

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 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	(544)		COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD	
Premios cobrados de clientes	-		Efectivo administrado en fideicomiso	\$ -
Liquidaciones con divisas de clientes	-		Deuda gubernamental	1,053
Cuentas de margen	-		Deuda bancaria	-
Otras cuentas corrientes	-	(544)	Otros títulos de deuda	-
			Instrumentos de patrimonio neto	-
			Otros valores	-
				<u>1,053</u>
OPERACIONES EN CUSTODIA				
Valores de clientes recibidos en custodia	\$ 54,336	54,336		
Valores de clientes en el extranjero	-			
			COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD	
OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN			Deuda gubernamental	\$ -
Operaciones de reporte por cuenta de clientes	\$ -		Deuda bancaria	-
Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes	-		Otros títulos de deuda	-
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes	-		Instrumentos de patrimonio neto	-
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes	-		Otros valores	-
Operaciones de compra de derivados	-			
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)	-		OTRAS CUENTAS DE REGISTRO	
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	<u>\$ 53,792</u>		TOTALES POR CUENTA PROPIA	<u>\$ 1,053</u>
ACTIVO			PASIVO Y CAPITAL	
DISPONIBILIDADES	\$ 131		PASIVOS BURSÁTILES	\$ -
CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	-		PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	
INVERSIONES EN VALORES			De corto plazo	\$ -
Títulos para negociar	\$ 312		De largo plazo	-
Títulos disponibles para la venta	-			
Títulos conservados a vencimiento	-	312	ACREEDORES POR REPORTE	
DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)		1,052	PRÉSTAMO DE VALORES	
PRÉSTAMO DE VALORES		-	COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	
DERIVADOS			Reportos (saldo acreedor)	\$ -
Con fines de negociación	\$ -		Préstamos de valores	-
Con fines de cobertura	-		Derivados	-
			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)		47	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	3
ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA		-	Acreedores por cuenta de margen	-
			Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	-
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		28	Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	<u>102</u>
				<u>105</u>
OTROS ACTIVOS			OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	\$ 21		IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)	
Otros activos a corto y largo plazo	-	143	CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	
TOTAL ACTIVO	<u>\$ 1,713</u>		TOTAL PASIVO	<u>\$ 105</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	\$ 130
			Resultado de ejercicios anteriores	530
			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	<u>132</u>
				<u>792</u>
			TOTAL CAPITAL CONTABLE	<u>\$ 1,608</u>
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>\$ 1,713</u>

"El presente balance general se formó 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 apoyo 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 2020 Riesgo de Crédito 1,317.44% Riesgo de Mercado 1,891.21% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 374.29%

Calfificación crediticia otorgada por: Fitch Largo Plazo: AA+(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 2019 al 30 de junio de 2020 0.70%

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.jpmorgan.com.mx/country/mx/es/disclosures/mexico-casa> <http://www.cnbv.gov.mx>