

LAMPIRAN I
PERATURAN OTORITAS JASA KEUANGAN
REPUBLIK INDONESIA
NOMOR []
TENTANG
PENYELENGGARAAN *STRUCTURED PRODUCT* OLEH BANK UMUM

DRAF RPOJK

a. Format Laporan

Informasi *Outstanding* Transaksi *Structured Product*

Nama Produk	Nomor Transaksi	Jumlah Nasabah	Komponen Produk					
			Komponen Non-Derivatif	Komponen Derivatif				
				<i>Option</i>		<i>Forward</i>		<i>Swap</i>
Komponen Instrumen	Posisi	Variabel Dasar	Posisi	Variabel Dasar	Variabel Dasar			

Karakteristik Produk	Valuta Dasar	<i>Strike Price</i>	Nominal/ <i>Notional</i>

1) Pedoman Pengisian

- a) Nama Produk
Diisi dengan nama masing-masing produk sesuai prospektus/term sheet atau *product highlight sheet* atau perjanjian transaksi *structured products*.
- b) Nomor Transaksi
Diisi dengan nomor transaksi *structured product*.
- c) Jumlah Nasabah
Diisi jumlah nasabah untuk setiap *structured product* sebagaimana dimaksud pada kolom “Nama Produk”.
- d) Komponen Produk
- (1) Komponen Non Derivatif
Komponen Instrumen
- (a) Diisi dengan Referensi Komponen Non Derivatif-Komponen Instrumen yang mendasari *structured product*.
- (b) Referensi pengisian data

No.	Komponen Instrumen Non Derivatif	Sandi
1.	Giro	01
2.	Tabungan	02
3.	Deposito	03
4.	Surat Berharga/Obligasi	04
5.	Pinjaman	05
6.	Lainnya	99

(2) Komponen Derivatif

(a) *Option*

i. Posisi

- a) Diisi dengan referensi komponen derivatif-*option*-posisi jika BUK memiliki posisi opsi atas *structured product* yang diterbitkan.
- b) Referensi pengisian data

No.	Komponen Instrumen Derivatif berupa <i>Option</i>	Sandi
1.	<i>Long Call Option</i>	01
2.	<i>Short Call Option</i>	02
3.	<i>Long Put Option</i>	03
4.	<i>Short Put Option</i>	04

ii. Variabel Dasar

- a) Diisi dengan referensi komponen derivatif-*option*-variabel dasar, yaitu variabel yang digunakan sebagai variabel dasar dari komponen derivatif *structured product*.

b) Referensi pengisian data

No.	Variabel Dasar	Sandi
1.	Suku Bunga	01
2.	Nilai Tukar	02
3.	Komoditas	03
4.	Ekuitas	04

Jika kolom "Posisi" diisi, kolom "Variabel Dasar" harus diisi.

(b) *Forward*

i. Posisi

- a) Diisi dengan referensi komponen derivatif-*forward*-posisi jika BUK memiliki posisi *forward* atas *structured product* yang diterbitkan.

b) Referensi pengisian data

No.	Komponen Instrumen Derivatif berupa Forward	Sandi
1.	<i>Long Forward</i>	01
2.	<i>Short Forward</i>	02

ii. Variabel Dasar

- a) Diisi dengan sandi "Variabel Dasar", yaitu variabel yang digunakan sebagai variabel dasar dari komponen derivatif *structured product*.

b) Referensi pengisian data

No.	Variabel Dasar	Sandi
1.	Suku Bunga	01
2.	Nilai Tukar	02
3.	Komoditas	03
4.	Ekuitas	04

Jika kolom "Posisi" diisi, kolom "Variabel Dasar" harus diisi.

(c) *Swap*

Variabel Dasar

- 1) Diisi dengan referensi komponen derivatif-*swap*-variabel dasar, yaitu variabel yang digunakan sebagai

variabel dasar dari komponen derivatif *structured product*.

2) Referensi pengisian data

No.	Variabel Dasar	Sandi
1.	Suku Bunga	01
2.	Nilai Tukar	02
3.	Komoditas	03
4.	Ekuitas	04

Jika komponen non derivatif diisi maka komponen derivatif harus diisi.

Untuk transaksi *structured products* yang memiliki lebih dari 1 (satu) komponen derivatif, diisi pada 2 (dua) baris. Selanjutnya, untuk mengidentifikasi produk yang sama, dilaporkan pengisian yang sama pada kolom "Nama Produk", "Nomor Transaksi", "Jumlah Nasabah", "Karakteristik Produk", "Valuta Dasar", "*Strike Price*", dan "Nominal/Notional".

Sebagai contoh:

Nama Produk	Nomor Transaksi	Jumlah Nasabah	Komponen Produk					
			Komponen Non-Derivatif	Komponen Derivatif				
				<i>Option</i>		<i>Forward</i>		<i>Swap</i>
			Komponen Instrumen	Posisi	Variabel Dasar	Posisi	Variabel Dasar	Variabel Dasar
PRODUK 1	123456	120	-	02 (<i>Short Call Option</i>)	01 (Suku Bunga)	-	-	-
PRODUK 1	123456	120	-	01 (<i>Long Call Option</i>)	01 (Suku Bunga)	-	-	-

e) Karakteristik Produk

(1) Diisi dengan referensi karakteristik produk.

(2) Referensi pengisian data

No.	Karakteristik Produk	Sandi
1.	Pokok dengan Proteksi Penuh (<i>Principal Protected</i>)	1
2.	Pokok tanpa Proteksi (<i>Principal Non-Protected</i>)	
	a) Dengan <i>Leverage</i>	2
	b) Tanpa <i>Leverage</i>	3

f) Valuta Dasar

Diisi dengan referensi sandi valuta dari mata uang yang mendasari transaksi. Referensi sandi valuta mengacu pada referensi valuta sesuai dengan ketentuan peraturan perundang-undangan mengenai laporan bank umum terintegrasi.

g) *Strike Price*

Merupakan *strike price* yang ditetapkan pada saat perjanjian transaksi, diisi dalam satuan penuh valuta asal. Dalam hal *strike price* yang ditetapkan lebih dari satu, *strike price* yang dicatat adalah *strike price* yang berpotensi lebih besar untuk tereksekusi pada saat pelaporan.

h) Nominal/*Notional*

Diisi dengan total eksposur dalam satuan penuh ekuivalen rupiah per posisi Laporan.