



BNP PARIBAS

PT BANK BNP PARIBAS INDONESIA

Menara BCA - 35 th Floor, Grand Indonesia, Jl. M. H. Thamrin no 1, Jakarta 10310, Indonesia.
Tel.: 62-21-2358.6262 (Hunting), Fax.: 62-21-2358.6098, www.bnpparibas.co.id

LAPORAN PERHITUNGAN
KEWAJIBAN PEMENUHAN RASIO KECUKUPAN LIKUIDITAS (LIQUIDITY COVERAGE RATIO) TRIWULANAN

NAMA BANK : PT. BANK BNP PARIBAS INDONESIA
POSISI LAPORAN : 31 DESEMBER 2016

(Dalam Jutaan Rupiah)

No	Komponen	INDIVIDUAL		INDIVIDUAL	
		Desember 2016		September 2016	
		Nilai Outstanding Kewajiban dan Komitmen/Nilai Tagihan Kontraktual	Nilai HQLA Setelah Pengurangan Nilai (haircut), Outstanding Kewajiban dan Komitmen Dikalikan Tingkat Penarikan (run off rate) atau Nilai Tagihan Kontraktual Dikalikan Tingkat Penerimaan (inflow rate)	Nilai Outstanding Kewajiban dan Komitmen/Nilai Tagihan Kontraktual	Nilai HQLA Setelah Pengurangan Nilai (haircut), Outstanding Kewajiban dan Komitmen Dikalikan Tingkat Penarikan (run off rate) atau Nilai Tagihan Kontraktual Dikalikan Tingkat Penerimaan (inflow rate)
1	Jumlah data Poin yang digunakan dalam perhitungan LCR		3 bulan (posisi data akhir bulan Okt '16 - Des '16)		3 bulan (posisi data akhir bulan Jul '16 - Sep '16)
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)					
2	Total High Quality Liquid Asset (HQLA)		4,234,360		2,533,126
ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)					
3	Simpanan nasabah perorangan dan Pendanaan yang berasal dari nasabah Usaha Mikro dan Usaha Kecil, terdiri dari:	-	-	-	-
	a. Simpanan/Pendanaan stabil	-	-	-	-
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	-	-	-	-
4	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:	-	-	-	-
	a. Simpanan operasional	-	-	-	-
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	3,518,976	1,376,889	3,908,176	1,535,386
	c. Surat berharga berupa surat utang yang diterbitkan oleh bank (unsecured debt)	-	-	-	-
5	Pendanaan dengan agunan (secured funding)		-		-
6	Arus kas keluar lainnya (additional requirement), terdiri dari:				
	a. Arus kas keluar atas transaksi derivatif	4,745,525	4,745,525	6,075,847	6,075,847
	b. Arus kas keluar atas peningkatan kebutuhan likuiditas	-	-	-	-
	c. Arus kas keluar atas kehilangan pendanaan	1,163,631	116,363	1,317,052	131,705
	d. Arus kas keluar atas penarikan komitmen fasilitas kredit dan fasilitas likuiditas	-	-	-	-
	e. Arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana	-	-	-	-
	f. Arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	4,557,235	220,601	3,750,991	183,731
	g. Arus kas keluar kontraktual lainnya	575,196	575,196	221,937	221,937
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		7,034,574		8,148,607
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)					
8	Pinjaman dengan agunan Secured lending	-	-	-	-
9	Tagihan berasal dari pihak lawan (counterparty) yang bersifat lancar (inflows from fully performing exposures)	5,347,780	3,311,852	3,404,862	3,030,188
10	Arus kas masuk lainnya	4,977,405	4,968,138	3,317,826	6,272,744
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)		8,279,990		9,302,932
12	TOTAL HQLA		4,234,360		2,533,126
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		1,758,643		2,037,152
14	LCR (%)		239%		124%

ANALISIS

Posisi likuiditas Bank di triwulan ketiga berada dalam tingkat yang memadai untuk mengantisipasi potensi arus kas bersih keluar dalam jangka waktu 30 hari kedepan.

LCR rasio rata-rata di triwulan keempat 2016 adalah 239% atau meningkat 115% dibandingkan dengan LCR rasio di triwulan ketiga 2016.

Manajemen bank secara aktif menerapkan manajemen risiko likuiditas sebagaimana diatur dalam ketentuan Otoritas Jasa Keuangan mengenai penerapan manajemen risiko bagi Bank Umum.