

PETUNJUK TEKNIS  
NOMOR 2/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026  
TENTANG  
MEKANISME PELAKSANAAN TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG NILAI  
KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

## 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 yang terintegrasi dengan arah pengembangan pasar uang dan pasar valuta asing, Bank Indonesia melakukan penguatan operasi moneter valuta asing berupa perluasan *Underlying* Transaksi untuk Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia. Penguatan dimaksud diharapkan dapat mendukung stabilitas nilai tukar antara lain melalui pengelolaan risiko nilai tukar dan mendorong investasi oleh investor global pada investasi portofolio dalam rupiah. 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 2/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026 tentang Mekanisme Pelaksanaan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia.

Kepala Departemen Pengelolaan  
Moneter dan Aset Sekuritas

TTD

Erwin Gunawan Hutapea  
Direktur Eksekutif

HALAMAN PENGESAHAN

PETUNJUK JENIS

NOMOR 2/JUKNIS/EKSTERNAL/DPMA/2026

TENTANG

MEKANISME PELAKSANAAN TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG NILAI  
KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

Tempat Pengesahan Petunjuk Teknis : Jakarta  
Tanggal Pengesahan Petunjuk Teknis : 29 Juli 2026  
Tanggal Pemberlakuan Petunjuk Teknis : 29 Juli 2026

Disahkan oleh,

Kepala Departemen Pengelolaan Moneter dan Aset Sekuritas,

TTD

Erwin Gunawan Hutapea  
Direktur Eksekutif

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR..... ii

HALAMAN PENGESAHAN..... iii

DAFTAR ISI..... iv

BAB I KETENTUAN UMUM..... 5

A. Latar Belakang ..... 5

B. Dasar Hukum..... 5

C. Tujuan..... 5

D. Definisi..... 5

E. Ruang Lingkup ..... 6

BAB II TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENTSIONAL KEPADA BANK INDONESIA..... 7

BAB III TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENTSIONAL REGULER ..... 8

A. Peserta Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler ..... 8

B. *Underlying* Transaksi ..... 8

C. Kontrak Lindung Nilai..... 9

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 9

E. Setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler ... 12

F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler ..... 12

BAB IV TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENTSIONAL IP ..... 16

A. Karakteristik dan Peserta Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP ..... 16

B. *Underlying* Transaksi ..... 16

C. Kontrak Lindung Nilai..... 16

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP..... 17

E. Setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP ..... 19

F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP ..... 20

LAMPIRAN I ..... 23

LAMPIRAN II ..... 26

LAMPIRAN III ..... 28

LAMPIRAN IV ..... 29

## 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 *underlying* transaksi untuk transaksi *swap* beli lindung nilai konvensional kepada Bank Indonesia. Penguatan dimaksud dilakukan sebagai salah satu strategi Bank Indonesia untuk memperkuat efektivitas implementasi kebijakan moneter untuk stabilisasi nilai tukar Rupiah dengan meningkatkan daya tarik aset domestik bagi investor global serta mendukung keberlanjutan aliran masuk modal asing.

Selanjutnya, sejalan dengan penguatan transaksi *swap* beli lindung nilai konvensional kepada Bank Indonesia, 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 21 Tahun 2026 tanggal 29 Juli 2026 tentang Perubahan Keempat 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* beli 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* Beli Bank kepada Bank Indonesia adalah transaksi pertukaran 2 (dua) valuta melalui penjualan tunai (*spot*) dengan pembelian 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* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia adalah Transaksi *Swap* Beli Bank kepada Bank Indonesia dalam valuta asing terhadap rupiah untuk lindung nilai.

4. Bank adalah bank umum konvensional, bank umum syariah, dan unit usaha syariah.
5. Bank Umum Konvensional adalah bank umum yang melaksanakan kegiatan usaha secara konvensional, termasuk kantor cabang dari Bank yang berkedudukan di luar negeri.
6. Peserta Operasi Moneter Konvensional adalah Bank umum Konvensional yang telah dapat mengikuti operasi moneter konvensional.
7. 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.
8. *Underlying Transaksi* adalah kegiatan yang mendasari transaksi Lindung Nilai Bank kepada Bank Indonesia.
9. 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.
10. 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.
11. Rekening Giro adalah rekening giro sebagaimana dimaksud dalam ketentuan Bank Indonesia mengenai rekening giro.
12. Bank Koresponden adalah Bank yang memelihara Rekening Giro valuta asing guna pembayaran dan/atau penerimaan dana valuta asing ke dan/atau dari Bank.
13. 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* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia

## BAB II

### TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

Bank Indonesia menyelenggarakan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia yang mencakup:

- a. Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia Reguler (Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler), yaitu transaksi pertukaran 2 (dua) valuta melalui penjualan tunai (*spot*) dengan pembelian 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; dan
- b. Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia dalam rangka investasi portofolio (Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP), yaitu Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia yang dilakukan untuk mendorong investasi portofolio dalam rupiah oleh investor global.

