

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

Nama Bank : Bank of China (Hong Kong) Jakarta Branch
Posisi Laporan : 30 September 2017

(dalam jutaan rupiah)

No	Komponen	30 September 2017		30 Juni 2017	
		Nilai <i>outstanding</i> kewajiban dan komitmen/nilai tagihan kontraktual	Nilai HQLA setelah pengurangan nilai (<i>haircut</i>) atau <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>).	Nilai <i>outstanding</i> kewajiban dan komitmen/nilai tagihan kontraktual	Nilai HQLA setelah pengurangan nilai (<i>haircut</i>) atau <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>).
1	Jumlah data Poin yang digunakan dalam perhitungan LCR		91 hari		3 hari
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)					
2	Total <i>High Quality Liquid Asset</i> (HQLA)		5,638,064		5,710,115
ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)					
3	Simpanan nasabah perorangan dan Pendanaan yang berasal dari nasabah Usaha Mikro dan Usaha Kecil, terdiri dari:				
	a. Simpanan/Pendanaan stabil	7,829	391	7,540	377
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	1,008,422	100,842	952,424	95,242
4	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:				
	a. Simpanan operasional				
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	8,704,706	3,722,755	9,350,704	3,913,493
	c. surat berharga berupa surat utang yang diterbitkan oleh bank (<i>unsecured debt</i>)				
5	Pendanaan dengan agunan (<i>secured funding</i>)				
6	Arus kas keluar lainnya (<i>additional requirements</i>), terdiri dari:				
	a. arus kas keluar atas transaksi derivatif	6,984	6,984	1,188	1,188
	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	3,348,815	366,869	2,916,013	329,657
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana				
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	10,167,741	499,851	9,702,604	477,231
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya	1,240,100	1,240,100	871,849	871,849
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		5,937,792		5,689,037
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)					
8	Pinjaman dengan agunan <i>Secured lending</i>	0	0	0	0
9	Tagihan berasal dari pihak lawan (<i>counterparty</i>) yang bersifat lancar (<i>inflows from fully performing exposures</i>)	271,970	212,486	391,524	289,693
10	Arus kas masuk lainnya	842,615	427,043	986,224	494,894
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)	1,114,585	639,529	1,377,748	784,587
			TOTAL ADJUSTED VALUE		TOTAL ADJUSTED VALUE
12	TOTAL HQLA		5,638,064		5,710,115
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		5,298,263		4,904,450
14	LCR (%)		106.41%		116.43%

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



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

Nama Bank : Bank of China (Hong Kong) Jakarta Branch
Posisi Laporan : 30 September 2017

Analisis

Persentase LCR triwulanan III tahun 2017 turun 10.01% dari triwulan II 2017 menjadi 106.41%, total rata-rata HQLA untuk triwulan III adalah Rp.5,638 miliar turun 1.26% dan Net Cash Outflows adalah Rp.5,298 miliar naik 8.03% dari periode sebelumnya. Komposisi HQLA terdiri dari rata-rata kas, penempatan pada Bank Indonesia tidak termasuk Surat Utang Negara (CEMA). Bank menambahkan dana penempatan pada Bank Indonesia berupa Deposito dan SBI yang diperoleh dari eksposur penempatan pada Bank Lain dan eksposur Pinjaman dari Bank lain. Eksposur Derivatif terdiri dari mark to market transaksi Spot, Swap dan Forward. Net cash outflows adalah cash outflows minus cash inflow. Total CEMA dalam SUN adalah Rp.1.1 triliun yang mana tidak dimasukkan dalam perhitungan LCR ini. Total modal per 30 September 2017 adalah Rp.4,399 miliar dengan persentase CAR 27.75% . Persentase LCR untuk triwulan III 2017 diatas batas minimum dari yang telah ditetapkan sebesar 80%.