

PERUBAHAN KEDUA ATAS SURAT EDARAN BANK INDONESIA NOMOR 16/2/DPM TANGGAL 28 JANUARI 2014 PERIHAL TRANSAKSI SWAP LINDUNG NILAI KEPADA BANK INDONESIA (Surat Edaran Kepala Departemen Pengelolaan Moneter Bank Indonesia Nomor 18/13/DPM, tanggal 24 Mei 2016)

Kepada
SEMUA BANK UMUM DEvisa
DI INDONESIA

Sehubungan dengan berlakunya Peraturan Bank Indonesia Nomor 15/17/PBI/2013 tentang Transaksi *Swap* Lindung Nilai Kepada Bank Indonesia (Lembaran Negara Republik Indonesia Tahun 2013 Nomor 237, Tambahan Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 5480) sebagaimana telah diubah beberapa kali, terakhir dengan Peraturan Bank Indonesia Nomor 18/8/PBI/2016 tentang Perubahan Kedua atas Peraturan Bank Indonesia Nomor 15/17/PBI/2013 tentang Transaksi *Swap* Lindung Nilai Kepada Bank Indonesia (Lembaran Negara Republik Indonesia Tahun 2016 Nomor 94, Tambahan Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 5881), yang selanjutnya disebut PBI, dan dalam rangka memperkuat cadangan devisa serta memperluas jenis valuta asing yang digunakan dalam transaksi *swap* lindung nilai kepada Bank Indonesia, perlu dilakukan perubahan kedua atas Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/2/DPM tanggal 28 Januari 2014 perihal Transaksi *Swap* Lindung Nilai Kepada Bank Indonesia sebagaimana telah diubah dengan Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/19/DPM tanggal 28 November 2014 sebagai berikut:

1. Ketentuan huruf A diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:

A. DOKUMEN UNDERLYING TRANSAKSI SWAP LINDUNG NILAI KEPADA BANK INDONESIA

1. Dokumen *underlying* milik Bank dalam Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam Pasal 2 ayat (4) PBI, diatur sebagai berikut:
 - a. Dalam hal *Underlying* Transaksi berupa Pinjaman Luar Negeri Bank dalam bentuk perjanjian kredit maka dokumen *un-*

derlying berupa perjanjian kredit (*loan agreement*) antara Bank dengan kreditur Bank.

- b. Dalam hal *Underlying* Transaksi berupa Pinjaman Luar Negeri Bank dalam bentuk penerbitan surat utang maka dokumen *underlying* antara lain berupa laporan penjualan surat utang yang dikeluarkan oleh *global custody*.
- c. Dalam hal *Underlying* Transaksi berupa dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) maka dokumen *underlying* diatur sebagai berikut:
 - 1) Untuk dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) yang tidak mengalami perubahan maka dokumen *underlying* berupa surat dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) dari kantor pusat Bank atau dari Bank kepada otoritas yang berwenang.
 - 2) Untuk dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) yang mengalami perubahan maka dokumen *underlying* berupa surat persetujuan otoritas yang berwenang atas perubahan dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) yang disampaikan kantor pusat Bank atau Bank.
2. Dokumen *underlying* milik nasabah dalam Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam Pasal 2 ayat (5) PBI, berupa dokumen transaksi *swap* jual antara Bank dengan nasabah dalam bentuk *deal ticket* atau kontrak *swap*.
3. Dokumen *Underlying* Transaksi *swap* jual

antara Bank dengan nasabah diatur sebagai berikut:

