

LAPORAN NSFR

JPMorgan Chase Bank N.A. - Indonesia Branch
NSFR per 30 Juni 2021

A. PERHITUNGAN NSFR

Komponen ASF	Posisi 31 Maret 2021					Posisi 30 Juni 2021					No. Ref. dari Kertas Kerja NSFR
	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 ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - < 1 tahun	≥ 1 tahun		Tanpa Jangka Waktu ¹	< 6 bulan	≥ 6 bulan - < 1 tahun	≥ 1 tahun		
1 Modal :	4,290,987	-	-	-	4,290,987	4,346,906	-	-	-	4,346,906	
2 Modal sesuai POJK KPMM	4,290,987	-	-	-	4,290,987	4,346,906	-	-	-	4,346,906	1.1 1.2
3 Instrumen modal lainnya	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.3
4 Simpanan yang berasal dari nasabah perorangan dan pendanaan yang berasal dari nasabah usaha mikro dan usaha kecil:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2 3
5 Simpanan dan pendanaan stabil	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.1 3.1
6 Simpanan dan pendanaan kurang stabil	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.2 3.2
7 Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi:	7,918,729	-	871,500	-	3,631,527	7,309,579	470,000	870,000	-	3,587,555	4
8 Simpanan operasional	6,391,553	-	-	-	3,195,777	6,305,110	-	-	-	3,152,555	4.1
9 Pendanaan lainnya yang berasal dari nasabah korporasi	1,527,175	-	871,500	-	435,750	1,004,469	470,000	870,000	-	435,000	4.2
10 Liabilitas yang memiliki pasangan aset yang saling bergantung	-	637,973	-	-	-	-	637,973	-	-	-	5
11 Liabilitas dan ekuitas lainnya :	-	-	-	-	-	705,674	882,861	153,993	540,317	-	6
12 NSFR liabilitas derivatif	-	-	-	1,081,932	-	-	-	-	867,426	-	6.1
13 ekuitas dan liabilitas lainnya yang tidak masuk dalam kategori diatas	497,745	1,619,527	-	-	-	705,674	709,745	-	-	-	6.2 s.d. 6.5
14 Total ASF					7,922,514					7,934,461	7

Komponen RSF	Posisi 31 Maret 2021					Posisi 30 Juni 2021					No. Ref. dari Kertas Kerja NSFR
	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 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	492,525	7,461,059	154,472	2,167,488	1,181,531	-	-	-	-	1,303,677	1
16 Simpanan pada lembaga keuangan lain untuk tujuan operasional	146,379	-	-	-	73,189	99,734	-	-	-	49,867	2
17 Pinjaman dengan kategori Lancar dan Dalam Perhatian Khusus (<i>performing</i>)	-	2,827,140	35,000	373,059	1,365,670	-	3,381,128	438,314	-	1,232,398	3
18 kepada lembaga keuangan yang dijamin dengan HQLA Level 1	-	146,490	35,000	373,059	405,207	-	104,790	438,314	-	229,636	3.1.1
19 kepada lembaga keuangan yang dijamin bukan dengan HQLA Level 1 dan pinjaman kepada lembaga keuangan tanpa jaminan	-	377,650	-	-	56,648	-	449,500	-	-	67,425	3.1.2 3.1.3
20 kepada korporasi non-keuangan, nasabah retail dan nasabah usaha mikro dan kecil, pemerintah pusat, pemerintah negara lain, Bank Indonesia, bank sentral negara lain dan entitas sektor publik, yang diantaranya:	-	2,303,001	-	-	903,815	-	2,826,838	-	-	935,337	3.1.4.2 3.1.5 3.1.6
21 memenuhi kualifikasi untuk mendapat bobot risiko 35% atau kurang, sesuai SE OJK ATMR untuk Risiko Kredit	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.1.4.1
22 Kredit beragun rumah tinggal yang tidak sedang dijamin, yang diantaranya:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.1.7.2
23 memenuhi kualifikasi untuk mendapat bobot risiko 35% atau kurang, sesuai SE OJK ATMR untuk Risiko Kredit	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.1.7.1
24 Surat Berharga dengan kategori Lancar dan Kurang Lancar (<i>performing</i>) yang tidak sedang dijamin, tidak gagal bayar, dan tidak masuk sebagai HQLA, termasuk saham yang diperdagangkan di bursa	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.2
25 Aset yang memiliki pasangan liabilitas yang saling bergantung	-	637,973	-	-	-	-	637,973	-	-	-	4
26 Aset lainnya :	-	342,639	-	126,379	448,830	-	289,196	96,563	222,171	374,597	5
27 Komoditas fisik yang diperdagangkan, termasuk emas	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5.1
28 Kas, surat berharga dan aset lainnya yang dicatat sebagai initial margin untuk kontrak derivatif dan kas atau aset lain yang diserahkan sebagai default fund pada central counterparty (CCP)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5.2
29 NSFR aset derivatif	-	-	-	106,065	106,065	-	-	-	87,197	87,197	5.3
30 NSFR liabilitas derivatif sebelum dikurangi dengan variation margin	-	-	-	216,386	216,386	-	-	-	173,485	173,485	5.4
31 Seluruh aset lainnya yang tidak masuk dalam kategori diatas	-	20,188	-	126,379	126,379	-	233,333	-	113,915	113,915	5.5 s.d. 5.12
32 Rekening Administratif	-	-	-	6,669,381	15,321	-	-	-	7,946,873	16,669	12
33 Total RSF					3,084,541					2,977,207	13
34 Rasio Pendanaan Stabil Bersih (Net Stable Funding Ratio (%))					256.85%					266.51%	14

B. ANALISIS PERKEMBANGAN NSFR

Analisis

Pada akhir Juni 2021, NSFR JPMorgan Chase Bank – Cabang Indonesia berada pada posisi 267%, cukup stabil dibandingkan dengan posisi Maret 2021 yang berada pada level 257%.

ASF terutama berasal dari modal dan pendanaan dari konsumen korporasi.
RSF terutama berasal dari kredit yang diberikan serta HQLA.