

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.

Marzo 2021

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)	89,584.73
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	-
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	89,584.73
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)	13,399.86
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	16,095.46
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)	29,495.32
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	27,507.14
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(4.42)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	19.85
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)	27,522.57
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	27,165.74
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	27,165.74
Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	20,002.17
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	173,768.36
Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	11.51%

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	171,221.71
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	-
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	(29,906.63)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1]	5,287.53
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	27,165.74
7	Otros ajustes	-
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	173,768.36

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

REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
1	Activos totales	171,221.71
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(59,401.95)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(22,235.03)
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	89,584.73

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

CONCEPTO	T-1	Marzo 2021	VARIACION (%)	COMENTARIO
Capital Básico ^{1/}	19,738.58	20,002.17	1.34%	Incremento en el Capital debido al resultado mensual del Banco.
Activos Ajustados ^{2/}	178,876.11	173,768.36	-2.86%	Decremento en inversiones en valores de \$13,000 millones de pesos, así como el decremento de otras cuentas por cobrar de \$4,700 millones, decremento en la exposición potencial futura y costo actual de reemplazo de \$5,200 millones de pesos, decremento en cuentas de margen y operaciones fuera de balance de \$800 y \$900 millones respectivamente. Decrementos parcialmente compensados por el incremento en operaciones de financiamiento con valores de \$13,000 millones y \$6,700 en disponibilidades.
Razón de Apalancamiento ^{3/}	11.03%	11.51%	4.31%	

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