- a. *Underlying* Transaksi berupa Pinjaman Luar Negeri dalam bentuk perjanjian kredit, maka dokumen *underlying* transaksi berupa perjanjian kredit (*loan agreement*) antara nasabah dengan kreditur nasabah.
 - b. *Underlying* Transaksi berupa Pinjaman Luar Negeri dalam bentuk penerbitan surat utang, maka dokumen *underlying* transaksi antara lain berupa laporan penjualan surat utang yang dikeluarkan oleh *global custody*.
 - c. *Underlying* Transaksi berupa Investasi Langsung, maka dokumen *underlying* transaksi antara lain berupa dokumen terkait dengan realisasi investasi.
 - d. *Underlying* Transaksi berupa Devisa Hasil Ekspor (DHE), maka dokumen *underlying* transaksi antara lain berupa *Authenticated SWIFT message* (MT910) yang berisi informasi penerimaan DHE.
 - e. *Underlying* Transaksi berupa investasi pada infrastruktur pembangunan sarana umum dan/atau produksi, maka dokumen *underlying* transaksi berupa dokumen kegiatan investasi yang diatur sebagai berikut:
 - 1) dalam hal pemilik proyek infrastruktur adalah pemerintah, maka dokumen kegiatan investasi antara lain berupa dokumen persetujuan proyek dari instansi yang berwenang;
 - 2) dalam hal pemilik proyek infrastruktur adalah lembaga nonpemerintah, maka dokumen kegiatan investasi antara lain berupa dokumen persetujuan proyek dari lembaga pemilik proyek.
 - f. *Underlying* Transaksi berupa investasi pada surat berharga yang diterbitkan oleh Pemerintah Republik Indonesia, maka dokumen *underlying* transaksi antara lain berupa rencana dan bukti realisasi investasi pada Surat Berharga Negara.
4. Dalam hal suatu *Underlying* Transaksi memiliki 1 (satu) jenis valuta asing, *Underlying* Transaksi dimaksud hanya berlaku untuk 1

(satu) Kontrak Lindung Nilai dan 1 (satu) Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.

5. Dalam hal suatu *Underlying* Transaksi memiliki lebih dari 1 (satu) jenis valuta asing, Bank dapat menggunakan *Underlying* Transaksi yang sama untuk lebih dari:
- a. 1 (satu) Kontrak Lindung Nilai; dan
 - b. 1 (satu) Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia,
- yang dinyatakan dalam masing-masing valuta asing.

Contoh:

Pada bulan September 20XX Bank A menandatangani 1 (satu) perjanjian pinjaman dari luar negeri dalam valuta asing. Jumlah Pinjaman Luar Negeri yang diterima oleh Bank A sebesar USD500,000,000.00 (lima ratus juta dolar Amerika Serikat) dan JPY150,000,000.00 (seratus lima puluh juta yen Jepang). Atas Pinjaman Luar Negeri tersebut Bank A dapat mengajukan 2 (dua) Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia, yaitu 1 (satu) transaksi dalam Dolar Amerika Serikat dan 1 (satu) transaksi dalam Yen Jepang. Bank A melakukan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dengan nilai nominal masing-masing sebesar USD500,000,000.00 (lima ratus juta dolar Amerika Serikat) dengan tenor 12 (dua belas) bulan dan JPY150,000,000.00 (seratus lima puluh juta yen Jepang) dengan tenor 12 (dua belas) bulan. Untuk Transaksi *Swap* Lindung Nilai tersebut Bank A menyampaikan 2 (dua) Kontrak Lindung Nilai, yaitu 1 (satu) Kontrak Lindung Nilai dalam Dolar Amerika Serikat dan 1 (satu) Kontrak Lindung Nilai dalam Yen Jepang.

6. Bank bertanggung jawab atas penatausahaan kelengkapan dokumen asli *Underlying* Transaksi dan dokumen fotokopi *Underlying* Transaksi *swap* jual antara Bank dengan nasabah sebagaimana dimaksud dalam Pasal 12 PBI.
7. Dokumen sebagaimana dimaksud dalam angka 6 diterima oleh Bank dari nasabah paling lambat 1 (satu) bulan setelah tang-

gal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.

