

**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 KECEKUPAN LIKUIDITAS (LIQUIDITY COVERAGE RATIO) TRIWULANAN

NAMA BANK : PT. BANK BNP PARIBAS INDONESIA

POSISI LAPORAN : 30 JUNI 2019

(Dalam Jutaan Rupiah)

No	Komponen	INDIVIDUAL Juni 2019		INDIVIDUAL Maret 2019	
		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 '19 - Jun '19)		3 bulan (posisi data akhir bulan Jan '19 - Mar '19)
	HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)				
2	Total High Quality Liquid Asset (HQLA)		3,567,427		3,933,977
	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	3,268,160	775,587	2,768,620	831,295
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	2,178,773	838,201	1,845,747	897,596
	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	133,030	133,030	10,753	141,614
	b. Arus kas keluar atas peningkatan kebutuhan likuiditas	-	-	-	-
	c. Arus kas keluar atas kehilangan pendanaan	786,199	78,620	1,081,945	82,998
	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 kontjensi pendanaan lainnya	7,002,589	335,263	7,550,523	335,670
	g. Arus kas keluar kontraktual lainnya	73,641	73,641	95,247	47,606
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		2,234,341		2,336,779
	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)	9,272,982	5,268,064	8,112,561	4,955,640
10	Arus kas masuk lainnya	367,820	204,610	50,140	179,125
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)		5,472,674		5,134,764
12	TOTAL HQLA		3,709,937		3,933,977
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		558,585		584,195
14	LCR (%)		664%		673%

ANALISIS

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

LCR rasio rata-rata di triwulan kedua 2019 adalah 664% atau menurun 9% dibandingkan dengan rasio LCR di triwulan pertama 2019.

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