

LAPORAN NSFR CONSOL

Nama Bank : Citibank N.A., Indonesia
 Posisi Laporan : 31-Mar-2023

Komponen ASF	Q2 - 2022					Q3 - 2022				
	Nilai Tertarcat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang	Nilai Tertarcat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang
	Tanpa Jangka Waktu ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun		Tanpa Jangka Waktu ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun	
1 Modal:	8,552,587	0	0	7,783,750	16,336,337	9,121,298	0	0	7,497,250	16,618,548
2 Modal sesuai POIK KPMM	8,552,587	0	0	7,783,750	16,336,337	9,121,298	0	0	7,497,250	16,618,548
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:	6,667,725	6,365,972	99,503	4,980	12,117,111	6,289,431	6,287,582	150,309	6,428	11,728,886
5 Simpanan dan Pendanaan stabil	5,156,100	688,919	0	0	5,552,768	4,863,347	494,011	0	0	5,089,400
6 Simpanan dan Pendanaan kurang stabil	1,511,625	5,677,053	99,503	4,980	6,564,343	1,426,084	5,793,571	150,309	6,428	6,639,396
7 Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi:	55,334,848	9,174,345	260,957	0	31,498,677	56,322,283	10,837,734	714,961	1,130,588	33,787,578
8 Simpanan operasional	53,562,260	0	2,335	0	26,782,297	53,761,487	0	2,249	1,124,588	28,006,456
9 Pendanaan lainnya yang berasal dari nasabah korporasi	1,772,588	9,174,345	258,622	0	4,716,380	2,560,797	10,837,734	712,712	6,000	5,781,122
10 Liabilitas yang memiliki pasangan aset yang saling bergantung	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
11 Liabilitas dan ekuitas lainnya	3,547,361	29,538	(26,815)	(39,335)	(52,743)	4,016,292	(341,195)	(55,942)	6,557	(21,414)
12 NSFR liabilitas derivatif	0	0	0	0	0	19	0	0	0	0
13 ekuitas dan liabilitas lainnya yang tidak masuk dalam kategori di atas	3,547,361	29,538	(26,815)	(39,335)	(52,743)	4,016,292	(341,214)	(55,942)	6,557	(21,414)
14 Total ASF					59,899,382					62,113,597
Komponen RSF	Q2 - 2022					Q3 - 2022				
	Nilai Tertarcat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang	Nilai Tertarcat Berdasarkan Sisa Jangka Waktu (Dalam Juta Rupiah)				Total Nilai Tertimbang
	Tanpa Jangka Waktu ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun		Tanpa Jangka Waktu ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - 1 tahun	≥ 1 tahun	
15 Total HQLA dalam rangka perhitungan NSFR					416,359					574,400
16 Simpanan pada lembaga keuangan lain untuk tujuan operasional	1,461,659	880,787	311,350	0	1,266,898	1,470,630	985,580	299,890	0	1,378,050
17 Pinjaman dengan kategori Lancar dan Dalam Perhatian Khusus (performing) dan surat berharga	1,430,144	38,143,456	13,367,588	15,618,723	34,862,856	1,019,463	32,486,528	20,210,405	11,441,667	33,114,612
18 kepada lembaga keuangan yang dijamin dengan HQLA Level 1	0	14,949,674	5,864,362	2,469,674	6,896,822	0	9,800,215	8,779,969	0	5,370,006
19 kepada lembaga keuangan yang dijamin bukan dengan HQLA Level 1 dan pinjaman kepada lembaga keuangan tanpa jaminan	0	611	0	138,834	138,925	0	169,374	0	139,117	164,523
20 kepada perusahaan non-keuangan, nasabah perorangan dan nasabah usaha mikro dan usaha kecil, Pemerintah Indonesia, pemerintah	1,430,144	19,591,882	6,374,969	10,270,866	23,143,806	1,019,463	19,702,673	8,194,490	9,390,126	22,949,652
21 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
22 Kredit bergang rumah tinggal yang tidak sedang dijamin, yang ditanpanya	0	112	197	116,197	98,923	0	0	0	0	0
23 memenuhi kualifikasi untuk mendapat bobot risiko 35% atau kurang, sesuai SE OJK ATMR untuk Risiko Kredit	0	0	0	49,587	32,232	0	121	167	101,176	65,909
24 Surat Berharga yang tidak sedang dijamin, tidak gagal bayar, dan tidak masuk sebagai HQLA, termasuk saham yang diperdagangkan	0	3,601,177	1,128,059	2,573,564	4,552,148	0	2,814,146	3,235,779	1,811,248	4,564,523
25 Aset yang memiliki pasangan liabilitas yang saling bergantung	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
26 Aset lainnya:	639,238	1,649,535	293,348	1,728,803	4,300,924	503,834	1,308,866	393,767	1,620,858	3,827,326
27 Komoditas fisik yang diperdagangkan, termasuk emas	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
28 Kas, surat berharga dan aset lainnya yang dicatat sebagai initial margin untuk kontrak derivatif dan kas atau aset lain yang diserahkan	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
29 NSFR aset derivatif	0	489,854	138,740	12,947	641,141	0	329,442	61,145	20,474	411,061
30 NSFR liabilitas derivatif sebelum dikurangi dengan variation margin	0	125,851	23,004	2,604	151,279	0	131,267	15,304	3,817	150,408
31 Seluruh aset lainnya yang tidak masuk dalam kategori di atas**)	639,238	1,034,230	121,604	1,713,432	3,508,503	503,834	848,137	317,318	1,596,567	3,265,856
32 Rekening Administratif	0	33,991,743	28,023,794	21,910,992	1,628,023,81	0	29,928,766	30,489,529	22,752,437	1,623,473,19
33 Total RSF					42,491,061					46,517,861
34 Rasio Pendanaan Stabil Bersih (Net Stable Funding Ratio (%))					140,97%					153,30%

Qualitative Disclosure NSFR

Nama Bank CITIBANK, N.A., INDONESIA BRANCH

Bulan Laporan 31-Mar-2023

Di kuartal 1 2023, jumlah dana stabil yang tersedia (ASF; Available Stable Funding) sebesar 62.11 triliun rupiah dibandingkan dengan jumlah dana stabil yang dibutuhkan (RSF; Required Stable Funding) sebesar 40.51 triliun rupiah, sehingga Net Stable Funding Ratio (NSFR) berada di level 153.30%, 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 12.33% pada kuartal 1 2023 dibandingkan dengan kuartal sebelumnya. Peningkatan pada rasio NSFR terutama berasal dari penurunan pada faktor RSF disertai dengan peningkatan pada faktor ASF. Peningkatan pada faktor ASF terutama berasal dari pos pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi sementara penurunan pada faktor RSF terutama berasal dari pinjaman dengan kategori lancar dan dalam perhatian khusus (performing) dan surat berharga.

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