2. Ketentuan huruf B diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:

B. PELAKSANAAN TRANSAKSI SWAP LINDUNG NILAI KEPADA BANK INDONESIA.

1. Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dilakukan melalui Transaksi *Swap* Beli Bank kepada Bank Indonesia dalam valuta asing terhadap Rupiah, dalam rangka Lindung Nilai yang dilakukan antara Bank dengan Bank Indonesia.
2. Jenis valuta asing dalam Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia adalah sesuai dengan jenis valuta asing yang diumumkan oleh Bank Indonesia paling lambat sebelum *window time* transaksi dibuka.
3. Untuk Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dalam Dolar Amerika Serikat terhadap Rupiah, kurs spot yang digunakan adalah kurs Jakarta Interbank Spot Dollar Rate (JISDOR) pada tanggal transaksi.
4. Untuk Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dalam valuta asing selain Dolar Amerika Serikat terhadap Rupiah, kurs spot yang digunakan adalah kurs tengah transaksi Bank Indonesia valuta asing terhadap Rupiah pada tanggal transaksi.
5. Kurs tengah transaksi Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam angka 4 dihitung dengan rumus sebagai berikut:

$\text{Kurs Tengah Transaksi} = \frac{\text{Kurs Jual Transaksi Bank Indonesia} + \text{Kurs beli Transaksi Bank Indonesia}}{2}$
--

6. Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dilakukan dengan ketentuan sebagai berikut:

a. Pengumuman dan Pelaksanaan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia

- 1) Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dilakukan pada setiap hari kerja.
- 2) Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dapat memiliki jangka

waktu 3 (tiga) bulan, 6 (enam) bulan, atau 12 (dua belas) bulan, yang dihitung sejak 1 (satu) hari setelah tanggal valuta (tanggal setelmeri) sampai dengan tanggal jatuh waktu.

- 3) Bank Indonesia mengumumkan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia paling lambat sebelum *window time* transaksi dibuka melalui Sistem Laporan Harian Bank Umum (Sistem LHBUS) dan/atau sarana informasi lain yang ditentukan oleh Bank Indonesia.
- 4) Pengumuman sebagaimana dimaksud dalam angka 3) paling kurang meliputi:
 - a) jangka waktu *swap*;
 - b) premi *swap*;
 - c) tanggal transaksi;
 - d) *window time* transaksi;
 - e) tanggal valuta (tanggal setelmeri);
 - f) kurs JISDOR atau kurs tengah transaksi Bank Indonesia;
 - g) jenis valuta asing;
 - h) jumlah minimum penawaran dan kelipatan penawaran; dan
 - i) sarana pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan sarana pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.
- 5) Bank dapat melakukan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia mulai pukul 14.00 WIB sampai dengan pukul 16.00 WIB, atau waktu lain yang ditentukan oleh Bank Indonesia.

b. Pengajuan Kontrak Lindung Nilai

- 1) Pengajuan Kontrak Lindung Nilai dilakukan oleh Bank bersamaan dengan pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia melalui sarana komunikasi yang ditentukan oleh Bank Indonesia.
- 2) Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud dalam angka 1) berlaku efektif pada tanggal valuta (tanggal setelmeri).
- 3) Kontrak Lindung Nilai sebagaimana

dimaksud dalam angka 1) meliputi informasi:

- a) nama Bank;
- b) jangka waktu Kontrak Lindung Nilai;
- c) *Underlying* Transaksi sebagaimana dimaksud dalam butir A.1 dan/atau butir A.3;
- d) jenis valuta asing; dan
- e) nilai nominal *underlying* yang dicantumkan dalam Kontrak Lindung Nilai.

Contoh Kontrak Lindung Nilai untuk transaksi *swap* atas *underlying* milik Bank adalah sebagai berikut:

Nama Bank	: Bank A
Jangka Waktu	: 2 tahun
<i>Underlying</i>	: Kontrak Pinjaman Luar Negeri Bank
Jenis Valuta Asing	: Dolar Amerika Serikat
Nilai Nominal	: USD500 juta

Contoh Kontrak Lindung Nilai untuk transaksi *swap* atas *underlying* milik nasabah Bank adalah sebagai berikut:

Nama Bank	: Bank A
Jangka Waktu	: 2 tahun
<i>Underlying</i>	: Kontrak transaksi <i>swap</i> Bank A dengan PT X atas Pinjaman Luar Negeri PT X
Jenis Valuta Asing	: Dolar Amerika Serikat
Nilai Nominal	: USD500 juta

Contoh nilai nominal dan *underlying* transaksi yang dinyatakan dalam Kontrak Lindung Nilai tercantum dalam Lampiran I Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/2/DPM tanggal 28 Januari 2014 perihal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.

