

PETUNJUK TEKNIS

NOMOR 7/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026

TENTANG
MEKANISME PELAKSANAAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

DEPARTEMEN PENGELOLAAN MONETER DAN ASET SEKURITAS

2026

KATA PENGANTAR

Dalam menetapkan dan melaksanakan kebijakan moneter, Bank Indonesia memiliki kewenangan antara lain mengelola suku bunga, nilai tukar, dan likuiditas yang dilakukan melalui pengendalian moneter. Peraturan Bank Indonesia Nomor 11 Tahun 2024 tentang Pengendalian Moneter mengatur bahwa kewenangan Bank Indonesia dimaksud dilaksanakan Bank Indonesia di antaranya melalui operasi moneter valuta asing.

Mempertimbangkan semakin kompleksnya tantangan yang dihadapi Bank Indonesia dalam mencapai tujuan Operasi Moneter Valuta Asing yang terintegrasi dengan arah pengembangan pasar uang dan pasar valuta asing, Bank Indonesia melakukan penguatan operasi moneter valuta asing berupa perluasan jenis valuta asing dan jenis *Underlying* Transaksi untuk Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia. Penguatan dimaksud diharapkan dapat mendukung peningkatan penggunaan mata uang lokal dalam transaksi perdagangan internasional, serta mendorong pendalaman pasar uang dan pasar valuta asing. Dengan demikian, diharapkan hal tersebut dapat berdampak positif pada efektivitas kebijakan moneter, stabilitas sistem keuangan, dan pertumbuhan ekonomi yang berkelanjutan.

Berdasarkan hal tersebut, diperlukan dukungan pengaturan yang akomodatif dan responsif terhadap perubahan arah kebijakan moneter dan strategi operasi moneter namun tetap memiliki tata kelola yang baik. Untuk itu Bank Indonesia menetapkan petunjuk teknis Nomor 7/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026 tentang Mekanisme Pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia.

Kepala Departemen Pengelolaan
Moneter dan Aset Sekuritas

TTD

Erwin Gunawan Hutapea
Direktur Eksekutif

HALAMAN PENGESAHAN

PETUNJUK TEKNIS

NOMOR 7/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026

TENTANG

MEKANISME PELAKSANAAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

Tempat Pengesahan Petunjuk Teknis : Jakarta
Tanggal Pengesahan Petunjuk Teknis : 23 September 2026
Tanggal Pemberlakuan Petunjuk Teknis : 23 September 2026

Disahkan oleh,

Kepala Departemen Pengelolaan Moneter dan Aset Sekuritas,

TTD

Erwin Gunawan Hutapea
Direktur Eksekutif

DAFTAR PENCABUTAN PETUNJUK TEKNIS

Petunjuk Teknis Nomor 7/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026 tanggal 23 September 2026 tentang Mekanisme Pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia mencabut Petunjuk Teknis Nomor 3/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026 tanggal 29 Juli 2026 tentang Mekanisme Pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia.

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR ii

HALAMAN PENGESAHAN..... iii

DAFTAR PENCABUTAN PETUNJUK TEKNIS.....iv

DAFTAR ISIv

BAB I KETENTUAN UMUM..... 1

A. Latar Belakang 1

B. Dasar Hukum 1

C. Tujuan..... 1

D. Definisi 1

E. Ruang Lingkup 2

BAB II TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI 3

A. Peserta Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI..... 3

B. *Underlying* Transaksi 3

C. Kontrak Lindung Nilai..... 3

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI..... 4

E. Setelmen Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI 6

F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI 7

LAMPIRAN I JENIS DOKUMEN *UNDERLYING* TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI..... 11

LAMPIRAN II CONTOH PENGAJUAN KONTRAK LINDUNG NILAI DAN PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI 12

LAMPIRAN III KONFIRMASI ATAS PENGAJUAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI PI..... 13

LAMPIRAN IV PERHITUNGAN SETELMEN SECARA *NETTING* PADA PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI 14

BAB I KETENTUAN UMUM

A. Latar Belakang

Dalam menetapkan dan melaksanakan kebijakan moneter, Bank Indonesia memiliki kewenangan antara lain mengelola suku bunga, nilai tukar, dan likuiditas yang dilakukan melalui pengendalian moneter sebagaimana diatur dalam Peraturan Bank Indonesia Nomor 11 Tahun 2024 tentang Pengendalian Moneter. Kewenangan dimaksud dilaksanakan oleh Bank Indonesia di antaranya melalui operasi moneter valuta asing.

