

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 2017

(Cifras en millones de pesos)

OPERACIONES POR CUENTA DE TERCEROS		CUENTAS DE ORDEN	OPERACIONES POR CUENTA PROPIA	
CLIENTES CUENTAS CORRIENTES				
Bancos de clientes	\$ -		ACTIVOS Y PASIVOS CONTINGENTES	\$ -
Dividendos cobrados de clientes	-			
Intereses cobrados de clientes	-		COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD	
Liquidación de operaciones de clientes	750		Efectivo administrado en fideicomiso	\$ -
Premios cobrados de clientes	-		Deuda gubernamental	1,146
Liquidaciones con divisas de clientes	-		Deuda bancaria	-
Cuentas de margen	-		Otros títulos de deuda	-
Otras cuentas corrientes	-	\$ 750	Instrumentos de patrimonio neto	-
			Otros valores	-
				<u>1,146</u>
OPERACIONES EN CUSTODIA				
Valores de clientes recibidos en custodia	\$ 53,142			
Valores de clientes en el extranjero	-	53,142		
			COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD	
OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN				
Operaciones de reporto por cuenta de clientes	\$ -		Deuda gubernamental	\$ -
Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes	-		Deuda bancaria	-
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes	-		Otros títulos de deuda	-
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes	-		Instrumentos de patrimonio neto	-
Operaciones de compra de derivados	-		Otros valores	-
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)	-			
De opciones	-		OTRAS CUENTAS DE REGISTRO	
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	<u>\$ 53,892</u>		TOTALES POR CUENTA PROPIA	<u>\$ 1,146</u>
<hr/>				
ACTIVO			PASIVO Y CAPITAL	
DISPONIBILIDADES	\$ 102		PASIVOS BURSÁTILES	\$ -
CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	-		PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	
INVERSIONES EN VALORES			De corto plazo	\$ -
Títulos para negociar	\$ 497		De largo plazo	-
Títulos disponibles para la venta	-		ACREEDORES POR REPORTO	
Títulos conservados a vencimiento	-	497	PRÉSTAMO DE VALORES	
			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	
DEUDORES POR REPORTO (SALDO DEUDOR)		1,147	Reportos (saldo acreedor)	\$ -
PRÉSTAMO DE VALORES		-	Préstamos de valores	-
DERIVADOS			Derivados	-
Con fines de negociación	\$ -		Otros colaterales vendidos	-
Con fines de cobertura	-			
			DERIVADOS	
AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS		-	Con fines de negociación	\$ -
			Con fines de cobertura	-
			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	
BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN		-	OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	
			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	
CUENTAS POR COBRAR (NETO)		74	Impuestos a la utilidad por pagar	\$ -
			Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar	-
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)		-	Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar en asamblea de accionistas	-
			Acreedores por liquidación de operaciones	-
INVERSIONES PERMANENTES		0	Acreedores por cuenta de margen	-
			Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	-
ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA		-	Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	92
				<u>92</u>
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		-	OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	
			IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)	44
OTROS ACTIVOS			CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	13			
Otros activos a corto y largo plazo	67	80	TOTAL PASIVO	<u>\$ 136</u>
TOTAL ACTIVO	<u>\$ 1,900</u>		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	-
				<u>\$ 816</u>
			CAPITAL GANADO	
			Reservas de capital	\$ 82
			Resultado de ejercicios anteriores	729
			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	137
				<u>948</u>
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	<u>\$ 1,764</u>
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>\$ 1,900</u>

"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 2017 Riesgo de Crédito 345.13%, Riesgo de Mercado 16,661.60% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 257.61%

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 2016 al 30 de junio de 2017 3.39% Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 9.97%

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.cnbv.gov.mx>