



Índice de capitalización *

(Cifras en millones de pesos)

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

REQUERIMIENTOS DE CAPITAL

| | |
|--|--------------|
| Requerimiento por riesgos de mercado | 1,288 |
| Requerimiento por riesgos de crédito | 431 |
| Requerimientos de Capital por Riesgo Operacional | 59 |
| Requerimientos Totales | 1,778 |

CÓMPUTO

| | |
|---|--------------|
| Requerimiento de Capital | 1,778 |
| Capital Neto | 6,122 |
| Capital Básico | 6,109 |
| Capital Complementario | 13 |
| Sobrante o (Faltante) de capital | 4,344 |

ACTIVOS EN RIESGO

| | |
|---|---------------|
| Activos en Riesgos de Mercado | 16,104 |
| Activos en Riesgos de Crédito | 5,384 |
| Activos por Riesgo Operacional | 735 |
| Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior | - |
| Activos en Riesgo Totales | 22,223 |

COEFICIENTES

| | |
|--|---------|
| Capital Neto / Capital Requerido Total | 3.44% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito | 113.70% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo Totales | 27.55% |
| Capital Básico / Capital Requerido Total | 3.44% |
| Capital Básico / Activos en Riesgo Totales | 27.49% |
| ICAP, incluyendo activos por riesgo operacional sin considerar la octava transitoria | 27.55% |

CALIFICACIÓN CREDITICIA

| | | |
|---------------------|-------------|-------------|
| Standard and Poor's | Largo plazo | Corto plazo |
| Fitch | mxAAA | mxA-1+ |
| | 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 28 de febrero de 2013 dentro de la Categoría I.

* Cifras correspondientes al Índice de capitalización al 28 de febrero de 2013, por ser el último autorizado por el Banco de México.



Índice de capitalización *

(Cifras en millones de pesos)

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

ACTIVOS EN RIESGO

| | |
|---|----------|
| Activos en Riesgos de Mercado | 1,110.80 |
| Activos en Riesgos de Crédito | 21.47 |
| Activos en Riesgo por Faltantes de Capital en Filiales del Exterior | - |
| Activos por Riesgo Operacional | 141.64 |
| Activos Equivalentes por Requerimiento Adicional | - |
| Activos en Riesgo Totales | 1,273.91 |

CÓMPUTO

| | |
|----------------------------------|----------|
| Requerimiento de Capital | 101.91 |
| Capital Global | 1,149.18 |
| Sobrante o (Faltante) de capital | 1,047.27 |

COEFICIENTES

| | |
|---|-----------|
| Capital Neto / Capital Requerido Total | 11.28% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo de Crédito | 5,352.74% |
| Capital Neto / Activos en Riesgo Totales | 90.21% |
| Capital Básico / Capital Requerido Total | 11.28% |
| Capital Básico / Activos en Riesgo Totales | 90.21% |

* Autorizado por el Banco de México con cifras al 28 de febrero de 2013.