

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

Nama Bank : Bank of China
Posisi Laporan : 30 Juni 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)		4,400,580
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	22,026	1,101
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	1,126,430	112,643
3	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:		
	a. Simpanan operasional		
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	8,146,065	3,312,756
	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	1880	1880
	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	2,223,266	223,400
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana		
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	11,234,622	554,255
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya	2,204,488	2,204,488
	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOW)		6,410,523
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)			
6	Pinjaman dengan agunan <i>Secured lending</i>	1047	0
7	Tagihan berasal dari pihak lawan (<i>counterparty</i>)	903,955	703,626
8	Arus kas masuk lainnya	579,239	292,391.0
	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)	1,484,241	996,017
			TOTAL ADJUSTED VALUE¹
	TOTAL HQLA		4,400,580
	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		5,414,506
	LCR (%)		81.27%

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.