

LAMPIRAN VI
PERATURAN ANGGOTA DEWAN GUBERNUR
NOMOR 23/4/PADG/2021
TANGGAL 31 MARET 2021
TENTANG PERUBAHAN ATAS PERATURAN
ANGGOTA DEWAN GUBERNUR NOMOR
20/18/PADG/2018 TENTANG TRANSAKSI *SWAP*
LINDUNG NILAI KEPADA BANK INDONESIA

CONTOH PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING* UNTUK NILAI NOMINAL YANG
LEBIH KECIL PADA SETIAP PERPANJANGAN TRANSAKSI *SWAP* LINDUNG
NILAI KEPADA BANK INDONESIA

A. Kontrak Lindung Nilai

1. Nominal Kontrak Lindung Nilai: USD20 juta.
2. Jangka waktu Kontrak Lindung Nilai: 2 tahun.

B. Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia

1. Jangka waktu: 12 bulan.
2. Nominal: USD20 juta.
3. Tanggal transaksi: 12 Februari 20XX.
4. Tanggal valuta (setelmen *1st leg swap* 1): 14 Februari 20XX.
5. Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 11 Februari 20XX:
Rp14.000,00.
6. Premi *swap* 12 bulan: Rp600,00.
7. Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen *2nd leg swap* 1): 14 Februari
20XY.
8. Kurs setelmen *2nd leg swap* 1: Rp14.600,00.

C. Perpanjangan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia

1. Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
2. Nominal: USD15 juta.
3. Tanggal transaksi perpanjangan: 12 Februari 20XY.
4. Tanggal valuta perpanjangan (setelmen *1st leg swap* 2): 14 Februari
20XY.
5. Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 11 Februari 20XY:
Rp14.500,00.

6. Premi *swap* 12 bulan: Rp650,00.

D. Setelmen Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia

Perhitungan Setelmen

1. Saat Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia jatuh waktu, perhitungan setelmen 2nd *leg swap* 1 pada tanggal 14 Februari 20XY sebagai berikut:
 - a. Bank Indonesia akan mengembalikan ke Bank: USD20 juta.
 - b. Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia: $(Rp14.000,00 + Rp600,00) \times USD20 \text{ juta} = Rp292 \text{ miliar}$.
2. Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia, perhitungan setelmen 1st *leg swap* 2 pada tanggal 14 Februari 20XY sebagai berikut:
 - a. Bank Indonesia akan menerima transfer dari Bank: USD15 juta.
 - b. Bank akan menerima dari Bank Indonesia: $Rp14.500,00 \times USD15 \text{ juta} = Rp217,5 \text{ miliar}$.

Setelmen Transaksi

Setelmen transaksi secara *netting* pada tanggal 14 Februari 20XY:

- a. Setelmen USD = USD20 juta – USD15 juta = USD5 juta.
- b. Setelmen Rp = Rp217,5 miliar – Rp292 miliar = (Rp74,5 miliar).

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting* maka:

- a. Bank Indonesia akan mentransfer ke rekening Bank di bank koresponden sebesar USD5 juta.
- b. Bank Indonesia mendebit rekening giro rupiah Bank sebesar Rp74,5 miliar.

ANGGOTA DEWAN GUBERNUR,

TTD

DESTRY DAMAYANTI