

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

Nama Bank : Bank of China (Hong Kong) Jakarta Branch

Posisi Laporan : 30 Juni 2022

(dalam jutaan rupiah)

No	Komponen	30 Juni 2022		31 Maret 2022	
		Nilai outstanding kewajiban dan komitmen/nilai tagihan kontraktual	Nilai HQLA setelah pengurangan nilai (haircut) atau Outstanding kewajiban dan komitmen dikalikan tingkat penarikan (run-off rate) atau nilai tagihan kontraktual dikalikan tingkat penerimaan (inflow rate).	Nilai outstanding kewajiban dan komitmen/nilai tagihan kontraktual	Nilai HQLA setelah pengurangan nilai (haircut) atau Outstanding kewajiban dan komitmen dikalikan tingkat penarikan (run-off rate) atau nilai tagihan kontraktual dikalikan tingkat penerimaan (inflow rate).
1	Jumlah data Point yang digunakan dalam perhitungan LCR		91 hari		90 hari
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)					
2	Total High Quality Liquid Asset (HQLA)		37,369,871		27,338,212
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	2,748	137	2,898	145
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	1,620,983	162,098	1,577,055	157,705
4	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:				
	a. Simpanan operasional	39,654,082	9,727,503	29,456,379	7,184,151
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	2,924,230	2,269,138	3,576,691	2,544,043
	c. surat berharga berupa surat utang yang diterbitkan oleh bank (unsecured debt)				
5	Pendanaan dengan agunan (secured funding)				
6	Arus kas keluar lainnya (additional requirement), terdiri dari:				
	a. arus kas keluar atas transaksi derivatif	75,222	75,222	3,541	3,541
	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	5,949,255	630,644	5,436,278	603,697
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana				
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontinjensi pendanaan lainnya	6,619,398	287,369	7,481,485	296,590
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya	355,216	355,216	497,233	497,233
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		13,507,328		11,287,106
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)					
8	Pinjaman dengan agunan Secured lending	0	0	0	0
9	Tagihan berasal dari pihak lawan (counterparty) yang bersifat lancar (inflows from fully performing exposures)	457,198	374,265	632,839	539,406
10	Arus kas masuk lainnya	733,937	374,039	311,183	158,705
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)	1,191,135	748,304	944,022	698,111
12	TOTAL HQLA		37,369,871		27,338,212
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		12,759,025		10,588,995
14	LCR (%)		292.89%		258.18%

Keterangan:

¹Adjusted 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.

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

Nama Bank : Bank of China (Hong Kong) Jakarta Branch

Posisi Laporan : 30 Juni 2022

Analisis
Persentase LCR triwulanan II Juni 2022 naik 34,71% dari triwulan I Maret 2022 menjadi 292,89%, dengan total rata-rata HQLA untuk triwulan II adalah Rp 37.370 miliar naik 36,69% dan Net Cash Outflows adalah Rp.12.759 miliar naik 20,49% dari periode triwulan 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 yang diperoleh dari eksposur Dana Pihak Ketiga dan eksposur Pinjaman dari Bank lain. Eksposur Derivatif terdiri dari mark to market transaksi Spot dan Swap. Net cash outflows adalah cash outflows minus cash inflow. Total CEMA dalam SUN adalah Rp 6.388 miliar yang mana tidak dimasukkan dalam perhitungan LCR ini. Total modal per 30 Juni 2022 adalah Rp 9.470 miliar dengan persentase CAR 42,69% . Persentase LCR untuk triwulan II 2022 diatas batas minimum dari yang telah ditetapkan sebesar 100%.