

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
ĐÃ ĐƯỢC KIỂM TOÁN

Tại thời điểm 31/12/2016



HÀ NỘI, THÁNG 03 NĂM 2017

MỤC LỤC

NỘI DUNG	TRANG
BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC	02 - 03
BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP	04 - 05
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	06 - 13

7000
G T
IEM HU
V VÀ DU
T N CA
4Y

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

Ban Giám đốc Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Thái Bình Dương (gọi tắt là “Công ty”) trình bày Báo cáo của Ban Giám đốc cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được kiểm toán tại thời điểm 31/12/2016.

Khái quát chung về Công ty

Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Thái Bình Dương tiền thân là Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Hapaco, trước đó là Công ty Cổ phần Quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Hải Phòng. Công ty được thành lập và hoạt động tại Việt Nam theo Giấy phép số 16/UBCK-GPHĐQLQ ngày 29/12/2006, Giấy phép điều chỉnh số 03/GPĐC-UBCK ngày 23/01/2015 và Giấy phép điều chỉnh số 29/GPĐC-UBCK ngày 04/11/2015 của Ủy ban Chứng khoán Nhà Nước.

Theo Giấy phép số 16/UBCK-GPHĐQLQ thì vốn Điều lệ của Công ty là: **35.000.000.000 VND** (Ba mươi lăm tỷ đồng Việt Nam)

Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Ban kiểm soát nội bộ

Các thành viên Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Ban kiểm soát nội bộ điều hành Công ty cho kỳ hoạt động từ 01/01/2016 đến 31/12/2016 và đến ngày lập Báo cáo này, gồm:

Hội đồng quản trị

Ông Lê Minh Thành
Ông Lê Đình Quang
Bà Lê Thị Quỳnh Trang

Chức vụ

Chủ tịch
Thành viên
Thành viên

Ban Giám đốc

Ông Phạm Quang Trung

Chức vụ

Tổng Giám đốc

Bộ phận Kiểm soát nội bộ

Bà Nguyễn Thu Hằng

Chức vụ

Trưởng bộ phận

Trụ sở chính:

Địa chỉ: Tầng 10, Tòa nhà Công ty 18-4, Số 8 Phạm Hùng, phường Mai Dịch, Quận Cầu Giấy, Hà Nội

Công bố trách nhiệm của Ban Giám đốc đối với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Ban Giám đốc Công ty có trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 31/12/2016 phản ánh một cách trung thực và hợp lý tình hình tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 31/12/2016 và nhận thấy không có vấn đề bất thường xảy ra có thể ảnh hưởng đến khả năng hoạt động liên tục của Công ty.

Trong quá trình lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính, Ban Giám đốc Công ty cam kết đã tuân thủ các quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính và đã được sửa đổi bổ sung theo Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/12/2012 của Bộ Tài chính về việc quy định các chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chỉ tiêu an toàn tài chính.

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC
(tiếp theo)

Ban Giám đốc Công ty cam kết rằng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại thời điểm ngày 31/12/2016, phù hợp với quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 đã được sửa đổi, bổ sung theo Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 của Bộ Tài chính.

Thay mặt và đại diện cho Ban Giám đốc,

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG



Lê Minh Thành

Chủ tịch Hội đồng Quản trị

Hà Nội, ngày 08 tháng 03 năm 2017

Số: 246 -17/BC-TC/VAE

Hà Nội, ngày 30 tháng 3 năm 2017

BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

Kính gửi: Hội đồng Quản trị và Ban Giám đốc
Công ty CP Quản lý quỹ Thái Bình Dương

Chúng tôi, Công ty TNHH Kiểm toán và Định giá Việt Nam đã tiến hành kiểm toán Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 31/12/2016 được lập ngày 08 tháng 03 năm 2017 của Công ty CP Quản lý quỹ Thái Bình Dương (gọi tắt là "Công ty") từ trang 6 đến trang 13 kèm theo.

Trách nhiệm của Ban Giám đốc

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm về việc lập và trình bày trung thực và hợp lý Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty theo Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính quy định chi tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng các chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 và chịu trách nhiệm về kiểm soát nội bộ mà Ban Giám đốc xác định là cần thiết để đảm bảo cho việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính không có sai sót trọng yếu do gian lận và nhầm lẫn.

Trách nhiệm của Kiểm toán viên

Trách nhiệm của chúng tôi là đưa ra ý kiến về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính dựa trên kết quả của cuộc kiểm toán. Chúng tôi đã tiến hành kiểm toán theo các chuẩn mực kiểm toán Việt Nam. Các chuẩn mực này yêu cầu chúng tôi tuân thủ chuẩn mực và các quy định về đạo đức nghề nghiệp, lập kế hoạch và thực hiện cuộc kiểm toán để đạt được sự đảm bảo hợp lý về việc liệu báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty có còn sai sót trọng yếu hay không.

Công việc kiểm toán bao gồm thực hiện các thủ tục nhằm thu thập các bằng chứng kiểm toán về các số liệu và thuyết minh trên Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính. Các thủ tục kiểm toán được lựa chọn dựa trên xét đoán của kiểm toán viên, bao gồm đánh giá rủi ro có sai sót trọng yếu trong Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính do gian lận hoặc nhầm lẫn.