Mempertimbangkan semakin kompleksnya tantangan yang dihadapi Bank Indonesia dalam mencapai tujuan operasi moneter yang terintegrasi dengan arah pengembangan pasar uang dan pasar valuta asing, Bank Indonesia melakukan penguatan operasi moneter valuta asing berupa perluasan jenis valuta asing dan jenis *underlying* transaksi untuk transaksi *swap* jual lindung nilai konvensional kepada Bank Indonesia yang dilakukan dalam rangka kerjasama keuangan internasional untuk meningkatkan penggunaan mata uang lokal dalam transaksi perdagangan internasional. Penguatan dimaksud dilakukan sebagai salah satu strategi Bank Indonesia untuk mendukung stabilitas nilai tukar rupiah serta mendorong pendalaman pasar uang dan pasar valuta asing. Dengan demikian, diharapkan dapat berdampak positif pada efektivitas kebijakan moneter, stabilitas sistem keuangan, dan pertumbuhan ekonomi yang berkelanjutan.

Selanjutnya, sejalan dengan penguatan transaksi *swap* jual lindung nilai konvensional kepada Bank Indonesia, untuk memastikan kelancaran pelaksanaan transaksi, diperlukan petunjuk teknis yang mencakup antara lain persyaratan bagi peserta operasi moneter konvensional untuk mengikuti transaksi, mekanisme pengumuman rencana transaksi, pengajuan transaksi, pengumuman hasil transaksi, dan setelmen.

B. Dasar Hukum

1. Peraturan Bank Indonesia Nomor 11 Tahun 2024 tentang Pengendalian Moneter (Lembaran Negara Republik Indonesia Tahun 2024 Nomor 64/BI, Tambahan Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 132/BI); dan
2. Peraturan Anggota Dewan Gubernur Nomor 21 Tahun 2025 tentang Operasi Moneter Valuta Asing sebagaimana telah beberapa kali diubah terakhir dengan Peraturan Anggota Dewan Gubernur Nomor 28 Tahun 2026 tanggal 8 September 2026 tentang Perubahan Kelima atas Peraturan Anggota Dewan Gubernur Nomor 21 Tahun 2025 tentang Operasi Moneter Valuta Asing.

C. Tujuan

Memberikan pedoman bagi peserta operasi moneter konvensional dalam melakukan transaksi *swap* jual lindung nilai konvensional kepada Bank Indonesia.

D. Definisi

1. Lindung Nilai adalah cara atau teknik untuk mengurangi risiko yang timbul maupun yang diperkirakan akan timbul akibat adanya fluktuasi harga di pasar keuangan.
2. Transaksi *Swap* Jual Bank kepada Bank Indonesia adalah transaksi pertukaran 2 (dua) valuta melalui pembelian tunai (*spot*) dengan penjualan kembali secara berjangka yang dilakukan secara simultan

dengan Bank Indonesia dan pada tingkat premi atau diskon dan kurs yang dibuat dan disepakati pada tanggal transaksi dilakukan.

3. Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia adalah Transaksi *Swap* Jual Bank kepada Bank Indonesia dalam valuta asing terhadap rupiah untuk lindung nilai.
4. Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia untuk Perdagangan Internasional yang selanjutnya disebut Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI adalah Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia yang dilakukan untuk mendukung peningkatan penggunaan mata uang lokal dalam transaksi perdagangan internasional dan pendalaman pasar uang dan pasar valuta asing.
5. Bank adalah bank umum konvensional, bank umum syariah, dan unit usaha syariah.
6. Bank Umum Konvensional adalah bank umum yang melaksanakan kegiatan usaha secara konvensional, termasuk kantor cabang dari Bank yang berkedudukan di luar negeri.
7. Peserta Operasi Moneter Konvensional adalah Bank Umum Konvensional yang telah dapat mengikuti operasi moneter konvensional.
8. Hari Kerja adalah hari kerja Bank Indonesia dan/atau hari lain yang ditetapkan Bank Indonesia, termasuk hari kerja di negara penerbit mata uang yang ditransaksikan.
9. *Underlying* Transaksi adalah kegiatan yang mendasari transaksi Lindung Nilai Bank kepada Bank Indonesia.
10. Kontrak Lindung Nilai adalah informasi dari Bank yang disampaikan kepada Bank Indonesia berisi rencana jangka waktu dan jumlah *Underlying* Transaksi yang digunakan sebagai dasar transaksi Lindung Nilai Bank kepada Bank Indonesia.
11. Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* yang selanjutnya disebut JISDOR adalah kurs acuan yang merepresentasikan nilai tukar *spot* dolar Amerika Serikat terhadap rupiah dari transaksi antarbank di pasar valuta asing termasuk transaksi Bank dengan bank di luar negeri.
12. Rekening Giro adalah rekening giro sebagaimana dimaksud dalam ketentuan Bank Indonesia mengenai rekening giro.
13. Bank Koresponden adalah Bank yang memelihara rekening giro valuta asing guna pembayaran dan/atau penerimaan dana valuta asing ke dan/atau dari bank.
14. Penduduk adalah orang, badan hukum, atau badan lainnya yang berdomisili atau berencana berdomisili di Indonesia sekurang-kurangnya 1 (satu) tahun, termasuk perwakilan dan staf diplomatik Republik Indonesia di luar negeri.

