

LAPORAN PERHITUNGAN
KEWAJIBAN PEMENUHAN RASIO KECUKUPAN LIKUIDITAS (*LIQUIDITY COVERAGE RATIO*) TRIWULANAN

Nama Bank : Bank of China
Posisi Laporan : 31 Maret 2016
(dalam juta Rp)

		Nilai <i>outstanding</i> kewajiban dan komitmen/nilai tagihan kontraktual	Nilai HQLA setelah pengurangan nilai (<i>haircut</i>), <i>outstanding</i> kewajiban dan komitmen dikalikan tingkat penarikan (<i>run-off rate</i>) atau nilai tagihan kontraktual dikalikan tingkat penerimaan (<i>inflow rate</i>).
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)			
1	Total <i>High Quality Liquid Asset</i> (HQLA)		4,288,177
ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOW)			
2	Simpanan nasabah perorangan dan Pendanaan yang berasal dari nasabah Usaha Mikro dan Usaha Kecil, terdiri dari:		
	a. Simpanan/Pendanaan stabil	31,310	1,566
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	1,479,833	147,983
3	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:		
	a. Simpanan operasional		
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	7,999,091	3,307,009
	c. surat berharga berupa surat utang yang diterbitkan oleh bank		
4	Pendanaan dengan agunan (<i>secured funding</i>)		
5	Arus kas keluar lainnya (<i>additional requirement</i>), terdiri dari:		
	a. arus kas keluar atas transaksi derivatif	1,803	1803
	b. arus kas keluar atas peningkatan kebutuhan likuiditas		
	c. arus kas keluar atas kehilangan pendanaan		
	d. arus kas keluar atas penarikan komitmen fasilitas kredit dan fasilitas likuiditas	2,821,019	284,644
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana		
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	12,235,146	608,589
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya	2,033,985	2,033,985
	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOW)		6,385,579
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)			
6	Pinjaman dengan agunan <i>Secured lending</i>	828	0
7	Tagihan berasal dari pihak lawan (<i>counterparty</i>)	719,453	584,938
8	Arus kas masuk lainnya	624,279	318,462.0
	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)	1,344,560	903,400
			TOTAL ADJUSTED VALUE
	TOTAL HQLA		4,288,177
	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		5,482,179
	LCR (%)		78.22%

Keterangan:

¹*Adjusted values* dihitung setelah pengenaan pengurangan nilai (*haircut*), tingkat penarikan (*run-off rate*), dan tingkat penerimaan (*inflow rate*) serta batas maksimum komponen HQLA, misalnya batas maksimum HQLA Level 2B dan HQLA Level 2 serta batas maksimum arus kas masuk yang dapat diperhitungkan dalam LCR.