### BAB III

#### TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER

- A. Peserta Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler  
Peserta Operasi Moneter Konvensional yang dapat mengajukan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler harus memenuhi persyaratan memiliki peringkat komposit tingkat kesehatan Bank paling rendah 3 (tiga) sesuai penilaian Otoritas Jasa Keuangan.
- B. *Underlying* Transaksi
  1. *Underlying* Transaksi memiliki jenis valuta asing yang sama dengan jenis valuta asing Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
  2. *Underlying* Transaksi terkait dengan kegiatan ekonomi yang dapat digunakan dalam Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler meliputi:
    - a. kegiatan transaksi berjalan (*current account*) yang meliputi:
      - 1) transaksi ekspor dan impor barang dan/atau jasa, dari dan ke Indonesia;
      - 2) transaksi pendapatan primer berupa:
        - a) transaksi penerimaan dan pembayaran kompensasi tenaga kerja;
        - b) pendapatan investasi dari investasi langsung, investasi portofolio, dan/atau investasi lain; dan
        - c) transaksi pendapatan primer lain; dan
      - 3) transaksi pendapatan sekunder berupa:
        - a) penerimaan dan pembayaran sektor pemerintah;
        - b) penerimaan dan pembayaran sektor lain, termasuk remitansi dan transaksi sejenis lain; dan
        - c) transaksi pendapatan sekunder lain;
    - b. kegiatan transaksi finansial (*financial account*) yang meliputi:
      - 1) investasi langsung;
      - 2) investasi portofolio; dan
      - 3) investasi lain;
    - c. kegiatan transaksi modal (*capital account*), antara lain transfer modal;
    - d. kredit atau pembiayaan dari Bank kepada Penduduk untuk tujuan perdagangan dan investasi, termasuk penerbitan surat berharga dalam valuta asing;
    - e. perdagangan barang dan jasa di dalam negeri, yang dikecualikan dari kewajiban penggunaan rupiah sebagaimana dimaksud dalam Peraturan Bank Indonesia mengenai kewajiban penggunaan rupiah di wilayah Negara Kesatuan Republik Indonesia; dan
    - f. *Underlying* Transaksi lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
  3. *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.
4. *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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
4. Peserta Operasi Moneter Konvensional hanya dapat mengajukan 2 (dua) kali koreksi untuk setiap pengajuan Kontrak Lindung Nilai.
5. Contoh pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan contoh pernyataan Peserta Operasi Moneter Konvensional mengenai pemenuhan persyaratan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler tercantum dalam Lampiran II.

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler

1. Pengumuman Rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
  - a. Pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler memuat informasi:
    - 1) jenis Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia;
    - 2) jenis valuta asing;
    - 3) peserta transaksi;
    - 4) sarana pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan sarana pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler;
    - 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* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler; dan/atau
- 13) informasi lain.
- b. Kurs *spot* yang diumumkan Bank Indonesia berupa:
  - 1) JISDOR pada 1 (satu) Hari Kerja sebelum tanggal transaksi, untuk Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dalam dolar Amerika Serikat; atau
  - 2) kurs acuan selain dolar Amerika Serikat yang diumumkan oleh Bank Indonesia pada 1 (satu) Hari Kerja sebelum tanggal transaksi, Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dalam valuta asing selain dolar Amerika Serikat.
2. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
  - a. Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
  - b. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
  - c. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler memuat informasi paling sedikit berupa:
    - 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
    - 10) informasi lain.
  - d. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
  - f. Nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler paling banyak sebesar nilai nominal *Underlying* Transaksi.
  - g. Contoh pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler diterima oleh Bank Indonesia.

- i. Nomor referensi Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud pada huruf i digunakan untuk mengidentifikasi Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dan kaitannya dengan dokumen *Underlying* Transaksi yang ditatausahakan oleh Peserta Operasi Moneter Konvensional.
- 3. Koreksi Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
  - a. Dalam hal pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
  - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
  - e. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
  - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
  - a. Konfirmasi memuat informasi:
    - 1) *direction* (*sell and buy*);
    - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler tercantum dalam Lampiran III.

- E. Setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
1. Setelmen *First Leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
    - a. Peserta Operasi Moneter Konvensional menyampaikan konfirmasi setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler sebagaimana dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:
      - 1) Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing sebesar nilai nominal transaksi ke rekening Bank Indonesia di Bank Koresponden; dan
      - 2) Peserta Operasi Moneter Konvensional menerima dana rupiah di Rekening Giro rupiah sebesar nilai nominal valuta asing transaksi dikalikan dengan kurs *spot* yang tercantum dalam pengumuman Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler pada tanggal transaksi.
  2. Setelmen *Second Leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler  
 Setelmen *second leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:
    - a. Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dikalikan dengan kurs *forward*; dan
    - b. Peserta Operasi Moneter Konvensional akan menerima dana valuta asing di rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
- F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
1. Selama *window time* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler, Peserta Operasi Moneter Konvensional dapat mengajukan permintaan informasi terkait premi perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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.
  2. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
  3. Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia pada 2 (dua) Hari Kerja sebelum Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler jatuh waktu.
  4. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dalam *window time* perpanjangan transaksi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.

5. Jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler sesuai dengan:
  - a. informasi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler; 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.
6. Dalam hal Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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 4 dibuka.
7. Peserta Operasi Moneter Konvensional yang mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler harus memenuhi ketentuan:
  - a. menggunakan Kontrak Lindung Nilai yang masih berlaku;
  - b. nilai nominal perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler paling banyak sebesar nilai nominal *Underlying* Transaksi pada saat pengajuan perpanjangan; dan
  - c. penggunaan *Underlying* Transaksi selama periode Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
8. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler 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
  - l. informasi lain.
9. Contoh pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler tercantum dalam Lampiran II.
10. Dalam hal pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler tidak memuat informasi sebagaimana dimaksud pada angka 8 Peserta Operasi Moneter Konvensional harus melakukan koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi tersebut.
11. Koreksi sebagaimana dimaksud pada angka 10 tidak dapat dilakukan terhadap:
  - a. nama Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan
  - b. jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
12. Koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 10 diajukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.

13. Koreksi dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
14. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
15. 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.
16. Konfirmasi atas Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler
- a. Konfirmasi memuat informasi:
    - 1) *direction* (*sell and buy*);
    - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler.
17. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang sama dengan nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dengan ketentuan:
- a. nilai setelmen *netting* dalam denominasi rupiah dihitung dengan rumus:

|                                 |                            |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|---------------------------------|----------------------------|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nilai setelmen <i>netting</i> = | Nilai nominal valuta asing | x | $\left[ \begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen } 2^{nd} \text{ Leg} \\ \text{Transaksi } Swap \text{ Beli} \\ \text{Lindung Nilai} \\ \text{Konvensional Reguler} \end{array} - \begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen } 1^{st} \text{ Leg Saat} \\ \text{Perpanjangan} \end{array} \right]$ |
|---------------------------------|----------------------------|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
  - b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:
    - 1) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
    - 2) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.
18. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang lebih kecil atau lebih besar dari nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dengan ketentuan:

- a. nilai setelmen *netting* dalam valuta asing dihitung dengan rumus sebagai berikut:

|                                                                                                                         |   |                                                    |   |                                                                 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|----------------------------------------------------|---|-----------------------------------------------------------------|
| Nilai setelmen <i>netting</i><br>dalam valuta asing Transaksi<br><i>Swap</i> Beli Lindung Nilai<br>Konvensional Reguler | = | nilai nominal<br>valuta asing<br>transaksi<br>awal | - | nilai nominal<br>valuta asing saat<br>perpanjangan<br>transaksi |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|----------------------------------------------------|---|-----------------------------------------------------------------|

- b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:

- 1) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mentransfer dana valuta asing ke rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden; atau
- 2) nilai setelmen *netting* negatif, Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing ke rekening Bank Indonesia di Bank Koresponden, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.

- c. nilai setelmen *netting* dalam rupiah dihitung dengan rumus sebagai berikut:

|                                                                                                        |   |                                                                                                                                                                 |                                                    |   |                                          |   |                                                                                                                                                                                       |                                                                 |   |                                                   |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---|------------------------------------------|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|---|---------------------------------------------------|
| Nilai setelmen<br>netting dalam rupiah<br>Transaksi Swap<br>Beli Lindung Nilai<br>Konvensional Reguler | = | <table border="1"><tr><td>nilai nominal<br/>valuta asing<br/>transaksi<br/>awal</td><td>x</td><td>kurs<br/>setelmen<br/>2nd leg<br/>transaksi</td></tr></table> | nilai nominal<br>valuta asing<br>transaksi<br>awal | x | kurs<br>setelmen<br>2nd leg<br>transaksi | - | <table border="1"><tr><td>nilai nominal<br/>valuta asing saat<br/>perpanjangan<br/>transaksi</td><td>x</td><td>kurs 1st leg<br/>saat<br/>perpanjangan<br/>transaksi</td></tr></table> | nilai nominal<br>valuta asing saat<br>perpanjangan<br>transaksi | x | kurs 1st leg<br>saat<br>perpanjangan<br>transaksi |
| nilai nominal<br>valuta asing<br>transaksi<br>awal                                                     | x | kurs<br>setelmen<br>2nd leg<br>transaksi                                                                                                                        |                                                    |   |                                          |   |                                                                                                                                                                                       |                                                                 |   |                                                   |
| nilai nominal<br>valuta asing saat<br>perpanjangan<br>transaksi                                        | x | kurs 1st leg<br>saat<br>perpanjangan<br>transaksi                                                                                                               |                                                    |   |                                          |   |                                                                                                                                                                                       |                                                                 |   |                                                   |

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

- 1) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
- 2) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.

19. Contoh perhitungan setelmen secara *netting* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler tercantum dalam Lampiran IV.