E. Ruang Lingkup

Mekanisme pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional Perdagangan Internasional (PI).

BAB II

TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

- A. Peserta Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
1. Peserta Operasi Moneter Konvensional yang dapat mengajukan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI harus memenuhi persyaratan sebagai berikut:
 - a. memiliki peringkat komposit tingkat kesehatan Bank paling rendah 3 (tiga) sesuai penilaian Otoritas Jasa Keuangan; dan
 - b. merupakan *Appointed Cross Currency Dealer Bank* (Bank ACCD).
 2. Bank ACCD sebagaimana dimaksud pada butir 1.b merupakan bank yang ditunjuk untuk melakukan penyelesaian kegiatan dan transaksi keuangan tertentu sebagaimana diatur dalam ketentuan Bank Indonesia mengenai penyelesaian transaksi menggunakan mata uang lokal.
- B. *Underlying* Transaksi
1. *Underlying* Transaksi memiliki jenis valuta asing yang sama dengan jenis valuta asing Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI. Khusus untuk *Underlying* Transaksi dengan denominasi CNH dapat digunakan untuk Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dengan denominasi CNY.
 2. *Underlying* Transaksi yang digunakan terkait dengan kegiatan ekonomi dalam rangka perdagangan internasional untuk mendukung peningkatan penggunaan mata uang lokal dalam transaksi perdagangan internasional dan pendalaman pasar uang dan pasar valuta asing.
 3. Dalam hal Bank Indonesia menetapkan pemberian insentif dalam Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI, insentif dimaksud diperhitungkan sebagai pengurang atas premi *swap* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 4. *Underlying* Transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 2 tidak termasuk:
 - a. surat berharga berdenominasi valuta asing yang diterbitkan oleh Bank Indonesia untuk seluruh transaksi beli valuta asing terhadap rupiah;
 - b. surat berharga berdenominasi valuta asing yang diterbitkan oleh pemerintah Indonesia di dalam negeri untuk seluruh transaksi beli valuta asing terhadap rupiah;
 - c. penempatan dana, mencakup antara lain berupa tabungan, giro, deposit, dan sertifikat deposito (*negotiable certificate of deposit*);
 - d. fasilitas pembiayaan yang belum ditarik; atau
 - e. aset kripto, yang merupakan aset tidak berwujud yang berbentuk aset digital, termasuk yang menggunakan kriptografi, jaringan *peer-to-peer*, dan buku besar yang terdistribusi.
 5. *Underlying* Transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 2 dibuktikan dengan dokumen *Underlying* Transaksi sebagaimana tercantum dalam Lampiran I.
- C. Kontrak Lindung Nilai
1. Pengajuan Kontrak Lindung Nilai memuat informasi:
 - a. nama Peserta Operasi Moneter Konvensional;
 - b. jangka waktu Kontrak Lindung Nilai;
 - c. tanggal efektif berlakunya Kontrak Lindung Nilai;
 - d. dokumen *Underlying* Transaksi;
 - e. jangka waktu *Underlying* Transaksi;

- f. jenis valuta asing;
 - g. nilai nominal *Underlying* Transaksi yang dicantumkan dalam Kontrak Lindung Nilai; dan/atau
 - h. informasi lain.
2. Setiap pengajuan Kontrak Lindung Nilai disertai dengan pernyataan Peserta Operasi Moneter Konvensional bahwa seluruh persyaratan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI telah dipenuhi.
 3. Dalam hal Kontrak Lindung Nilai yang diajukan oleh Peserta Operasi Moneter Konvensional tidak memuat informasi sebagaimana dimaksud pada angka 1 dan/atau tidak disertai pernyataan sebagaimana dimaksud pada angka 2, Peserta Operasi Moneter Konvensional harus melakukan koreksi atas Kontrak Lindung Nilai, yang diajukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 4. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan Kontrak Lindung Nilai.
 5. Contoh pengajuan Kontrak Lindung Nilai sebagaimana tercantum dalam Lampiran II.

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI

1. Pengumuman Rencana Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
 - a. Pengumuman rencana Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI memuat informasi:
 - 1) jenis Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia;
 - 2) jenis valuta asing;
 - 3) peserta transaksi;
 - 4) sarana pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan sarana pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI;
 - 5) tanggal transaksi;
 - 6) jangka waktu transaksi;
 - 7) *window time*;
 - 8) nilai nominal minimum pengajuan dan kelipatan nilai nominal pengajuan;
 - 9) tanggal setelmen atau tanggal valuta;
 - 10) kurs *spot*;
 - 11) premi *swap*;
 - 12) jangka waktu dan *window time* dalam hal dibuka perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI; dan/atau
 - 13) informasi lain.
 - b. Kurs *spot* yang diumumkan Bank Indonesia berupa kurs acuan selain dolar Amerika Serikat yang diumumkan oleh Bank Indonesia pada 1 (satu) Hari Kerja sebelum tanggal transaksi.
 - c. Premi *swap* sebagaimana dimaksud pada butir a.11) merupakan premi *swap* yang telah memperhitungkan insentif yang diberikan Bank Indonesia.
2. Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
 - a. Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
 - b. Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI sebagaimana pengumuman rencana transaksi.

