

LAPORAN NSFR CONSOL

Nama Bank : Citibank N.A., Indonesia
Posisi Laporan : 28-Jun-2019

1	Modul:	Q1 - 2019					Total Nilai Tertimbang	Q2 - 2019					Total Nilai Tertimbang
		Nilai Tertecat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang		Nilai Tertecat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang	
		Tanpa Jangka Waktu'	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun			Tanpa Jangka Waktu'	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun		
2	Modal sesuai POJK KPMM	9,892,661,978,071	0	0	7,120,000,000,000	17,012,661,978,071	10,143,115,169,471	0	0	7,063,750,000,000	17,206,865,169,471		
3	Instrumen modal lainnya	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
4	Simpanan yang berasal dari nasabah perorangan dan Pendanaan yang berasal dari nasabah usaha mikro dan usaha kecil:	10,626,791,101,337	17,406,723,252,225	1,035,101,928,718	22,321,959,214	17,454,776,497,679	11,063,052,131,630	15,005,987,987,808	1,352,145,230,224	22,502,252,434	16,654,273,004,483		
5	Simpanan dan Pendanaan stabil	8,818,255,124,028	9,553,119,819,946	525,671,388,212	11,160,979,607	8,289,202,562,987	9,034,788,780,309	8,298,034,086,066	681,258,279,374	11,251,126,217	8,176,628,094,744		
6	Simpanan dan Pendanaan kurang stabil	1,808,535,977,309	7,853,603,432,279	509,430,540,506	11,160,979,607	9,165,573,934,692	2,028,263,351,321	6,707,953,901,742	670,886,950,850	11,251,126,217	8,477,644,909,739		
7	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi:	33,352,522,721,527	9,732,022,626,803	310,461,131,144	1,000,023,050,430	21,832,962,158,847	35,542,141,323,427	11,159,502,647,347	271,086,492,388	2,000,000,000,000	24,815,297,420,507		
8	Simpanan operasional	32,154,609,803,656	362,914,944	2,136,000,000	0	16,078,554,359,300	34,241,214,860,091	2,834,882,741,405	0	0	18,538,048,800,748		
9	Pendanaan lainnya yang berasal dari nasabah korporasi	1,197,912,917,871	9,731,659,711,859	308,325,131,144	1,000,023,050,430	5,754,407,799,547	1,300,926,463,336	8,324,619,905,942	271,086,492,388	2,000,000,000,000	6,277,248,619,759		
10	Liabilitas yang memiliki pasangan aset yang saling bergantung	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
11	Liabilitas dan ekuitas lainnya:	3,257,567,067,593	1,630,999,947,629	(14,745,429,545)	26,597,973,126	19,225,258,354	1,572,657,119,124	1,353,324,898,628	(601,482,724)	59,182,447,190	58,881,705,828		
12	NSFR liabilitas derivatif	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
13	ekuitas dan liabilitas lainnya yang tidak masuk dalam kategori di atas	3,257,567,067,593	1,630,999,947,629	(14,745,429,545)	26,597,973,126	19,225,258,354	1,572,657,119,124	1,353,324,898,628	(601,482,724)	59,182,447,190	58,881,705,828		
14	Total ASF					56,319,625,892,951					58,735,317,300,289		
Komponen RSF		Q1 - 2019					Total Nilai Tertimbang	Q2 - 2019					Total Nilai Tertimbang
		Nilai Tertecat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang		Nilai Tertecat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang	
		Tanpa Jangka Waktu'	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun			Tanpa Jangka Waktu'	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun		
15	Total HQLA dalam rangka perhitungan NSFR					656,662,175,333					576,212,250,843		
16	Simpanan pada lembaga keuangan lain untuk tujuan operasional	1,661,264,552,718	4,370,598,245,910	0	569,600,000,000	3,585,531,399,314	1,969,009,211,740	6,689,441,172,808	377,662,687	565,100,000,000	4,894,514,023,618		
17	Pinjaman dengan kategori Lancar dan Dalam Perhatian Khusus (performing) dan surat berharga kepada lembaga keuangan yang dijamin dengan HQLA Level 1	1,320,274,184,694	24,799,998,652,967	10,095,115,633,929	17,129,635,232,048	32,953,068,011,198	1,109,946,366,411	25,173,035,575,186	9,322,406,288,823	17,651,741,351,905	32,742,513,737,650		
18	kepada lembaga keuangan yang dijamin bukan HQLA Level 1 dan pinjaman kepada lembaga keuangan tanpa jaminan	0	1,066,111,422,869	568,795,574,121	142,314,337,704	586,628,838,195	0	1,763,080,428,510	0	141,190,213,316	405,652,277,593		
19	kepada perusahaan non-keuangan, nasabah perorangan dan nasabah usaha mikro dan usaha kecil, Pemerintah Indonesia, pemerintah negara lain, Bank Indonesia, bank sentral negara lain dan entitas sektor publik, yang diantaranya:	1,320,274,184,694	23,086,436,201,988	6,127,064,431,168	14,512,911,057,393	28,262,998,900,056	1,109,946,366,411	22,334,850,564,899	6,081,457,041,862	15,045,775,690,985	28,107,009,507,129		
20	memenuhi kualifikasi untuk mendapat bobot risiko 35% atau kurang, sesuai SE OJK ATMR untuk Risiko Kredit	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
21	Kredit beragun rumah tinggal yang tidak sedang dijamin, yang diantaranya:	0	159,827,707	172,528,703	126,905,010,794	108,035,437,380	0	125,529,996	0	120,481,065,958	102,471,671,062		
22	memenuhi kualifikasi untuk mendapat bobot risiko 35% atau kurang, sesuai SE OJK ATMR untuk Risiko Kredit	0	54,244,843	0	115,807,084,179	75,301,727,138	0	0	136,042,681	116,170,459,519	75,578,820,028		
23	Surat Berharga yang tidak sedang dijamin, tidak gagal bayar, dan tidak masuk sebagai HQLA, termasuk saham yang	0	647,236,955,560	3,399,083,099,937	2,231,697,741,978	3,920,103,108,429	0	1,074,979,051,781	3,240,813,204,280	2,228,123,922,127	4,051,801,461,839		
24	Aset yang memiliki pasangan liabilitas yang saling bergantung	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
25	Aset lainnya:	2,549,391,716,323	1,675,930,562,092	284,351,710,356	2,055,947,318,966	6,565,621,307,738	1,745,304,039,984	1,762,191,230,697	138,285,945,763	2,220,244,502,696	5,866,025,719,140		
26	Komoditas fisik yang diperdagangkan, termasuk emas	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
27	Kas, surat berharga dan aset lainnya yang dicatat sebagai initial margin untuk kontrak derivatif dan kas atau aset lain yang												
28	NSFR aset derivatif		321,350,695,133	22,815,273,002	224,341,610,869	568,507,579,005		333,344,720,484	41,610,092,821	287,927,303,308	662,882,116,614		
29	NSFR liabilitas derivatif sebelum dikurangi dengan variation margin		79,978,397,941	12,661,467,558	26,728,798,611	119,368,664,110		91,101,129,983	3,508,487,120	23,387,943,826	117,997,560,929		
30	Seluruh aset lainnya yang tidak masuk dalam kategori di atas**)	2,549,391,716,323	1,274,601,469,018	248,874,969,796	1,804,876,909,486	5,877,745,064,622	1,745,304,039,984	1,337,745,380,230	93,167,365,821	1,908,929,255,561	5,085,146,041,597		
31	Rekening Administratif		31,009,335,781,634	24,932,058,581,301	21,185,695,145,115	1,824,944,547,519,40		31,510,381,109,590	26,464,933,321,517	21,217,144,938,334	1,764,261,310,486,50		
32	Total RSF					45,585,827,441,102					45,843,527,041,738		
33	Rasio Pendanaan Stabil Bersih (Net Stable Funding Ratio (%))					123.55%					128.12%		

