

**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 KEKUCUKUPAN LIKUIDITAS (LIQUIDITY COVERAGE RATIO) TRIWULANAN**NAMA BANK : PT. BANK BNP PARIBAS INDONESIA
POSISI LAPORAN : 31 MARET 2017

(Dalam Jutaan Rupiah)

| No | Komponen | INDIVIDUAL Maret 2017 | | INDIVIDUAL Desember 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 Jan '17 - Mar '17) | | 3 bulan (posisi data akhir bulan Okt '16 - Des '16) |
| | HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA) | | | | |
| 2 | Total High Quality Liquid Asset (HQLA) | | 4.915.147 | | 4.234.360 |
| | 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 | - | 1.705.311 | 3.518.976 | 1.376.889 |
| | 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 | 4.883.099 | 4.883.099 | 4.745.525 | 4.745.525 |
| | b. Arus kas keluar atas peningkatan kebutuhan likuiditas | - | - | - | - |
| | c. Arus kas keluar atas kehilangan pendanaan | 1.158.128 | 115.813 | 1.163.631 | 116.363 |
| | 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 | 5.087.205 | 246.484 | 4.557.235 | 220.601 |
| | g. Arus kas keluar kontraktual lainnya | 592.254 | 592.254 | 575.196 | 575.196 |
| 7 | TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS) | | 7.542.960 | | 7.034.574 |
| | 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) | | 2.572.617 | 5.347.780 | 3.311.852 |
| 10 | Arus kas masuk lainnya | | 5.111.820 | 4.977.405 | 4.968.138 |
| 11 | TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS) | | 7.684.437 | | 8.279.990 |
| 12 | TOTAL HQLA | | 4.915.147 | | 4.234.360 |
| 13 | TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS) | | 1.885.740 | | 1.758.643 |
| 14 | LCR (%) | | 272% | | 239% |

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 pertama 2017 adalah 272% atau meningkat 33% dibandingkan dengan rasio LCR di triwulan keempat 2016.

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