



Índice de Capitalización *

(Cifras en millones de pesos)

Correspondiente a Banco J.P. Morgan, S.A.

REQUERIMIENTOS DE CAPITAL

Requerimiento por riesgos de mercado	1,054
Requerimiento por riesgos de crédito	209
Requerimientos de Capital por Riesgo Operacional	154
Requerimientos Totales	1,416

COMPUTO

Requerimiento de Capital	1,416
Capital Neto	3,830
Capital Básico	3,824
Capital Complementario	6
Sobrante o (Faltante) de capital	2,414

ACTIVOS EN RIESGO

Activos en Riesgos de Mercado	13,173
Activos en Riesgos de Crédito	2,619
Activos por Riesgo Operacional	1,922
Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior	-
Activos en Riesgo Totales	17,713

COEFICIENTES

Capital Neto / Capital Requerido Total	2.70%
Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito	146.25%
Capital Neto / Activos en Riesgo Totales	21.62%
Capital Básico / Capital Requerido Total	2.70%
Capital Básico / Activos en Riesgo Totales	21.59%
ICAP, incluyendo activos por riesgo operacional sin considerar la octava transitoria	21.62%

CALIFICACIÓN CREDITICIA

	Largo plazo	Corto plazo
Standard and Poor's	mxAAA	mxA-1+
Fitch	AAA(mex)	F1+(mex)

De acuerdo con las "Reglas de carácter general a que se refiere el artículo 134 Bis de la Ley de Instituciones de Crédito", publicadas en el Diario Oficial de la Federación el 3 de diciembre de 2004, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, clasificó a Banco J.P. Morgan de acuerdo a su índice de capitalización al 31 de Mayo de 2012 dentro de la **Categoría I**.

* Cifras correspondientes al Índice de Capitalización al 31 de Mayo de 2012, por ser el último autorizado por Banco de Mexico.



Índice de Capitalización (Cont.)

Correspondiente a J.P. Morgan Casa de Bolsa, S.A. de C.V.

ACTIVOS EN RIESGO

Activos en Riesgos de Mercado	1,020.64
Activos en Riesgos de Crédito	9.49
Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior	-
Activos por Riesgo Operacional	123.42
Activos Equivalentes por Requerimiento Adicional	-
Activos en Riesgo Totales	1,153.54

COMPUTO

Requerimiento de Capital	92.28
Capital Global	922.58
Sobrante o (Faltante) de capital	830.30

COEFICIENTES

Capital Neto / Capital Requerido Total	10.00%
Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito	9,726.14%
Capital Neto / Activos en Riesgo Totales	79.98%
Capital Básico / Capital Requerido Total	10.00%
Capital Básico / Activos en Riesgo Totales	79.98%

* Autorizado por Banco de México con cifras al 31 de Mayo de 2012.

El cómputo correspondiente al 30 de Junio de 2012 se encuentra en revisión de Banco de México a la fecha de esta publicación.