

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

Nama Bank : HSBC
Posisi Laporan : Triwulan I 2018

(dalam jutaan rupiah)

| No | Komponen | INDIVIDUAL | | | |
|---|--|---|---|---|---|
| | | Posisi Tanggal Laporan | | Posisi Tanggal Laporan Sebelumnya | |
| | | 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 Poin yang digunakan dalam perhitungan LCR | | 62 hari | | 62 hari |
| HIGH QUALITY LIQUID ASSET (HQLA) | | | | | |
| 2 | Total High Quality Liquid Asset (HQLA) | | 1,424,338 | | 2,064,405 |
| 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 | - | - | - | - |
| | b. Simpanan/ Pendanaan kurang stabil | - | - | - | - |
| 4 | Pendanaan yang berasal dari nasabah korporasi, terdiri dari: | | | | |
| | a. Simpanan operasional | - | - | - | - |
| | b. Simpanan non-operasional dan/atau kewajiban lainnya yang bersifat non-operasional | 72 | 14 | 199,105 | 199,046 |
| | 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 | - | - | - | - |
| | 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 | - | - | - | - |
| | e. arus kas keluar atas kewajiban kontraktual lainnya terkait penyaluran dana | - | - | - | - |
| | f. arus kas keluar atas kewajiban kontijensi pendanaan lainnya | - | - | - | - |
| | g. arus kas keluar kontraktual lainnya | - | - | - | - |
| 7 | TOTAL ARUS KAS KELUAR (CASH OUTFLOWS) | | 14 | | 199,046 |
| ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS) | | | | | |
| 8 | Pinjaman dengan agunan Secured lending | - | - | - | - |
| 9 | Tagihan berasal dari pihak lawan (counterparty) yang bersifat lancar (inflows from fully performing exposures) | 6,027,349 | 6,027,349 | 4,261,883 | 4,261,883 |
| 10 | Arus kas masuk lainnya | - | - | - | - |
| 11 | TOTAL ARUS KAS MASUK (CASH INFLOWS) | 6,027,349 | 6,027,349 | 4,261,883 | 4,261,883 |
| | | | TOTAL ADJUSTED VALUE¹ | | TOTAL ADJUSTED VALUE¹ |
| 12 | TOTAL HQLA | | 1,424,338 | | 2,064,405 |
| 13 | TOTAL ARUS KAS KELUAR BERSIH (NET CASH OUTFLOWS) | | 4 | | 49,761 |
| 14 | LCR (%) | | 39342682.6% | | 4148.6% |

Keterangan:¹ Adjusted value 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 : HSBC

Posisi Laporan : Triwulan I 2018

| Analisis |
|--|
| <p>Jumlah rata-rata harian HQLA yang dimiliki Bank adalah sebesar Rp 1,4 Triliun dengan jumlah arus kas keluar bersih sebesar Rp 4 Miliar sehingga posisi LCR pada triwulan I 2018 adalah sebesar 39342682.6 % yang berada jauh di atas batas minimum yang ditentukan oleh OJK.</p> <p>Kenaikan persentasi LCR disebabkan oleh penurunan net cash outflow sebesar 99,99% yang lebih besar dari penurunan HQLA sebesar 31%.</p> |