

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 31 DE MARZO DE 2016

(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		-		-
Liquidación de operaciones de clientes		407	COLATERALES RECIBIDOS POR LA ENTIDAD	
Premios cobrados de clientes		-	Efectivo administrado en fideicomiso	\$
Liquidaciones con divisas de clientes		-	Deuda gubernamental	1,153
Cuentas de margen		-	Deuda bancaria	-
Otras cuentas corrientes		-	Otros títulos de deuda	-
		\$	Instrumentos de patrimonio neto	-
		407	Otros valores	-
				1,153
OPERACIONES EN CUSTODIA				
Valores de clientes recibidos en custodia	\$	38,180		
Valores de clientes en el extranjero		-		
		38,180		
OPERACIONES DE ADMINISTRACIÓN				
Operaciones de reporte por cuenta de clientes	\$	-	COLATERALES RECIBIDOS Y VENDIDOS O ENTREGADOS EN GARANTÍA POR LA ENTIDAD	
Operaciones de préstamos de valores por cuenta de clientes		2	Deuda gubernamental	\$
Colaterales recibidos en garantía por cuenta de clientes		-	Deuda bancaria	-
Colaterales entregados en garantía por cuenta de clientes		2	Otros títulos de deuda	-
Operaciones de compra de derivados		-	Instrumentos de patrimonio neto	-
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)		-	Otros valores	-
De opciones		-		
De swaps		-		
De paquete de instrumentos derivados de clientes		-		
Operaciones de venta de derivados		-	OTRAS CUENTAS DE REGISTRO	-
De futuros y contratos adelantados de clientes (monto notional)		-		
De opciones		-		
De swaps		-		
De paquete de instrumentos derivados de clientes		-		
Fideicomisos administrados		-		
		4		
TOTALES POR CUENTA DE TERCEROS	\$	38,591	TOTALES POR CUENTA PROPIA	\$
				1,153

ACTIVO		PASIVO Y CAPITAL
DISPONIBILIDADES	\$	48
CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)		-
INVERSIONES EN VALORES	\$	419
Títulos para negociar		-
Títulos disponibles para la venta		-
Títulos conservados a vencimiento		419
DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)		1,153
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)		32
INMUEBLES, MOBILIARIO Y EQUIPO (NETO)		-
INVERSIONES PERMANENTES		0
ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA		-
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		-
OTROS ACTIVOS	\$	49
Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles		-
Otros activos a corto y largo plazo		49
TOTAL ACTIVO	\$	1,701
PASIVOS BURSÁTILES	\$	-
PRÉSTAMOS BANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	\$	-
De corto plazo		-
De largo plazo		-
ACREEDORES POR REPORTE		-
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		-
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		3
Acreedores por cuenta de margen		-
Acreedores por colaterales recibidos en efectivo		-
Acreedores diversos y otras cuentas por pagar		67
		\$
		70
OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN		-
IMPUESTOS Y PTU DIFERIDOS (NETO)		33
CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS		-
TOTAL PASIVO	\$	103
CAPITAL CONTABLE		
CAPITAL CONTRIBUIDO	\$	626
Capital social		-
Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas en asamblea de accionistas		-
Prima en ventas de acciones		-
Obligaciones subordinadas en circulación		-
		\$
		626
CAPITAL GANADO	\$	74
Reservas de capital		826
Resultado de ejercicios anteriores		-
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		72
		\$
		972
TOTAL CAPITAL CONTABLE	\$	1,598
TOTAL PASIVO Y CAPITAL	\$	1,701

"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 \$496 millones de pesos.

Índice de suficiencia del capital global al 29 de febrero de 2016: Riesgo de Crédito 3.450.40%, Riesgo de Mercado 114.90% y Riesgo de Crédito, Mercado y Operacional 98.10%
 Calificación crediticia otorgada por: Fitch Largo Plazo: AAA(mex) Corto Plazo: FI+(mex)
 Standard and Poor's Largo Plazo: mxAAA Corto Plazo: mx-A-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 2015 al 31 de marzo de 2016 1.17% Inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores 10.39%

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>