

**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 : 30 SEPTEMBER 2017

(Dalam Jutaan Rupiah)

No	Komponen	INDIVIDUAL Juni 2017		INDIVIDUAL Juni 2017	
		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 Apr '17 - Jun '17)		3 bulan (posisi data akhir bulan Apr '17 - Jun '17)
	HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)				
2	Total High Quality Liquid Asset (HQLA)		3,756,313		4,574,066
	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	-	1,795,380	-	1,946,603
	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	7,246,629	7,246,629	6,842,446	6,842,446
	b. Arus kas keluar atas peningkatan kebutuhan likuiditas	-	-	-	-
	c. Arus kas keluar atas kehilangan pendanaan	1,194,096	119,410	788,387	78,839
	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	5,333,018	257,192	5,470,224	267,125
	g. Arus kas keluar kontraktual lainnya	317,205	317,205	88,946	88,946
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		9,735,815		9,223,958
	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)	-	3,423,350	-	3,309,359
10	Arus kas masuk lainnya	-	7,393,621	-	7,099,540
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)		10,816,971		10,408,899
12	TOTAL HQLA		3,756,313		4,574,066
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		2,433,954		2,305,989
14	LCR (%)		163%		199%

ANALISIS

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

LCR rasio rata-rata di triwulan ketiga 2017 adalah 163% atau menurun 36% dibandingkan dengan rasio LCR di triwulan kedua 2017.

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