## BAB IV

### TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

- A. Karakteristik dan Peserta Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
- Peserta Operasi Moneter Konvensional yang dapat mengajukan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP memenuhi persyaratan memiliki peringkat komposit tingkat kesehatan Bank paling rendah 3 (tiga) sesuai penilaian Otoritas Jasa Keuangan.
- B. *Underlying* Transaksi
1. *Underlying* Transaksi yang digunakan dalam Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP menggunakan denominasi rupiah.
  2. Nilai nominal *Underlying* Transaksi dihitung dengan melakukan konversi ke jenis valuta asing dolar Amerika Serikat, menggunakan kurs JISDOR 1 (satu) hari sebelum tanggal transaksi.
  3. *Underlying* Transaksi terkait dengan kegiatan ekonomi yang dapat digunakan dalam Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP berupa kegiatan transaksi finansial (*financial account*) yang meliputi investasi portofolio dalam rupiah yang dilakukan oleh nasabah yang merupakan investor global.
  4. Investasi portofolio dalam rupiah sebagaimana dimaksud pada angka 3 mencakup SRBI, SBN, obligasi korporasi termasuk efek beragun aset, dan saham.
  5. Jenis dokumen *Underlying* Transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 3 berupa:
    - a. konfirmasi pembelian surat berharga oleh investor global (*deal ticket*); dan/atau
    - b. bukti kepemilikan surat berharga investor global.
  6. Dalam hal dokumen *Underlying* Transaksi berupa konfirmasi pembelian surat berharga (*deal ticket*), Peserta Operasi Moneter Konvensional harus menatausahakan bukti kepemilikan surat berharga tersebut.
  7. Dalam hal dokumen *Underlying* Transaksi mencakup beberapa seri surat berharga maka Peserta Operasi Moneter Konvensional harus menatausahakan seri yang digunakan sebagai *Underlying* Transaksi dengan ketentuan sebagai berikut:
    - a. dokumen *Underlying* Transaksi harus dapat menunjukan dengan jelas seri surat berharga yang digunakan sebagai *Underlying* Transaksi dengan sisa jangka waktu dan jumlah yang memenuhi persyaratan; dan
    - b. dalam hal kustodian tidak dapat memisahkan statement per-seri surat berharga, maka dokumen *Underlying* Transaksi yang ditatausahakan bank harus disertai pencatatan bank atas seri surat yang digunakan sebagai *Underlying* Transaksi.
- 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
- 4. Peserta Operasi Moneter Konvensional hanya dapat mengajukan 2 (dua) kali koreksi untuk setiap pengajuan Kontrak Lindung Nilai.
- 5. Contoh pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan contoh pernyataan Peserta Operasi Moneter Konvensional mengenai pemenuhan persyaratan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sebagaimana tercantum dalam Lampiran II.

D. Pelaksanaan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP

- 1. Pengumuman Rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
  - a. Pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP memuat informasi:
    - 1) jenis Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia;
    - 2) jenis valuta asing;
    - 3) peserta transaksi;
    - 4) sarana pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan sarana pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP;
    - 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* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP; dan/atau
    - 13) informasi lain.
  - b. Kurs *spot* yang diumumkan Bank Indonesia berupa kurs acuan kurs JISDOR yang diumumkan oleh Bank Indonesia pada 1 (satu) Hari Kerja sebelum tanggal transaksi.
- 2. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
  - a. Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
  - b. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
  - c. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP memuat informasi paling sedikit berupa:
    - 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
  - 10) informasi lain.
- d. Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
  - f. Nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP paling banyak sebesar nilai nominal *Underlying* Transaksi.
  - g. Contoh pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP diterima oleh Bank Indonesia.
  - i. Nomor referensi Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud pada huruf i digunakan untuk mengidentifikasi Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dan kaitannya dengan dokumen *Underlying* Transaksi yang ditatausahakan oleh Peserta Operasi Moneter Konvensional.
3. Koreksi Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
    - a. Dalam hal pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
    - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
    - e. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
    - f. Koreksi atas pengajuan transaksi harus memenuhi ketentuan nilai nominal minimum pengajuan dan kelipatan nilai nominal pengajuan sebagaimana dimaksud pada butir D1.a.8)., dalam hal koreksi dilakukan atas nilai nominal pengajuan.

4. Konfirmasi atas Pengajuan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
  - a. Konfirmasi memuat informasi:
    - 1) *direction* (*sell and buy*);
    - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP tercantum dalam Lampiran III.

E. Setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP

1. Setelmen *First Leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
  - a. Peserta Operasi Moneter Konvensional menyampaikan konfirmasi setelmen Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sebagaimana dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:
    - 1) Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing sebesar nilai nominal transaksi ke rekening Bank Indonesia di Bank Koresponden; dan
    - 2) Peserta Operasi Moneter Konvensional menerima dana rupiah di Rekening Giro rupiah sebesar nilai nominal valuta asing transaksi dikalikan dengan kurs *spot* yang tercantum dalam pengumuman Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP pada tanggal transaksi.
2. Setelmen *Second Leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
 

Setelmen *second leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:

  - a. Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dikalikan dengan kurs *forward*; dan
  - b. Peserta Operasi Moneter Konvensional akan menerima dana valuta asing di rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.