Qualitative Disclosure NSFR

Nama Bank CITIBANK, N.A., INDONESIA BRANCH

Bulan Laporan 28-Jun-2019

Di kuartal 2 2019, jumlah dana stabil yang tersedia (ASF; Available Stable Funding) sebesar 58.7 triliun rupiah dibandingkan dengan jumlah dana stabil yang dibutuhkan (RSF; Required Stable Funding) sebesar 45.8 triliun rupiah, sehingga Net Stable Funding Ratio (NSFR) berada di level 128.12%, yang masih berada di atas batas minimum 100% yang ditentukan. Hal ini mencerminkan bahwa bank memiliki ketahanan likuiditas yang sangat baik dalam jangka waktu setahun ke depan.

Rasio NSFR mengalami peningkatan sebesar 4.57% pada kuartal 2 2019 dibandingkan dengan kuartal sebelumnya. Peningkatan rasio NSFR terutama berasal dari peningkatan faktor ASF sebesar 2.4 triliun rupiah yang terutama berasal dari pos pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, yang meningkat jauh lebih besar jika di bandingkan dengan kenaikan pada faktor RSF sebesar 257.7 miliar rupiah yang terutama berasal dari pos simpanan pada lembaga keuangan lain untuk tujuan operasional.

Komposisi dana stabil yang tersedia terdiri dari capital, sumber pendanaan dari retail maupun wholesale. Sedangkan komposisi dana stabil yang dibutuhkan kebanyakan datang dari performing loan dan sekuritas.