

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

Nama Bank : PT BANK HSBC INDONESIA

Posisi Laporan : Maret 2017

(dalam juta Rp)

No	Komponen	Posisi Tanggal Laporan		Posisi Tanggal Laporan Sebelumnya	
		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>).	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>).
1	Jumlah data Poin yang digunakan dalam perhitungan LCR		3		3
HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA)					
2	Total <i>High Quality Liquid Asset</i> (HQLA)		5,783,302		4,761,931
ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOW)					
3	Simpanan nasabah perorangan dan Pendanaan yang berasal dari nasabah Usaha Mikro dan Usaha Kecil, terdiri dari:				
	a. Simpanan/Pendanaan stabil		-		-
	b. Simpanan/Pendanaan kurang stabil	9,403,960	940,396	10,204,521	1,020,452
4	Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari:				
	a. Simpanan operasional		-		-
	b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional	5,774,743	2,575,901	6,404,729	2,633,341
	c. surat berharga berupa surat utang yang diterbitkan oleh bank (unsecured Debt)				
5	Pendanaan dengan agunan (<i>secured funding</i>)				
6	Arus kas keluar lainnya (<i>additional requirement</i>), terdiri dari:				
	a. arus kas keluar atas transaksi derivatif	684	684	4,552	4,552
	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	225,625	22,563	254,407	25,441
	e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana				
	f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya	204,024	7,378	187,718	6,514
	g. arus kas keluar kontraktual lainnya				
7	TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOW)		3,546,921		3,690,300
ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)					
8	Pinjaman dengan agunan <i>Secured lending</i>		-	-	-
9	Tagihan berasal dari pihak lawan (<i>counterparty</i>)	2,522,577	1,781,411	3,599,011	2,609,155
10	Arus kas masuk lainnya	1,305	1,305	908	908
11	TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOW)		1,782,716		2,610,063
			TOTAL ADJUSTED VALUE¹		TOTAL ADJUSTED VALUE¹
12	TOTAL HQLA		5,783,302		4,761,931
13	TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS)		1,764,206		1,080,237
14	LCR (%)		328%		441%

erangan:

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.