- c. Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI memuat informasi:
 - 1) nama Peserta Operasi Moneter Konvensional;
 - 2) jenis valuta asing;
 - 3) tanggal transaksi;
 - 4) tanggal setelmen atau tanggal valuta;
 - 5) jangka waktu transaksi;
 - 6) tanggal jatuh waktu;
 - 7) nilai nominal transaksi;
 - 8) nomor rekening valuta asing Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden;
 - 9) nomor Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan/atau
 - 10) informasi lain.
 - d. Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI disampaikan bersamaan dengan penyampaian Kontrak Lindung Nilai.
 - e. Nilai nominal transaksi harus memenuhi ketentuan mengenai nilai nominal minimum pengajuan dan kelipatan nilai nominal pengajuan dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 - f. Nilai nominal Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI paling banyak sebesar nilai nominal *Underlying* Transaksi.
 - g. Contoh pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI tercantum dalam Lampiran II.
 - h. Bank Indonesia memberikan nomor referensi kepada Peserta Operasi Moneter Konvensional untuk setiap Kontrak Lindung Nilai setelah pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI diterima oleh Bank Indonesia.
 - i. Nomor referensi Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud pada huruf h digunakan untuk mengidentifikasi Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dan kaitannya dengan dokumen *Underlying* Transaksi yang ditatausahakan oleh Peserta Operasi Moneter Konvensional.
3. Koreksi Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
- a. Dalam hal pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI tidak memuat informasi sebagaimana dimaksud pada butir 2.c., Peserta Operasi Moneter Konvensional harus melakukan koreksi atas pengajuan transaksi tersebut.
 - b. Koreksi sebagaimana dimaksud pada huruf a tidak dapat dilakukan terhadap:
 - 1) nama Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan
 - 2) jangka waktu Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 - c. Koreksi atas pengajuan transaksi sebagaimana dimaksud pada huruf a diajukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
 - d. Koreksi dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
 - e. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 - f. Koreksi atas pengajuan transaksi harus memenuhi ketentuan nilai nominal minimum pengajuan dan kelipatan nilai nominal

pengajuan sebagaimana dimaksud pada butir 1.a.8)., dalam hal koreksi dilakukan atas nilai nominal pengajuan.

4. Konfirmasi atas Pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
 - a. Konfirmasi memuat informasi:
 - 1) *direction (buy and sell)*;
 - 2) jenis valuta asing;
 - 3) nilai nominal transaksi;
 - 4) jangka waktu transaksi;
 - 5) tanggal setelmen atau tanggal valuta;
 - 6) tanggal jatuh waktu;
 - 7) kurs *spot*;
 - 8) kurs *forward*;
 - 9) premi *swap*;
 - 10) nomor rekening valuta asing Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden;
 - 11) nomor Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan/atau
 - 12) informasi lain.
 - b. Kurs *forward* yang digunakan yaitu kurs *spot* ditambah premi *swap*.
 - c. Contoh konfirmasi atas pengajuan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional IP tercantum dalam Lampiran III.

E. Setelmen Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI

1. Setelmen *First Leg* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
 - a. Peserta Operasi Moneter Konvensional menyampaikan konfirmasi setelmen Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI kepada Bank Indonesia c.q. Departemen Jasa Perbankan, Perizinan, dan Operasional Tresuri melalui *society for worldwide interbank financial telecommunication* (SWIFT) atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
 - b. Setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:
 - 1) Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional sebesar nilai nominal valuta asing Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dikalikan dengan kurs *spot* yang tercantum dalam pengumuman Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI pada tanggal transaksi; dan
 - 2) Peserta Operasi Moneter Konvensional menerima transfer dana valuta asing di rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden sebesar nilai nominal valuta asing Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
2. Setelmen *Second Leg* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI

Setelmen *second leg* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:

 - a. Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI ke rekening Bank Indonesia di Bank Koresponden; dan
 - b. Peserta Operasi Moneter Konvensional akan menerima dana rupiah di Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter

Konvensional sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* dikalikan dengan kurs *forward*.