- 4) Bank bertanggung jawab atas ke-

benaran data Kontrak Lindung Nilai yang disampaikan kepada Bank Indonesia.

- c. Pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia

- 1) Bank mengajukan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia secara langsung tanpa melalui lembaga perantara.

- 2) Pengajuan transaksi sebagaimana dimaksud dalam angka 1) dilakukan melalui sarana komunikasi yang ditentukan oleh Bank Indonesia.

- 3) Pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia memuat informasi paling kurang sebagai berikut:

- a) nama Bank;
- b) jenis valuta asing;
- c) identitas dokumen *Underlying* Transaksi;
- d) jangka waktu dan nominal *Underlying* Transaksi yang tercantum pada Kontrak Lindung Nilai;
- e) tanggal transaksi;
- f) tanggal valuta;
- g) jangka waktu Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia;
- h) tanggal jatuh waktu;
- i) nilai nominal;
- j) nomor rekening valuta asing Bank di bank koresponden; dan
- k) nomor rekening giro Rupiah Bank di Bank Indonesia.

- 4) Setiap pengajuan Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud dalam huruf b disertai juga dengan informasi yang berisi pernyataan Bank bahwa seluruh persyaratan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia telah dipenuhi.

- 5) Dalam hal Bank melakukan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dengan *Underlying* Transaksi berupa dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha) tanpa informasi jangka waktu atas dana usaha yang dinyatakan (*declared*

dana usaha) maka pernyataan sebagaimana dimaksud dalam angka 4) ditambahkan informasi terkait jangka waktu dana usaha yang dinyatakan (*declared* dana usaha).

- 6) Contoh pernyataan Bank mengenai pemenuhan persyaratan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam angka 4) dan angka 5) tercantum dalam Lampiran II Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/19/DPM tanggal 28 November 2014 perihal Perubahan atas Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/2/DPM tanggal 28 Januari 2014 perihal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.
- 7) Setelah diterimanya pengajuan Kontrak Lindung Nilai sebagaimana dimaksud dalam butir b.3) dan pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam angka 3), Bank Indonesia akan memberikan nomor referensi kepada Bank untuk setiap Kontrak Lindung Nilai.
- 8) Nilai nominal minimum pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dan kelipatannya diumumkan oleh Bank Indonesia melalui Sistem Laporan Harian Bank Umum (Sistem LHBUS) atau sarana informasi lain yang ditentukan oleh Bank Indonesia, dengan nilai nominal pengajuan paling banyak sebesar nilai *Underlying* Transaksi.
- 9) Dalam hal terjadi koreksi atas pengajuan transaksi, Bank hanya dapat mengajukan 1 (satu) kali koreksi untuk setiap Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia yang diajukan dalam *window time* Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.
- 10) Dalam hal dilakukan koreksi atas nilai nominal sebagaimana dimaksud dalam angka 9), nilai nominal dimaksud harus memenuhi ketentuan seb-

agaimana dimaksud dalam angka 8).

- 11) Bank bertanggung jawab atas kebenaran data Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia yang disampaikan kepada Bank Indonesia.
 - 12) Pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia yang telah disampaikan kepada Bank Indonesia tidak dapat dibatalkan oleh Bank.
 - 13) Kontrak Lindung Nilai berakhir apabila Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia telah berakhir dan tidak dilakukan perpanjangan oleh Bank.
 - 14) Bank Indonesia dapat menolak pengajuan Kontrak Lindung Nilai dan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.
- d. Konfirmasi atas Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia
- Bank Indonesia meminta Bank untuk melakukan konfirmasi atas pengajuan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia yang dilakukan oleh Bank melalui sarana komunikasi yang ditentukan oleh Bank Indonesia yang meliputi:
- 1) jenis valuta asing;
 - 2) nominal transaksi;
 - 3) jangka waktu transaksi;
 - 4) tanggal valuta dan tanggal jatuh waktu;
 - 5) kurs JISDOR atau kurs tengah transaksi Bank Indonesia;
 - 6) kurs *forward*;
 - 7) premi *swap*;
 - 8) nomor rekening valuta asing Bank di bank koresponden; dan
 - 9) nomor rekening giro Rupiah Bank di Bank Indonesia.
- e. Setelmen Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia
- 1) Setelmen *first leg*
 - a) Bank Indonesia melakukan setelmen *first leg* paling lama 2 (dua) hari kerja setelah tanggal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indo-