- F. Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP
1. Selama *window time* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP, Peserta Operasi Moneter Konvensional dapat mengajukan permintaan informasi terkait premi perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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.
  2. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dilakukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
  3. Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia pada 2 (dua) Hari Kerja sebelum Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP jatuh waktu.
  4. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler dilakukan dalam *window time* perpanjangan transaksi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
  5. Jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sesuai dengan:
    - a. informasi yang dimuat dalam pengumuman rencana Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP; 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.
  6. Dalam hal Peserta Operasi Moneter Konvensional mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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 4 dibuka.
  7. Peserta Operasi Moneter Konvensional yang mengajukan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP harus memenuhi ketentuan:
    - a. menggunakan Kontrak Lindung Nilai yang masih berlaku;
    - b. nilai nominal perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP paling banyak sebesar nilai nominal *Underlying* Transaksi pada saat pengajuan perpanjangan; dan
    - c. penggunaan *Underlying Transaksi* selama periode Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
  8. Pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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.
- 9. Contoh pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP tercantum dalam Lampiran II.
- 10. Dalam hal pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP tidak memuat informasi sebagaimana dimaksud pada angka 8 Peserta Operasi Moneter Konvensional harus melakukan koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi tersebut.
- 11. Koreksi sebagaimana dimaksud pada angka 10 tidak dapat dilakukan terhadap:
  - a. nama Peserta Operasi Moneter Konvensional; dan
  - b. jangka waktu perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
- 12. Koreksi atas pengajuan perpanjangan transaksi sebagaimana dimaksud pada angka 10 diajukan melalui sarana *dealing system* berupa LSEG dan/atau sarana lain yang ditetapkan Bank Indonesia.
- 13. Koreksi dilakukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP sebagaimana pengumuman rencana transaksi.
- 14. Koreksi diajukan paling banyak 2 (dua) kali untuk setiap pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
- 15. 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.
- 16. Konfirmasi atas Perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP memuat informasi:
  - a. Konfirmasi memuat informasi:
    - 1) *direction (sell and buy)*;
    - 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* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.
- 17. Nilai nominal *netting* sebagaimana dimaksud pada butir 9.j. adalah pemindahan dana dengan memperhitungkan selisih kewajiban Peserta Operasi Moneter Konvensional dalam Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP.

18. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang sama dengan nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP dilakukan dengan ketentuan:

- a. nilai setelmen *netting* dalam denominasi rupiah dihitung dengan rumus:

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

- b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:

- 1) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
- 2) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.

19. Setelmen secara *netting* untuk nilai nominal perpanjangan transaksi yang lebih kecil atau lebih besar dari nilai nominal Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP 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> Beli Lindung Nilai Konvensional IP | = | nilai nominal valuta asing transaksi awal | - | nilai nominal valuta asing saat perpanjangan transaksi |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|-------------------------------------------|---|--------------------------------------------------------|

- b. dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan:

- 1) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mentransfer dana valuta asing ke rekening Peserta Operasi Moneter Konvensional di Bank Koresponden; atau
- 2) nilai setelmen *netting* negatif, Peserta Operasi Moneter Konvensional mentransfer dana valuta asing ke rekening Bank Indonesia 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> Beli Lindung Nilai Konvensional IP | = | $\left[ \begin{array}{l} \text{nilai nominal} \\ \text{valuta asing} \\ \text{transaksi} \\ \text{awal} \end{array} \right] \times \left[ \begin{array}{l} \text{kurs setelmen} \\ 2nd \text{ leg} \\ \text{transaksi} \end{array} \right]$ | - | $\left[ \begin{array}{l} \text{nilai nominal} \\ \text{valuta asing saat} \\ \text{perpanjangan} \\ \text{transaksi} \end{array} \right] \times \left[ \begin{array}{l} \text{kurs 1st leg} \\ \text{saat} \\ \text{perpanjangan} \\ \text{transaksi} \end{array} \right]$ |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

- 1) nilai setelmen *netting* positif, Bank Indonesia mendebit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional; atau
- 2) nilai setelmen *netting* negatif, Bank Indonesia mengkredit Rekening Giro rupiah Peserta Operasi Moneter Konvensional, sebesar nominal nilai setelmen *netting*.

20. Contoh perhitungan setelmen secara *netting* perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP tercantum dalam Lampiran IV.