- F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI
1. Bank Indonesia dapat membuka perpanjangan untuk Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI yang menggunakan mata uang selain CNY.
 2. Bank Indonesia membuka *window time* perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dengan jangka waktu:
 - a. sesuai jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia; dan/atau
 - b. selain jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia (*odd tenor*).
 3. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
 4. Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI kepada Bank Indonesia pada 2 (dua) Hari Kerja sebelum Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI jatuh waktu.
 5. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dalam *window time* perpanjangan transaksi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
 6. Jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI sesuai dengan:
 - a. informasi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI; atau
 - b. sisa jangka waktu Kontrak Lindung Nilai, dengan jangka waktu perpanjangan transaksi paling singkat 1 (satu) bulan dan paling lama 12 (dua belas) bulan.
 7. Dalam hal Bank Indonesia membuka *window time* perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dengan jangka waktu selain jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia (*odd tenor*), Peserta Operasi Moneter Konvensional dapat mengajukan permintaan informasi terkait premi perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI untuk jangka waktu selain jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia (*odd tenor*) melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
 8. Pengajuan permintaan informasi terkait premi perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dengan jangka waktu selain jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia (*odd tenor*) sebagaimana dimaksud pada angka 7 dilakukan sebelum pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dalam *window time* perpanjangan transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 5.
 9. Dalam hal Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dengan jangka waktu selain jangka waktu yang diumumkan Bank Indonesia (*odd tenor*), pengajuan perpanjangan dilakukan paling lambat 30 (tiga puluh) menit setelah *window time* pengajuan perpanjangan transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 5 dibuka.
 10. Peserta Operasi Moneter Konvensional yang mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI harus memenuhi ketentuan:
 - a. menggunakan Kontrak Lindung Nilai yang masih berlaku;

- b. nilai nominal perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI paling banyak sebesar nilai *Underlying* Transaksi pada saat pengajuan perpanjangan; dan
 - c. penggunaan *Underlying* Transaksi selama periode Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
- 11. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI memuat informasi paling sedikit berupa:
 - a. nama Peserta Operasi Moneter Konvensional;
 - b. nomor referensi Kontrak Lindung Nilai;
 - c. jenis valuta asing;
 - d. tanggal perpanjangan transaksi;
 - e. jangka waktu perpanjangan transaksi;
 - f. tanggal setelmen atau tanggal valuta perpanjangan transaksi;
 - g. tanggal jatuh waktu;
 - h. nilai nominal *outstanding Underlying* Transaksi pada saat tanggal pengajuan perpanjangan transaksi;
 - i. nilai nominal perpanjangan transaksi;
 - j. nomor rekening valuta asing Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden;
 - k. nomor Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan/atau
 - l. informasi lain.
- 12. Contoh pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI tercantum dalam Lampiran II.
- 13. Dalam hal pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI tidak memuat informasi sebagaimana dimaksud pada angka 11 Peserta Operasi Moneter Konvensional harus melakukan koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi tersebut.
- 14. Koreksi sebagaimana dimaksud pada angka 13 tidak dapat dilakukan terhadap:
 - a. nama Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan
 - b. jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
- 15. Koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 13 diajukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
- 16. Koreksi dilakukan dalam *window time* perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
- 17. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
- 18. Koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi harus memenuhi ketentuan nilai nominal minimum pengajuan dan kelipatan nilai nominal pengajuan sebagaimana dimaksud pada butir D.1.a.8), dalam hal koreksi dilakukan atas nilai nominal pengajuan.
- 19. Konfirmasi atas pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI memuat informasi:
 - a. Konfirmasi memuat informasi:
 - 1) *direction (buy or sell)*;
 - 2) jenis valuta asing;
 - 3) nilai nominal perpanjangan transaksi;
 - 4) jangka waktu perpanjangan transaksi;
 - 5) tanggal setelmen atau tanggal valuta;
 - 6) tanggal jatuh waktu;
 - 7) kurs *spot*;
 - 8) kurs *forward*;

- 9) premi *swap*;
 - 10) nilai nominal *netting* dalam valuta asing dan rupiah, dalam hal penyelesaian dilakukan secara *netting*;
 - 11) nomor rekening valuta asing Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden;
 - 12) nomor Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan/atau
 - 13) informasi lain.
 - b. Kurs *forward* yang digunakan yaitu kurs *spot* ditambah premi *swap*.
 - c. Nilai nominal *netting* sebagaimana dimaksud pada butir a.10) adalah pemindahan dana dengan memperhitungkan selisih kewajiban Peserta Operasi Moneter Konvensional dalam Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI.
20. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang sama dengan nilai nominal Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dengan ketentuan:
- a. nilai setelmen *netting* dalam denominasi rupiah dihitung dengan rumus:

Nilai setelmen <i>netting</i> =	Nilai nominal valuta asing	x	$\left[\begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen } 2nd \text{ Leg} \\ \text{Transaksi } Swap \text{ Jual} \\ \text{Lindung Nilai} \\ \text{Konvensional PI} \end{array} - \begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen } 1st \text{ Leg} \\ \text{Saat Perpanjangan} \end{array} \right]$
---------------------------------	----------------------------	---	---

- b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:
 - 1) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
 - 2) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.
21. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang lebih kecil atau lebih besar dari nilai nominal Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilakukan dengan ketentuan:
- a. nilai setelmen *netting* dalam valuta asing dihitung dengan rumus sebagai berikut:

Nilai setelmen <i>netting</i> dalam valuta asing Transaksi <i>Swap</i> Jual Lindung Nilai Konvensional PI	=	$\frac{\text{nilai nominal valuta asing transaksi awal}}{\text{nilai nominal valuta asing saat perpanjangan transaksi}}$
---	---	--

- b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:
 - 1) nilai setelmen *netting* positif, Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing ke rekening Bank Indonesia di Bank Koresponden; atau
 - 2) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mentransfer dana valuta asing ke rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.
- c. nilai setelmen *netting* dalam rupiah dihitung dengan rumus sebagai berikut:

Nilai setelmen <i>netting</i> dalam rupiah Transaksi <i>Swap</i> Jual Lindung Nilai Konvensional PI	=	$\left[\begin{array}{l} \text{nilai nominal valuta asing transaksi awal} \\ \times \text{ kurs setelmen } 2nd \text{ leg transaksi} \end{array} \right] - \left[\begin{array}{l} \text{nilai nominal valuta asing saat perpanjangan transaksi} \\ \times \text{ kurs } 1st \text{ leg saat perpanjangan transaksi} \end{array} \right]$
---	---	---

- d. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf c menghasilkan:

- 1) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
 - 2) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.
22. Contoh perhitungan setelmen secara *netting* perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI tercantum dalam Lampiran IV.

G. Transaksi Peserta Operasi Moneter dengan Nasabah

1. Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI dilaksanakan secara *back-to-back* dengan transaksi Peserta Operasi Moneter dengan nasabah.
2. Transaksi Peserta Operasi Moneter dengan nasabah sebagaimana dimaksud pada angka 1 mencakup antara lain transaksi *swap* lindung nilai dan transaksi pinjaman (*peer financing*).

LAMPIRAN I
JENIS DOKUMEN *UNDERLYING* TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSIONAL PI

1. *Letter of Credit* (L/C) dan perubahan L/C, *standby* L/C, *trust receipt*, atau *letter of guarantee*;
2. dokumen yang bersifat tagihan atau yang menimbulkan kewajiban pembayaran, antara lain:
 - a. *invoice* atau *commercial invoice* dengan masa berlaku sampai dengan tanggal jatuh waktu (*due date*) *invoice* atau *commercial invoice* dimaksud, dimana dalam hal *invoice* tidak memiliki tanggal jatuh waktu maka *invoice* tersebut dapat digunakan maksimal 3 (tiga) bulan sejak tanggal penerbitan;
 - b. nota debit (*debit note*) yang informasi di dalamnya dapat diverifikasi;
 - c. kontrak penjualan (*sales contract*) yang memiliki masa berlaku dan nominal yang sesuai dengan yang tercantum dalam kontrak; dan
 - d. *list of invoices* yang didukung oleh pernyataan nasabah yang berisi:
 - 1) validitas *list of invoices* dimaksud;
 - 2) tanggung jawab nasabah untuk mengadministrasikan *invoices* dimaksud; dan
 - 3) komitmen penyediaan *invoices* apabila dibutuhkan oleh Bank.
3. fotokopi Pemberitahuan Impor Barang (PIB);
4. fotokopi Pemberitahuan Ekspor Barang (PEB);
5. bukti dokumen yang menunjukkan adanya kebutuhan remitansi;
6. fotokopi kontrak jasa konsultan;
7. fotokopi surat perjanjian kerja atau dokumen pendukung lain antara tenaga kerja asing yang bersangkutan dengan badan usaha, termasuk bukti penerimaan dalam rupiah seperti slip gaji tenaga kerja asing;
8. bukti penerimaan dalam rupiah atau sesuai mata uang yang digunakan dalam Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI yang dimiliki oleh nasabah untuk kebutuhan repatriasi, antara lain berupa slip gaji serta hasil kegiatan perdagangan barang dan jasa;
9. bukti penerimaan dan pembayaran imbal hasil surat berharga;
10. bukti pembagian dividen, dan bukti hasil investasi lainnya;
11. risalah rapat umum pemegang saham dan tambahan dokumen lain yang menggambarkan besarnya nominal untuk pembayaran dividen ke pemegang saham di negara sesuai mata uang yang digunakan dalam Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI;
12. bukti pembelian dan pembayaran produk investasi portofolio;
13. bukti kegiatan transfer modal;
14. bukti pembelian atau penjualan aset bukan finansial antara lain hak kekayaan intelektual, tanah, dan aset tetap lainnya;
15. dokumen *loan agreement* atau dokumen lainnya;
16. bukti pembelian/penjualan saham;
17. bukti pembayaran kupon;
18. bukti pembelian/penjualan obligasi korporasi termasuk produk reksadana dan kontrak investasi kolektif;
19. bukti pembelian/penjualan surat berharga negara;
20. *bill of lading*;
21. wesel;
22. akta jual beli, perjanjian, laporan keuangan audit, bukti kepemilikan perusahaan; dan
23. bukti pembelian/penjualan surat berharga lainnya.