nesia, dengan mengkredit rekening giro Rupiah Bank sebesar nilai setelmen *first leg*.

- b) Nilai setelmen *first leg* dihitung sebesar nilai nominal valuta asing yang diajukan dikalikan dengan kurs spot JISDOR dalam hal valuta asing yang digunakan adalah Dolar Amerika Serikat atau kurs tengah transaksi Bank Indonesia dalam hal valuta asing yang digunakan adalah selain Dolar Amerika Serikat.
 - c) Bank wajib menyelesaikan transfer dana valuta asing ke rekening Bank Indonesia di bank koresponden pada tanggal valuta (tanggal setelmen), sebagaimana dimaksud dalam Pasal 13 ayat (2) PBI.
 - d) Dalam hal pada tanggal setelmen *first leg*, Bank tidak melakukan transfer dana valuta asing sebesar nilai transaksi yang diajukan, maka Bank wajib menyelesaikan transfer dana valuta asing sebesar nilai transaksi yang diajukan pada hari kerja berikutnya.
 - e) Atas keterlambatan penyelesaian kewajiban setelmen sebagaimana dimaksud dalam huruf d), Bank dikenakan sanksi sebagaimana diatur dalam Pasal 15 ayat (4) huruf a dan huruf b PBI.
- 2) Setelmen *second leg*
- a) Pada tanggal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia jatuh waktu (*second leg*), Bank Indonesia melakukan transfer dana valuta asing ke rekening Bank di bank koresponden sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg*.
 - b) Bank Indonesia mendebet rekening giro Rupiah Bank sebesar nilai nominal valuta asing pada setelmen *first leg* dikalikan kurs setelmen *second leg*.
 - c) Kurs setelmen *second leg* adalah kurs spot saat tanggal transaksi dit-

ambah premi *swap* yang dibayarkan Bank kepada Bank Indonesia.

- d) Bank wajib menyediakan dana Rupiah pada tanggal valuta (tanggal setelmen *second leg*) di rekening giro Rupiah Bank pada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam Pasal 13 ayat (3) PBI.
 - e) Dalam hal pada tanggal setelmen *second leg*, Bank tidak memiliki dana Rupiah yang cukup untuk memenuhi kewajiban setelmen sebagaimana dimaksud dalam huruf d), maka Bank wajib menyediakan dana Rupiah yang cukup untuk memenuhi kewajiban setelmen pada hari kerja berikutnya.
 - f) Pembayaran nominal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam huruf d) dilakukan melalui pendebitan rekening giro Rupiah Bank di Bank Indonesia.
 - g) Atas keterlambatan penyelesaian kewajiban setelmen sebagaimana dimaksud dalam huruf e), Bank dikenakan sanksi sebagaimana diatur dalam Pasal 15 ayat (4) huruf a dan huruf b PBI.
- 3) Dalam hal setelah terjadinya Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia, tanggal setelmen *first leg* sebagaimana dimaksud dalam angka 1) dan/atau tanggal setelmen *second leg* sebagaimana dimaksud dalam angka 2), ditetapkan sebagai hari libur oleh pemerintah, pelaksanaan setelmen dilakukan pada hari kerja berikutnya tanpa memperhitungkan pengurangan dan/atau penambahan premi untuk hari libur dimaksud.
3. Ketentuan butir C.16 diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:
16. Bank Indonesia meminta Bank untuk melakukan konfirmasi atas pengajuan perpanjangan Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia melalui sarana komunikasi yang

ditentukan oleh Bank Indonesia yang paling kurang meliputi:

- jenis valuta asing;
- nominal transaksi;
- jangka waktu transaksi;
- tanggal valuta dan tanggal jatuh waktu;
- kurs JISDOR atau kurs tengah transaksi Bank Indonesia;
- kurs *forward*;
- premi *swap*;
- nilai nominal *netting* baik dalam valuta asing maupun dalam Rupiah, jika penyelesaian dilakukan secara *netting*;
- nomor rekening Bank di bank koresponden; dan
- nomor rekening giro Rupiah Bank di Bank Indonesia.