Chúng tôi tin tưởng rằng các bằng chứng kiểm toán mà chúng tôi đã thu thập được là đầy đủ và thích hợp làm cơ sở cho ý kiến kiểm toán của chúng tôi.

BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

(tiếp theo)

Ý kiến của Kiểm toán viên

Theo ý kiến chúng tôi, xét trên các khía cạnh trọng yếu, Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại thời điểm 31/12/2016 được lập và trình bày phù hợp với các quy định của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính về việc quy định chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 của Bộ Tài chính về việc sửa đổi thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010.



Phạm Hùng Sơn
Phó Tổng giám đốc
Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0813-2013-034-1

Ngô Bá Duy
Kiểm toán viên
Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 1107-2013-034-1

Thay mặt và đại diện cho
CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN VÀ ĐỊNH GIÁ VIỆT NAM



V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Hà Nội, ngày 08 tháng 03 năm 2017

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 31 tháng 12 năm 2016

Chúng tôi cam đoan rằng:

- (1) Báo cáo được xây dựng trên cơ sở số liệu được cập nhật tại ngày lập báo cáo và được lập theo đúng các quy định tại Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính quy định về chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng các chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC của Bộ Tài chính quy định về chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng các chỉ tiêu an toàn tài chính.
- (2) Đối với những vấn đề có thể ảnh hưởng đến tình hình tài chính của Công ty phát sinh sau ngày lập báo cáo này, chúng tôi sẽ cập nhật trong kỳ báo cáo tiếp theo;
- (3) Chúng tôi xin hoàn toàn chịu trách nhiệm trước Pháp luật về tính chính xác và trung thực của nội dung báo cáo.

Phụ trách kế toán



Đâu Thị Hương

**Bộ phận
Kiểm soát nội bộ**



Nguyễn Thu Hằng

**Chủ tịch
Hội đồng Quản trị**



Lê Minh Thành

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm 31/12/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
A	NGUỒN VỐN			
1	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	35.000.000.000		
2	Thặng dư vốn cổ phần, vốn khác không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	-		
3	Cổ phiếu quỹ	-		
4	Quỹ dự trữ bổ sung vốn điều lệ (nếu có)	-		
5	Quỹ đầu tư phát triển	297.571.576		
6	Quỹ dự phòng tài chính	595.143.152		
7	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-		
8	Lợi nhuận lũy kế và lợi nhuận chưa phân phối trước khi trích lập các khoản dự phòng theo quy định pháp luật.	6.495.685.490		
9	Chênh lệch đánh giá lại tài sản (50% tăng thêm hoặc 100% giảm đi)	-		
10	Chênh lệch tỷ giá hối đoái	-		
11	Lợi ích của cổ đông thiểu số	-		
12	Các khoản nợ có thể chuyển đổi			-
13	Toàn bộ phần giảm đi hoặc tăng thêm của các chứng khoán tại chỉ tiêu đầu tư tài chính		6.216.719.500	-
1A	Tổng			36.171.680.718
B	TÀI SẢN NGẮN HẠN			
I	Tiền và các khoản tương đương tiền			
II	Các khoản đầu tư tài chính ngắn hạn			
1	Đầu tư ngắn hạn		-	
	Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 8			
	Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 5		-	
2	Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn (*)			
III	Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác		240.000.000	
1	Phải thu của khách hàng		240.000.000	
	Phải thu của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống		240.000.000	
2	Trả trước cho người bán		-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm 31/12/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

3	Phải thu nội bộ ngắn hạn			
	<i>Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4	Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán		-	
	<i>Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
5	Các khoản phải thu khác		-	
	<i>Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
6	Dự phòng phải thu ngắn hạn khó đòi (*)			
IV	Hàng tồn kho		-	
V	Tài sản ngắn hạn khác		-	
1	Chi phí trả trước ngắn hạn		-	
2	Thuế GTGT được khấu trừ			
3	Thuế và các khoản phải thu nhà nước			
4	Tài sản ngắn hạn khác		-	
4.1	Tạm ứng		-	
	<i>Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4.2	Phải thu khác, tài sản ngắn hạn khác		-	
1B	Tổng			240.000.000
C	TÀI SẢN DÀI HẠN			
I	Các khoản phải thu dài hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác		-	
1	Phải thu dài hạn của khách hàng		-	
	<i>Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
2	Vốn kinh doanh ở đơn vị trực thuộc		-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm 31/12/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

3	Phải thu dài hạn nội bộ		-	
	<i>Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4	Phải thu dài hạn khác		-	
	<i>Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
5	Dự phòng phải thu dài hạn khó đòi (*)			
II	Tài sản cố định		1.260.484.178	
III	Bất động sản đầu tư			
IV	Các khoản đầu tư tài chính dài hạn		-	
1	Đầu tư vào công ty con		-	
2	Đầu tư vào công ty liên kết, liên doanh		-	
3	Đầu tư chứng khoán dài hạn		-	
	<i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 8</i>			
	<i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 5</i>		-	
4	Đầu tư dài hạn khác		-	
5	Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn		-	
V	Tài sản dài hạn khác		40.200.668	
	Các chỉ tiêu tài sản bị coi là khoản ngoại trừ tại báo cáo tài chính năm đã kiểm toán mà không bị tính giảm trừ theo quy định tại Điều 5		-	
1C	Tổng		1.300.684.846	
VỐN KHẢ DỤNG = (1A) - (1B) - (1C)				34.630.995.872

