		616
PRÉSTAMO DE VALORES		-
DERIVADOS		
Con fines de negociación	$ -	
Con fines de cobertura	-	-
AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS		-
BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN		-
CUENTAS POR COBRAR (NETO)		98
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)		-
INVERSIONES PERMANENTES		0
ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA		-
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		-
OTROS ACTIVOS		
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	$ 0	
Otros activos a corto y largo plazo	298	298
TOTAL ACTIVO		$ 1,477

PASIVO Y CAPITAL

PASIVOS BURSÁTILES		$ -
PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS		
De corto plazo	$ 22	
De largo plazo	-	22
ACREEDORES POR REPORTO		-
PRÉSTAMO DE VALORES		-
COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA		
Reportos (saldo acreedor)	$ -	
Préstamos de valores	-	
Derivados	-	
Otros colaterales vendidos	-	-
DERIVADOS		
Con fines de negociación	$ -	
Con fines de cobertura	-	-
AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS		-
OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN		-
OTRAS CUENTAS POR PAGAR		
Impuestos a la utilidad por pagar	$ 5	
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	97	$ 102
OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN		-
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		56
CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS		-
TOTAL PASIVO		$ 180

CAPITAL CONTABLE

CAPITAL CONTRIBUIDO		
Capital social	$ 626	
Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas en asamblea de accionistas	-	
Prima en ventas de acciones	-	
Obligaciones subordinadas en circulación	-	$ 626
CAPITAL GANADO		
Reservas de capital	$ 57	
Resultado de ejercicios anteriores	435	
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	179	671
TOTAL CAPITAL CONTABLE		$ 1,297
TOTAL PASIVO Y CAPITAL		$ 1,477

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 valuaron 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.

Indice de suficiencia del capital global al 31 de agosto de 2013: Riesgo de Crédito 852.59% , Riesgo de Mercado 115% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 90.55%
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 2007.
Inflación del 31 de diciembre 2012 al 30 de septiembre de 2013 1.93% Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 12.31%

El presente balance general y sus notas podrán ser consultados en las siguientes direcciones:
http://www.jpmorgan.com/pages/jpmorgan/ib/mexico/reg/casa http://www.cnbv.gob.mx

LIC. JOSÉ ORIOL BOSCH
DIRECTOR GENERAL

L.C. KARLA OROZCO
CONTADOR GENERAL

L.C. ANGÉLICA OROZCO
AUDITOR INTERNO