LAMPIRAN II
CONTOH PENGAJUAN KONTRAK LINDUNG NILAI DAN PERPANJANGAN
TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

A. CONTOH PENGAJUAN KONTRAK LINDUNG NILAI DAN TRANSAKSI SWAP
JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

BERSAMA INI BANK “ABC” MENYATAKAN BAHWA TRANSAKSI SWAP JUAL
LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI TELAH MEMENUHI SELURUH
PERSYARATAN DALAM KETENTUAN YANG MENGATUR TRANSAKSI SWAP
JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

KONTRAK LINDUNG NILAI

- 1. NAMA BANK “ABC”
- 2. JANGKA WAKTU KONTRAK 1 TAHUN (365 HARI)
- 3. TANGGAL EFEKTIF BERLAKUNYA KONTRAK LINDUNG NILAI 21 AGU 2026
- 4. *UNDERLYING* PEMBERITAHUAN IMPOR BARANG NASABAH PT “XYZ” DENGAN BANK “EFG”
- 5. SISA JANGKA WAKTU *UNDERLYING* 2 TAHUN (720 HARI) DIHITUNG SEJAK TANGGAL VALUTA SWAP
- 6. NOMOR DOKUMEN *UNDERLYING*: XYZ1234562022
- 7. NILAI NOMINAL CNY 10 JUTA

TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

- 1. NAMA BANK “ABC”
- 2. TANGGAL TRANSAKSI 19 AGU 2026
- 3. TANGGAL VALUTA 21 AGU 2026
- 4. TANGGAL JATUH WAKTU 21 SEP 2026
- 5. JANGKA WAKTU TRANSAKSI 1 BULAN
- 6. NILAI NOMINAL TRANSAKSI CNY 10 JUTA
- 7. MY CNY THRU BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
- 8. MY IDR TO RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

B. CONTOH PENGAJUAN PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG
NILAI KONVENSIONAL PI

PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSIONAL PI:

- 1. NOMOR REFERENSI BIRU04012324BS-0001
- 2. NAMA BANK “ABC”
- 3. NILAI NOMINAL *OUTSTANDING UNDERLYING* TRANSAKSI CNY 9 JUTA
- 4. TANGGAL TRANSAKSI 17 SEP 2026
- 5. TANGGAL VALUTA 21 SEP 2026
- 6. TANGGAL JATUH WAKTU 21 OKT 2026
- 7. JANGKA WAKTU TRANSAKSI 1 BULAN
- 8. NILAI NOMINAL TRANSAKSI CNY 9 JUTA
- 9. MY CNY TO BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
- 10. MY IDR THRU RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

LAMPIRAN III
KONFIRMASI ATAS PENGAJUAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSSIONAL PI

CONTOH KONFIRMASI ATAS PENGAJUAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG
NILAI KONVENSSIONAL PI

- a. NOMOR REFERENSI KONTRAK LINDUNG NILAI BIRU04012325B-0001
- b. WE BUY AND SELL CNY 10 MIO
- c. AGAINST IDR FOR 1 MONTH
- d. RATES ARE 15767 AND 15787
- e. DATES ARE 06 NOV 2026 AND 06 DES 2026
- f. MY CNY THRU BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
- g. MY IDR TO RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

LAMPIRAN IV
PERHITUNGAN SETELMEN SECARA *NETTING* PADA PERPANJANGAN
TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

A. CONTOH PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING* PADA PERPANJANGAN
TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI UNTUK NILAI
NOMINAL PERPANJANGAN TRANSAKSI YANG SAMA

1. TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI
 - a. Jangka waktu: 12 bulan.
 - b. Nominal: CNY20 juta.
 - c. Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
 - d. Tanggal valuta (setelmen 1st *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
 - e. Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XX: Rp2.600,00.
 - f. Premi *swap* 12 bulan: Rp100,00.
 - g. Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2nd *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
 - h. Kurs setelmen 2nd *leg swap* 1: Rp2.700,00.
2. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI
KONVENSIONAL PI
 - a. Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
 - b. Nominal: CNY20 juta.
 - c. Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
 - d. Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1st *leg swap* 2): 4 Agustus 20XY.
 - e. Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XY: Rp2.650,00.
 - f. Premi *swap* 12 bulan: Rp110,00.
3. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*
 - a. Saat Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI jatuh waktu, perhitungan setelmen 2nd *leg swap* 1 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - 1) Bank Indonesia akan menerima transfer dari Bank: CNY20 juta.
 - 2) Bank akan menerima dari Bank Indonesia: $(Rp2.600,00 + Rp100,00) \times CNY20 \text{ juta} = Rp54 \text{ miliar}$.
 - b. Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI, perhitungan setelmen 1st *leg swap* 2 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - 1) Bank Indonesia akan mentransfer kepada Bank: CNY20 juta.
 - 2) Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia: $Rp2.650,00 \times CNY20 \text{ juta} = Rp53 \text{ miliar}$.
 - c. Setelmen Transaksi bersifat *netting* pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - 1) Setelmen CNY = CNY20 juta - CNY20 juta = CNY0.
 - 2) Setelmen Rp = Rp54 miliar - Rp53 miliar = Rp1 miliar.