LAMPIRAN I  
JENIS DOKUMEN *UNDERLYING* TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI  
KONVENSIIONAL REGULER

1. TRANSAKSI BERJALAN (*CURRENT ACCOUNT*)
  - a. Bukti kegiatan ekspor impor barang dan/atau jasa Indonesia, mencakup:
    - 1) Pemberitahuan Impor Barang;
    - 2) Pemberitahuan Ekspor Barang;
    - 3) *letter of credit* dan perubahan *letter of credit*; dan
    - 4) wesel.
  - b. Faktur pajak (*tax invoice*) atas perdagangan barang dan jasa dan/atau kegiatan investasi.
  - c. Dokumen repatriasi dana untuk kepentingan pengampunan pajak.
  - d. Bukti penghasilan investasi dalam rupiah yang diperoleh antara lain berupa dividen dan kupon/imbil hasil.
  - e. Dokumen yang memberikan informasi kebutuhan rupiah dan/atau valuta asing untuk tujuan remitansi atas penghasilan yang diterima pekerja asing ke penerima di negara asalnya.
  - f. Dokumen tagihan atau kewajiban pembayaran, mencakup:
    - 1) *invoice* atau *commercial invoice* dengan syarat paling lama 3 (tiga) bulan sejak tanggal jatuh waktu;
    - 2) nota debet (*debit note*) yang informasi di dalamnya dapat diverifikasi oleh Bank;
    - 3) kontrak penjualan (*sales contract*) yang mencantumkan masa berlaku dan nominal kontrak;
    - 4) *list of invoices* yang didukung oleh pernyataan dari Penduduk atau bukan Penduduk mengenai:
      - a) keabsahan *list of invoices*;
      - b) tanggung jawab Penduduk atau bukan Penduduk untuk mengadministrasikan *invoice* dimaksud; dan
      - c) komitmen untuk menyediakan *invoice* apabila dibutuhkan oleh Bank.
  - g. Kontrak jasa konsultan antara Penduduk dan bukan Penduduk.
  - h. Perjanjian royalti (*royalty agreement*) antara Penduduk dan bukan Penduduk yang disertai dengan dokumen pendukung lainnya.
  - i. Risalah Rapat Umum Pemegang Saham dan/atau tambahan dokumen lain yang menggambarkan besarnya nominal rupiah dan/atau valuta asing dari dividen yang diterima.
  - j. Dokumen *Underlying* Transaksi terkait transaksi berjalan lainnya yang bersifat final.
2. TRANSAKSI FINANSIAL (*FINANCIAL ACCOUNT*)
  - a. Bukti konfirmasi penjualan atau pembelian investasi portofolio, antara lain berupa *trade confirmation* yang disampaikan melalui *Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication message*, *Reuters Monitoring Dealing System*, atau *Bloomberg ticket*.
  - b. Perjanjian pembelian atau penjualan investasi instrumen keuangan oleh bukan Penduduk di Indonesia atau oleh Penduduk di luar Indonesia.

- c. Bukti kepemilikan investasi portofolio yang diterbitkan oleh pihak yang berwenang. Bank meminta bukti kepemilikan investasi portofolio (*portfolio investment*) kepada pelaku transaksi di pasar valuta asing berdasarkan prinsip syariah paling sedikit 1 (satu) kali dalam 1 (satu) bulan.
  - d. Bukti kepemilikan saham pada investasi langsung antara lain berupa anggaran dasar perusahaan. Bank meminta bukti kepemilikan investasi langsung (*direct investment*) kepada pelaku transaksi di pasar valuta asing berdasarkan prinsip syariah paling sedikit 1 (satu) kali dalam 1 (satu) bulan.
  - e. Dokumen kredit atau pembiayaan berupa:
    - 1) surat perjanjian kredit atau pembiayaan (*loan agreement*) atau dokumen terkait lainnya yang menunjukkan jadwal dan jumlah pembayaran; dan
    - 2) bukti pencairan kredit, antara lain mutasi rekening dari kreditur kepada debitur, perintah transfer dana, seperti MT 103 dan formulir permohonan pengiriman uang yang telah divalidasi.
  - f. Dokumen *Underlying* Transaksi terkait transaksi finansial lainnya yang bersifat final.
3. TRANSAKSI MODAL (*CAPITAL ACCOUNT*)
- a. Akta jual beli dan bukti kepemilikan pihak asing atas aset terkait dengan penjualan aset di Indonesia.
  - b. Dokumen *Underlying* Transaksi terkait transaksi modal lainnya yang bersifat final.
4. PEMBIAYAAN DARI BANK KEPADA PENDUDUK UNTUK TUJUAN PERDAGANGAN DAN INVESTASI
- a. Dokumen akad pembiayaan dari Bank kepada Penduduk untuk tujuan perdagangan dan investasi dalam valuta asing.
  - b. Dokumen *Underlying* Transaksi terkait pembiayaan dari Bank kepada Penduduk untuk tujuan perdagangan dan investasi lainnya yang bersifat final.
5. PERDAGANGAN BARANG DAN JASA DI DALAM NEGERI
- a. Perdagangan dalam negeri yang menggunakan surat kredit berdokumen dalam negeri.
  - b. Dokumen *Underlying* Transaksi terkait perdagangan barang dan jasa di dalam negeri lainnya yang bersifat final.
6. *UNDERLYING* TRANSAKSI LAIN YANG DITETAPKAN BANK INDONESIA
- a. Dokumen *Underlying* Transaksi untuk penyelenggara kegiatan usaha penukaran valuta asing bukan Bank berupa jumlah neto penyelenggara jual kegiatan usaha penukaran valuta asing bukan Bank kepada nasabah selama periode tertentu.
  - b. Bukti keikutsertaan nasabah dalam tender dan penyediaan jaminan/bank garansi dalam mata uang asing.
  - c. Surat permintaan penyetoran dana atas transaksi tertentu yang dipersyaratkan oleh otoritas yang berwenang.
  - d. Dokumen yang terkait dengan pembagian waris seperti bukti penjualan harta waris dan bukti hubungan keluarga dengan pemberi waris (seperti kartu keluarga) terkait dengan ahli waris yang telah menetap di luar negeri sebagai *permanent resident* (yang didukung dengan dokumen terkait).

