

Banco J.P. Morgan, S.A., Institución de Banca Múltiple,
J.P. Morgan Grupo Financiero.

Revelación de información relativa a la razón de apalancamiento.

En cumplimiento al Anexo 1-O Bis de las Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de crédito.

Tabla I.1.- Formato estandarizado de revelación para la razón de apalancamiento

| REFERENCIA | RUBRO | IMPORTE* |
|---|---|------------|
| Exposiciones dentro del balance | | |
| 1 | Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) | 75,834.53 |
| 2 | (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) | (293.45) |
| 3 | Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) | 75,541.08 |
| Exposiciones a instrumentos financieros derivados | | |
| 4 | Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) | 12,155.55 |
| 5 | Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados | 7,274.54 |
| 6 | Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo | - |
| 7 | (Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) | - |
| 8 | (Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central) | - |
| 9 | Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos | - |
| 10 | (Compensaciones realizadas al notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos) | - |
| 11 | Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) | 19,430.09 |
| Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores | | |
| 12 | Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas | 500.10 |
| 13 | (Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) | (0.20) |
| 14 | Exposición Riesgo de Contraparte por SFT | 0.22 |
| 15 | Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros | - |
| 16 | Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) | 500.12 |
| Otras exposiciones fuera de balance | | |
| 17 | Exposición fuera de balance (importe notional bruto) | 15,403.80 |
| 18 | (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) | - |
| 19 | Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) | 15,403.80 |
| Capital y exposiciones totales | | |
| 20 | Capital de Nivel 1 | 7,868.66 |
| 21 | Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) | 110,875.09 |
| Coefficiente de apalancamiento | | |
| 22 | Coefficiente de apalancamiento de Basilea III | 7.10% |

* Información correspondiente al 31 de Agosto de 2017, último Índice de Capitalización autorizado por Banco de México.

Tabla II.2. Notas al comparativo de los activos totales y los activos ajustados

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE* |
|------------|---|-------------------|
| 1 | Activos totales | 108,565.63 |
| 2 | Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria | (293.45) |
| 3 | Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento | - |
| 4 | Ajuste por instrumentos financieros derivados | (12,907.94) |
| 5 | Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1] | 107.06 |
| 6 | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden | 15,403.80 |
| 7 | Otros ajustes | - |
| 8 | Exposición del coeficiente de apalancamiento | 110,875.09 |

* Información correspondiente al 31 de Agosto de 2017, último Índice de Capitalización autorizado por Banco de México.

Tabla III.1- Conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

| REFERENCIA | CONCEPTO | IMPORTE* |
|------------|--|------------------|
| 1 | Activos totales | 108,565.63 |
| 2 | Operaciones en instrumentos financieros derivados | (32,338.03) |
| 3 | Operaciones en reporto y prestamos de valores | (393.06) |
| 4 | Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento | - |
| 5 | Exposiciones dentro del Balance | 75,834.53 |

* Información correspondiente al 31 de Agosto de 2017, último Índice de Capitalización autorizado por Banco de México.

Tabla IV.1.- Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador de la Razón de Apalancamiento)

| CONCEPTO/TRIMESTRE | T-1 | T* | VARIACION (%) | COMENTARIO |
|---------------------------------------|------------|------------|---------------|---|
| Capital Básico ^{1/} | 7,658.45 | 7,868.66 | 2.74% | El Capital aumentó debido a que para el tercer trimestre el monto de Impuestos Diferidos por pérdidas fiscales que disminuyen el capital bajó en \$140 millones de pesos. Para este trimestre ya no existe deducciones de capital por impuestos diferidos por pérdidas fiscales |
| Activos Ajustados ^{2/} | 121,284.10 | 110,875.09 | -8.58% | Los activos disminuyeron principalmente por la disminución en el monto de los reportos en \$15 mil millones de pesos para este trimestre. |
| Razón de Apalancamiento ^{3/} | 6.31% | 7.10% | 12.39% | |

1/ Reportado en las fila 20, 2/ Reportado en las fila 21 y 3/ Reportado en las fila 22, de la Tabla I.

* Información correspondiente al 31 de Agosto de 2017, último Índice de Capitalización autorizado por Banco de México.