

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

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

Posisi Laporan : 31 Maret 2018

(dalam jutaan rupiah)

No	Komponen	31 Maret 2018		31 Desember 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		90 hari		92 hari
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)					
2	Total <i>High Quality Liquid Asset</i> (HQLA)		7,777,751		7,040,599
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	7,057	353	7,925	396
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	1,174,224	117,422	1,116,498	111,650
4	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:				
	a. Simpanan operasional	172,155	42,696	637,888	157,704
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	9,466,859	4,121,496	9,726,382	4,345,179
	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	3,780	3,780	6,375	6,375
	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	4,718,790	480,413	4,321,470	451,966
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana				
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	11,214,228	550,848	11,700,949	566,624
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya	2,155,538	2,155,538	1,284,074	1,284,074
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS)		7,472,547		6,923,967
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>)	153,889	150,713	271,614	163,447
10	Arus kas masuk lainnya	887,746	454,134	1,367,977	686,953
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS)	1,041,635	604,848	1,639,591	850,400
		TOTAL ADJUSTED VALUE		TOTAL ADJUSTED VALUE	
12	TOTAL HQLA		7,777,751		7,040,599
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		6,867,699		6,073,567
14	LCR (%)		113.25%		115.92%

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



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

Nama Bank : Bank of China (Hong Kong) Jakarta Branch
Posisi Laporan : 31 Maret 2018

Analisis

Persentase LCR triwulan I tahun 2018 turun 2.67% dari triwulan IV 2017 menjadi 113.25%, total rata-rata HQLA untuk triwulan I adalah Rp.7,778 miliar naik 10.47% dan Net Cash Outflows adalah Rp.6,868 miliar naik 13.08% 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.1.2 triliun yang mana tidak dimasukkan dalam perhitungan LCR ini. Total modal per 31 Maret 2018 adalah Rp.5,252 miliar dengan persentase CAR 32.44% . Persentase LCR untuk triwulan I 2018 diatas batas minimum dari yang telah ditetapkan sebesar 90%.