

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 2018

(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	762			COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD	
Premios cobrados de clientes	-			Efectivo administrado en fideicomiso	\$ -
Liquidaciones con divisas de clientes	-			Deuda gubernamental	1,463
Cuentas de margen	-			Deuda bancaria	-
Otras cuentas corrientes	-	\$ 762		Otros títulos de deuda	-
				Instrumentos de patrimonio neto	-
				Otros valores	-
					1,463
OPERACIONES EN CUSTODIA					
Valores de clientes recibidos en custodia	\$ 92,943			COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD	
Valores de clientes en el extranjero	-	92,943		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	34				
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes	-				
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes	34				
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	-	68			
TOTALES POR CUENTA DE TERCEROS	\$ 93,773			TOTALES POR CUENTA PROPIA	\$ 1,463
ACTIVO		PASIVO Y CAPITAL			
DISPONIBILIDADES	\$ 95	PASIVOS BURSÁTILES	\$ -		
CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	-	PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
INVERSIONES EN VALORES	\$ 522	De corto plazo	\$ -		
Títulos para negociar	-	De largo plazo	-		
Títulos disponibles para la venta	-			ACREEDORES POR REPORTO	
Títulos conservados a vencimiento	522			PRÉSTAMO DE VALORES	
DEUDORES POR REPORTO (SALDO DEUDOR)	1,463	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	-		
				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)	317	Impuestos a la utilidad por pagar	\$ 11		
		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	122		
		Acreedores por cuenta de margen	-		
		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	-		
		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	167		300
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)	-	OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN			
		IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)			46
		CRÉDITOS DIFERIDOS Y CEBROS ANTICIPADOS			-
INVERSIONES PERMANENTES	0	TOTAL PASIVO	\$ 346		
		CAPITAL CONTABLE			
		CAPITAL CONTRIBUIDO			
ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA	-	Capital social	\$ 816		
		Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas en asamblea de accionistas	-		
		Prima en ventas de acciones	-		
		Obligaciones subordinadas en circulación	-		816
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)	-	CAPITAL GANADO			
		Reservas de capital	\$ 95		
		Resultado de ejercicios anteriores	986		
		Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-		
OTROS ACTIVOS		Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-		
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	\$ -	Efecto acumulado por conversión	-		
Otros activos a corto y largo plazo	61	Resultado por tenencia de activos no monetarios	-		
		Resultado neto	215		1,296
TOTAL ACTIVO	\$ 2,458	TOTAL CAPITAL CONTABLE	\$ 2,112		
		TOTAL PASIVO Y CAPITAL	\$ 2,458		

"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 31 de mayo de 2018 Riesgo de Crédito 1.108.38%, Riesgo de Mercado 1.19% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 99.82%
 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 2017 al 30 de junio de 2018 1.32% Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 12.60%

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