4. Ketentuan butir C.18 diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:

18. Setelmen *netting* untuk nilai nominal yang sama pada setiap perpanjangan sebagaimana dimaksud dalam butir 17.a dilakukan dengan mekanisme sebagai berikut:

- Nilai setelmen *netting* untuk nominal Rupiah dihitung sebagai berikut:

$$\text{Nilai Setelmen Netting} = \text{Nilai Nominal x Valuta Asing} \left[\begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen 2nd Leg} \\ \text{Transaksi Swap} \\ \text{Lindung Nilai Kepada} \\ \text{Bank Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} \right] - \left[\begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen} \\ \text{1st Leg} \\ \text{Saat} \\ \text{Perpanjangan} \end{array} \right]$$

- Dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan selisih negatif, maka Bank Indonesia akan mengkredit rekening giro Rupiah Bank sebesar hasil perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a.
- Dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a menghasilkan selisih positif, maka Bank Indonesia akan mendebet rekening giro Rupiah Bank sebesar hasil perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf a.

Contoh perhitungan setelmen *netting* untuk nilai nominal yang sama sebagaimana tercantum dalam Lampiran III dan Lampiran IV Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/19/DPM

tanggal 28 November 2014 perihal Perubahan atas Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/2/DPM tanggal 28 Januari 2014 perihal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.

5. Ketentuan butir C.19 diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:

19. Setelmen *netting* untuk nilai nominal yang lebih kecil pada setiap perpanjangan sebagaimana dimaksud dalam butir 17.b dilakukan dengan mekanisme sebagai berikut:

- Nilai setelmen *netting* untuk valuta asing dihitung sebagai berikut:

$$\text{Nilai Setelmen Netting} = \begin{array}{l} \text{Nilai Nominal} \\ \text{Valuta Asing} \\ \text{Saat Transaksi} \\ \text{Swap Lindung Nilai} \\ \text{Kepada Bank Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} - \begin{array}{l} \text{Nilai Nominal} \\ \text{Valuta Asing} \\ \text{Saat Perpanjangan} \\ \text{Transaksi Swap} \\ \text{Lindung Nilai} \\ \text{Kepada Bank} \\ \text{Indonesia} \end{array}$$

- Bank Indonesia melakukan transfer dana valuta asing ke rekening Bank di bank koresponden sebesar nilai setelmen *netting* sebagaimana dimaksud dalam huruf a.

- Nilai setelmen *netting* untuk Rupiah dihitung sebagai berikut:

$$\text{Nilai Setelmen Netting} = \left[\begin{array}{l} \text{Nilai Nominal} \\ \text{Valuta Asing} \\ \text{Saat Transaksi} \\ \text{Swap Lindung} \\ \text{Nilai Kepada} \\ \text{Bank Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} \right] \times \left[\begin{array}{l} \text{Kurs Setelmen 2nd Leg} \\ \text{Transaksi Swap Lindung} \\ \text{Nilai Kepada} \\ \text{Bank Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} \right] - \left[\begin{array}{l} \text{Nilai Nominal} \\ \text{Valuta Asing Saat} \\ \text{Perpanjangan} \\ \text{Transaksi Swap Lindung} \\ \text{Nilai Kepada} \\ \text{Bank Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} \right] \times \left[\begin{array}{l} \text{Kurs 1st Leg Saat} \\ \text{Perpanjangan Transaksi Swap Lindung} \\ \text{Nilai Kepada Bank} \\ \text{Indonesia} \\ \text{Awal} \end{array} \right]$$

- Dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf c menghasilkan selisih positif maka Bank Indonesia akan mendebet rekening giro Rupiah Bank sebesar hasil perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf c.
- Dalam hal perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf c menghasilkan selisih negatif maka Bank Indonesia akan mengkredit rekening giro Rupiah Bank sebesar hasil perhitungan sebagaimana dimaksud dalam huruf c.