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm 31/12/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG**

Các hạng mục đầu tư		Hệ số rủi ro (1)	Quy mô rủi ro (2)	Giá trị rủi ro (3) = (1) x (2)
I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ			23.808.443.610	-
1	Tiền mặt (VND)	0%	3.808.443.610	-
2	Các khoản tương đương tiền, tiền gửi có kỳ hạn	0%	20.000.000.000	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ	0%		-
II. Trái phiếu chính phủ			-	-
4	Trái phiếu chính phủ không trả lãi	0%	-	-
5	Trái phiếu chính phủ trả lãi suất cố định		-	-
5.1	Trái phiếu Chính phủ, Trái phiếu Chính phủ các nước thuộc khối OECD hoặc được bảo lãnh bởi Chính phủ hoặc Ngân hàng Trung ương của các nước thuộc khối này, Trái phiếu được phát hành bởi các tổ chức quốc tế IBRD, ADB, IADB, AFDB, EIB và EBRD	3%	-	-
5.2	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm;	3%	-	-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 tới 5 năm;	4%	-	-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên;	5%	-	-
III. Trái phiếu doanh nghiệp			-	-
6	Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	8%	-	-
	Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn từ 1 tới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	15%	-	-
	Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	20%	-	-

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm 31/12/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)**A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG (tiếp theo)**

	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	25%	-	-
7	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 1 tới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	30%	-	-
	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%	-	-
IV. Cổ phiếu			7.113.700.000	1.067.055.000
8	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hồ Chí Minh; chứng chỉ quỹ mở	10%	-	-
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	7.113.700.000	1.067.055.000
10	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi các công ty đại chúng chưa niêm yết, đăng ký giao dịch qua hệ thống UpCom	20%	-	-
11	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các công ty đại chúng đã đăng ký lưu ký, chưa niêm yết hoặc đăng ký giao dịch; cổ phiếu đang trong đợt phát hành lần đầu (IPO)	30%	-	-
12	Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	-	-
V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán			-	-
13	Quỹ đại chúng, bao gồm cả công ty đầu tư chứng khoán đại chúng	10%	-	-
14	Quỹ thành viên, công ty chứng khoán riêng lẻ	30%	-	-
VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch			301.448.630	150.724.315
15	Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	301.448.630	150.724.315
VII. Chứng khoán khác			2.511.644.800	2.009.315.840
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	2.511.644.800	2.009.315.840
VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)				
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
	PVR	20%	834.480.000	166.896.000
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)				3.393.991.155

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
Tại thời điểm 31/12/2016
(tiếp theo)

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

B. RỦI RO THANH TOÁN

Loại hình giao dịch		Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
1	Tiền gửi kỳ hạn và các khoản tiền cho vay không có tài sản đảm bảo và các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán	-	-	-	-	1.203.019.927	3.706.407	1.206.726.334
2	Cho vay chứng khoán/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
3	Vay chứng khoán/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
4	Hợp đồng mua chứng khoán có cam kết bán lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
5	Hợp đồng bán chứng khoán có cam kết mua lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-

II. Rủi ro quá thời hạn thanh toán

	Thời gian quá hạn	Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	0-15 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	16%	-	-
2	16-30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	32%	-	-
3	31-60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	48%	-	-
4	Từ 60 ngày trở đi	100%	831.773.429	831.773.429

III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)

	Chi tiết tới từng khoản vay, tới từng đối tác	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
	Tiền gửi có kỳ hạn tại NH BIDV	30%	1.200.000.000	360.000.000

B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B= I+II+III)

2.398.499.763

C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)

Giá trị

I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	6.630.149.434
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	2.071.034.102
	1. Chi phí khấu hao	166.636.374
	2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	2.392.450.000
	3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	(434.485.821)
	4. Dự phòng phải thu khó đòi	(53.566.451)
III.	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III=I-II)	4.559.115.332
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV=25%xIII)	1.139.778.833
V	20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	5.000.000.000
C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C= Max{IV,V})		5.000.000.000
D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)		10.792.490.918

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
Tại thời điểm 31/12/2016
(tiếp theo)

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

III. BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG

STT	Các chỉ tiêu	Giá trị rủi ro/Vốn khả dụng	Ghi chú
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	3.393.991.155	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	2.398.499.763	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	10.792.490.918	
5	Vốn khả dụng	34.630.995.872	
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	320,88%	

Hà Nội, ngày 08 tháng 03 năm 2017

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG

Phụ trách kế toán

Đâu Thị Hương

Bộ phận
Kiểm soát nội bộ

Nguyễn Thu Hằng

Chủ tịch Hội đồng Quản trị

Lê Minh Thành