- e. Beban operasional dalam mata uang rupiah dari *representative office* badan hukum asing atau lembaga asing lainnya antara lain berupa pembayaran gaji dan tagihan rekening *utilities* (telepon, listrik, gas, air) baik berupa dokumen final maupun prakiraan.
- f. Dokumen *Underlying* Transaksi lainnya.

LAMPIRAN II

PENGAJUAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL  
REGULER DAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

A. CONTOH PENGAJUAN KONTRAK LINDUNG NILAI DAN TRANSAKSI SWAP  
BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER

BERSAMA INI BANK “ABC” MENYATAKAN BAHWA TRANSAKSI SWAP BELI  
LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER TELAH MEMENUHI SELURUH  
PERSYARATAN DALAM KETENTUAN YANG MENGATUR TRANSAKSI SWAP  
BELI 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* PERJANJIAN PEMBIAYAAN LUAR NEGERI NASABAH PT “XYZ” DENGAN BANK “EFG”
5. SISA JANGKA WAKTU 2 TAHUN (720 HARI) DIHITUNG SEJAK TANGGAL VALUTA SWAP
6. NOMOR DOKUMEN *UNDERLYING*: XYZ1234562022
7. NILAI NOMINAL USD 10 JUTA

TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER

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 USD 10 JUTA
7. MY USD TO BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
8. MY IDR THRU RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

B. CONTOH PENGAJUAN PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG  
NILAI KONVENSIONAL REGULER

PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL  
REGULER:

1. NOMOR REFERENSI BIRU04012324BS-0001
2. NAMA BANK “ABC”
3. NILAI NOMINAL *OUTSTANDING UNDERLYING* TRANSAKSI USD 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 USD 9 JUTA
9. MY USD TO BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
10. MY IDR THRU RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

C. CONTOH PENGAJUAN KONTRAK LINDUNG NILAI DAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

BERSAMA INI BANK “ABC” MENYATAKAN BAHWA TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP TELAH MEMENUHI SELURUH PERSYARATAN DALAM KETENTUAN YANG MENGATUR TRANSAKSI SWAP BELI 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* INVESTASI PORTOFOLIO SUN NASABAH INVESTOR GLOBAL PT “XYZ” MELALUI BANK “ABC”
5. SISA JANGKA WAKTU 1 (SATU) TAHUN (360 HARI) DIHITUNG SEJAK TANGGAL VALUTA SWAP
6. NOMOR DOKUMEN *UNDERLYING*: XYZ1234562022
7. NILAI NOMINAL USD 10 JUTA

TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

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 USD 10 JUTA
7. MY USD TO BK OF XXXX AC.ZZZZZZZZZZ CUID ABCDE
8. MY IDR THRU RTGS BI CODE XXXX ACC. YYY.YYY.YYY.YYY

D. CONTOH PENGAJUAN PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP:

1. NOMOR REFERENSI
2. NAMA BANK “ABC”
3. NILAI NOMINAL *OUTSTANDING UNDERLYING* TRANSAKSI USD 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 USD 9 JUTA
9. MY USD 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* BELI LINDUNG NILAI  
REGULER DAN TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG NILAI IP

CONTOH KONFIRMASI ATAS PENGAJUAN TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG  
NILAI REGULER DAN TRANSAKSI *SWAP* BELI LINDUNG NILAI IP

- a. NOMOR REFERENSI KONTRAK LINDUNG NILAI BIRU04012325B-0001
- b. WE SELL AND BUY USD 100 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 USD TO FEDERAL RESERVE BANK OF NY, NY A/C NO 021084238 BIC  
CODE FRNYUS33
- g. MY IDR TO RTGS “ABC”

## LAMPIRAN IV

PERHITUNGAN SETELMEN SECARA *NETTING* PADA PERPANJANGAN  
TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER DAN  
TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP

- A. CONTOH PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING* PADA PERPANJANGAN  
TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER DAN  
TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP UNTUK NILAI  
NOMINAL PERPANJANGAN TRANSAKSI YANG SAMA
1. TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL REGULER  
ATAU TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL IP
    - a. Jangka waktu: 12 bulan.
    - b. Nominal: USD20 juta.
    - c. Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
    - d. Tanggal valuta (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
    - e. Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XX: Rp17.000,00.
    - f. Premi *swap* 12 bulan: Rp600,00.
    - g. Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
    - h. Kurs setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1: Rp17.600,00.
  2. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI  
KONVENSIONAL REGULER ATAU TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG  
NILAI KONVENSIONAL IP
    - a. Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
    - b. Nominal: USD20 juta.
    - c. Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
    - d. Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2): 4 Agustus 20XY.
    - e. Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XY: Rp17.500,00.
    - f. Premi *swap* 12 bulan: Rp650,00
  3. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*
    - a. Saat Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional Reguler  
atau Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional IP jatuh  
waktu, perhitungan setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1 pada tanggal 6  
Agustus 20XY sebagai berikut:
      - 1) Bank Indonesia akan mengembalikan ke Bank: USD20 juta.
      - 2) Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia:  $(Rp17.000,00 + Rp600,00) \times USD20 \text{ juta} = Rp352 \text{ miliar}$
    - b. Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai  
Konvensional Reguler atau Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai  
Konvensional IP, perhitungan setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2 pada  
tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
      - 1) Bank Indonesia akan menerima transfer dari Bank: USD20  
juta.
      - 2) Bank akan menerima dari Bank Indonesia:  $Rp17.500,00 \times USD20 \text{ juta} = Rp350 \text{ miliar}$ .
    - c. Setelmen Transaksi bersifat *netting* pada tanggal 6 Agustus 20XY  
sebagai berikut:
      - 1) Setelmen USD = USD20 juta USD20 juta = USD0.
      - 2) Setelmen Rp = Rp352 miliar – Rp350 miliar = Rp2 miliar