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting* maka Bank Indonesia mengkredit rekening giro rupiah Bank pada tanggal 6 Agustus 20XY sebesar Rp1 miliar.

B. CONTOH PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING* PADA PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI UNTUK NILAI NOMINAL PERPANJANGAN TRANSAKSI YANG LEBIH KECIL ATAU LEBIH BESAR

1. NILAI NOMINAL YANG LEBIH KECIL

a. TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

- 1) Jangka waktu: 12 bulan.
- 2) Nominal: CNY20 juta.
- 3) Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
- 4) Tanggal valuta (setelmen 1st *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
- 5) Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XX: Rp2.600,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp100,00.
- 7) Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2nd *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
- 8) Kurs setelmen 2nd *leg swap* 1: Rp2.700,00.

b. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

- 1) Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
- 2) Nominal: CNY15 juta.
- 3) Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
- 4) Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1st *leg swap* 2): 6 Agustus 20XY.
- 5) Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XY: Rp2.650,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp110,00.

c. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*

- 1) Saat Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI jatuh waktu, perhitungan setelmen 2nd *leg swap* 1 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - a) Bank mengembalikan ke Bank Indonesia: CNY20 juta
 - b) Bank Indonesia akan mengembalikan ke Bank: $(Rp2.600,00 + Rp100,00) \times CNY20 \text{ juta} = Rp54 \text{ miliar}$.
- 2) Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI, perhitungan setelmen 1st *leg swap* 2 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - a) Bank Indonesia menerima transfer dari Bank: $Rp2.650,00 \times CNY15 \text{ juta} = Rp39,75 \text{ miliar}$.
 - b) Bank akan menerima dari Bank Indonesia: CNY15 juta.
- 3) Setelmen transaksi secara *netting* pada tanggal 6 Agustus 20XY:
 - a) Setelmen CNY = CNY20 juta – CNY15 juta = CNY5 juta.
 - b) Setelmen Rp = Rp54 miliar – Rp39,75 miliar = Rp14,25 miliar.

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting*, maka:

- 1) Bank Indonesia akan menerima transfer dana valuta asing dari rekening Bank di bank koresponden sebesar CNY5 juta.
- 2) Bank Indonesia mengkredit rekening giro rupiah Bank di BI sebesar Rp14,25 miliar.

2. NILAI NOMINAL YANG LEBIH BESAR

a. TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI

- 1) Jangka waktu: 12 bulan.

- 2) Nominal: CNY20 juta.
 - 3) Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
 - 4) Tanggal valuta (setelmen 1st *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
 - 5) Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XX: Rp2.600,00.
 - 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp100,00.
 - 7) Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2nd *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
 - 8) Kurs setelmen 2nd *leg swap* 1: Rp2.700,00.
- b. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP JUAL LINDUNG NILAI KONVENSIONAL PI
- 1) Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
 - 2) Nominal: CNY25 juta.
 - 3) Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
 - 4) Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1st *leg swap* 2): 6 Agustus 20XY.
 - 5) Kurs acuan Non-USD/IDR Bank Indonesia 3 Agustus 20XY: Rp2.650,00.
 - 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp110,00.
- c. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*
- 1) Saat Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI jatuh waktu, perhitungan setelmen 2nd *leg swap* 1 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - a) Bank Indonesia mengembalikan ke Bank: $(Rp2.600,00 + Rp100,00) \times CNY20 \text{ juta} = Rp54 \text{ miliar}$.
 - b) Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia: CNY20 juta.
 - 2) Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Jual Lindung Nilai Konvensional PI, perhitungan setelmen 1st *leg swap* 2 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
 - a) Bank Indonesia menerima transfer dari Bank: $Rp2.650,00 \times CNY25 \text{ juta} = Rp66,25 \text{ miliar}$.
 - b) Bank akan menerima dari Bank Indonesia: CNY5 juta.
 - 3) Setelmen transaksi secara *netting* pada tanggal 6 Agustus 20XY:
 - a) Setelmen CNY = CNY20 juta – CNY25 juta = (CNY5 juta).
 - b) Setelmen Rp = Rp54 miliar – Rp66,25 miliar = (Rp12,25 miliar).
- Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting*, maka:
- a) Bank akan menerima transfer dana valuta asing dari rekening BI di bank koresponden sebesar CNY5 juta.
 - b) Bank Indonesia mendebit rekening giro rupiah Bank di BI sebesar Rp12,25 miliar.