Contoh perhitungan setelmen *netting* untuk nilai nominal yang lebih kecil pada setiap perpanjangan sebagaimana tercantum dalam Lampiran V dan Lampiran VI Surat Edaran

Bank Indonesia Nomor 16/19/DPM tanggal 28 November 2014 perihal Perubahan atas Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 16/2/DPM tanggal 28 Januari 2014 perihal Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia.

6. Ketentuan huruf E diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:

Dalam hal Bank dikenakan sanksi atas pelanggaran Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia dan/atau pelanggaran atas kewajiban setelmen Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia sebagaimana dimaksud dalam Pasal 15 Peraturan Bank Indonesia tentang Transaksi *Swap* Lindung Nilai kepada Bank Indonesia, mekanisme pengenaan sanksi diatur sebagai berikut:

1. Bank Indonesia mengenakan sanksi berupa teguran tertulis dengan tembusan kepada Otoritas Jasa Keuangan.
2. Pengenaan sanksi kewajiban membayar sebagaimana dimaksud dalam Pasal 15 ayat (1)

huruf b dan Pasal 15 ayat (4) huruf b PBI dilakukan dengan mendebet rekening giro Rupiah atau rekening giro valuta asing Bank yang ada di Bank Indonesia.

Surat Edaran Bank Indonesia ini mulai berlaku pada tanggal 24 Mei 2016.

Agar setiap orang mengetahuinya, memerintahkan pengumuman Surat Edaran Bank Indonesia ini dengan penempatannya dalam Berita Negara Republik Indonesia.

Demikian agar Saudara maklum.

BANK INDONESIA,
ttd.
DODDY ZULVERDI
KEPALA DEPARTEMEN
PENGELOLAAN MONETER

(BN)

PERUBAHAN ATAS SURAT EDARAN BANK INDONESIA NOMOR 17/30/DPSP TANGGAL 13 NOVEMBER 2015 PERIHAL PENYELENGGARAAN SETELMEN DANA SEKETIKA MELALUI SISTEM BANK INDONESIA-REAL TIME GROSS SETTLEMENT (Surat Edaran Kepala Departemen Penyelenggaraan Sistem Pembayaran Bank Indonesia Nomor 18/8/DPSP, tanggal 2 Mei 2016)

Sehubungan dengan berlakunya Peraturan Bank Indonesia Nomor 17/18/PBI/2015 tentang Penyelenggaraan Transaksi, Penatausahaan Surat Berharga, dan Setelmen Dana Seketika (Lembaran Negara Republik Indonesia Tahun 2015 Nomor 273, Tambahan Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 5762) sebagaimana telah diubah dengan Peraturan Bank Indonesia Nomor 18/6/PBI/2016 (Lembaran Negara Republik Indonesia Tahun 2016 Nomor 77, Tambahan Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 5877), perlu melakukan perubahan atas Surat Edaran Bank Indonesia Nomor 17/30/DPSP tanggal 13 November 2015 perihal Penyelenggaraan Setelmen Dana Seketika melalui Sistem Bank Indonesia Real Time Gross Settlement sebagai berikut:

1. Ketentuan butir II.A.2 diubah sehingga berbunyi sebagai berikut:
2. Kegiatan korespondensi terkait kegiatan penyelenggaraan ditujukan kepada Penyelenggara dengan ketentuan sebagai berikut:
 - a. Kegiatan terkait kepesertaan dan operasional penyelenggaraan Sistem BI-RTGS ditujukan ke alamat:
Bank Indonesia
Departemen Penyelenggaraan Sistem Pembayaran
Divisi Setelmen Dana dan Penatausahaan Surat Berharga
Gedung D Lantai 3
Jalan M.H. Thamrin No. 2