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting* maka Bank Indonesia mendebit rekening giro rupiah Bank pada tanggal 6 Agustus 20XY sebesar Rp2 miliar.

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

1. NILAI NOMINAL YANG LEBIH KECIL

a. TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

- 1) Jangka waktu: 12 bulan.
- 2) Nominal: USD20 juta.
- 3) Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
- 4) Tanggal valuta (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
- 5) Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XX: Rp17.000,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp600,00.
- 7) Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
- 8) Kurs setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1: Rp17.600,00

b. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

- 1) Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
- 2) Nominal: USD15 juta.
- 3) Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
- 4) Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2): 6 Agustus 20XY.
- 5) Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XY: Rp17.500,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp650,00

c. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*

- 1) Saat Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia jatuh waktu, perhitungan setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
  - a) Bank Indonesia mengembalikan ke Bank: USD20 juta
  - b) Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia:  $(Rp17.000,00 + Rp600,00) \times USD20 \text{ juta} = Rp352 \text{ miliar}$ .
- 2) Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia, perhitungan setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
  - a) Bank Indonesia menerima transfer dari Bank: USD15 juta.
  - b) Bank akan menerima dari Bank Indonesia:  $Rp17.500,00 \times USD15 \text{ juta} = Rp262,5 \text{ miliar}$ .
- 3) Setelmen transaksi secara *netting* pada tanggal 14 Februari 20XY:
  - a) Setelmen USD = USD20 juta – USD15 juta = USD5 juta.
  - b) Setelmen Rp = Rp352 miliar - Rp262,5 miliar = Rp89,5 miliar.

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting*, maka:

- 1) Bank Indonesia akan mentransfer valuta asing ke rekening Bank di bank koresponden sebesar USD5 juta.
- 2) Bank Indonesia mendebet rekening giro rupiah Bank di BI sebesar Rp89,5 miliar.

## 2. NILAI NOMINAL YANG LEBIH BESAR

### a. TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

- 1) Jangka waktu: 12 bulan.
- 2) Nominal: USD20 juta.
- 3) Tanggal transaksi: 4 Agustus 20XX.
- 4) Tanggal valuta (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XX.
- 5) Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XX: Rp17.000,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp600,00.
- 7) Tanggal valuta jatuh waktu (setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1): 6 Agustus 20XY.
- 8) Kurs setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1: Rp17.600,00

### b. PERPANJANGAN TRANSAKSI SWAP BELI LINDUNG NILAI KONVENSIONAL KEPADA BANK INDONESIA

- 1) Jangka waktu perpanjangan: 12 bulan.
- 2) Nominal: USD25 juta.
- 3) Tanggal transaksi perpanjangan: 4 Agustus 20XY.
- 4) Tanggal valuta perpanjangan (setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2): 6 Agustus 20XY.
- 5) Kurs Jakarta *Interbank Spot Dollar Rate* (JISDOR) 3 Agustus 20XY: Rp17.500,00.
- 6) Premi *swap* 12 bulan: Rp650,00

### c. PERHITUNGAN SETELMEN *NETTING*

- 1) Saat Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia jatuh waktu, perhitungan setelmen 2<sup>nd</sup> *leg swap* 1 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
  - a) Bank Indonesia mengembalikan ke Bank: USD20 juta
  - b) Bank akan mengembalikan ke Bank Indonesia:  $(Rp17.000,00 + Rp600,00) \times USD20 \text{ juta} = Rp352 \text{ miliar}$ .
- 2) Saat perpanjangan Transaksi *Swap* Beli Lindung Nilai Konvensional kepada Bank Indonesia, perhitungan setelmen 1<sup>st</sup> *leg swap* 2 pada tanggal 6 Agustus 20XY sebagai berikut:
  - a) Bank Indonesia menerima transfer dari Bank: USD25 juta.
  - b) Bank akan menerima dari Bank Indonesia:  $Rp17.500,00 \times USD25 \text{ juta} = Rp362,5 \text{ miliar}$ .
- 3) Setelmen transaksi secara *netting* pada tanggal 6 Agustus 20XY:
  - a) Setelmen USD = USD20 juta – USD25 juta = (USD5 juta).
  - b) Setelmen Rp = Rp352 miliar – Rp437,5 miliar = (Rp85,5 miliar.)

Berdasarkan hasil perhitungan setelmen secara *netting*, maka:

- a) Bank akan mentransfer valuta asing ke rekening BI di bank koresponden sebesar USD5 juta.
- b) Bank Indonesia mengkredit rekening giro rupiah Bank di BI.