

**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 31/12/2017**



**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG**

Tầng 10, tòa nhà Công ty 18-4, số 8 Phạm Hùng, Phường Mai Dịch, Quận Cầu Giấy, Hà Nội

**MỤC LỤC**

**NỘI DUNG**

**TRANG**

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

02

BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

03

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

04 - 11

**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 31/12/2017.

**Khái quát chung về Công ty**

Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Thái Bình Dương (sau đây gọi tắt là “Công ty”) 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 30/GPĐC-UBCK ngày 16/03/2012, Giấy phép điều chỉnh số 01/GPĐC-UBCK ngày 03/01/2014 và Giấy phép điều chỉnh số 29/GPĐC-UBCK ngày 04/11/2015 của Ủy ban Chứng khoán Nhà Nước.

Theo giấy phép điều chỉnh số 30/GPĐC-UBCK ngày 16/03/2012 thì vốn Điều lệ của Công ty là: **35.000.000.000 VND** (Bằng chữ: Ba mươi lăm tỷ đồng Việt Nam).

**Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Bộ phận Kiểm soát nội bộ**

Các thành viên Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Bộ phận kiểm soát nội bộ điều hành Công ty cho năm tài chính kết thúc ngày 31/12/2017 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:** 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 31/12/2017 phản ánh một cách trung thực và hợp lý Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 31/12/2017 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 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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.

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 31/12/2017, phù hợp với quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính.

Thay mặt và đại diện cho Ban Giám đốc,

**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG**



**Phạm Quang Trung**

**Tổng giám đốc**

Hà Nội, ngày 16 tháng 03 năm 2018

Số: 258 -18/BC-TC/VAE

Hà Nội, ngày tháng 03 năm 2018

**BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP**  
về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 31/12/2017

Kính gửi : **Hội đồng quản trị và Ban Giám đốc**  
**Công ty Cổ phần 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 ngày 31/12/2017 của Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Thái Bình Dương (gọi tắt là "Công ty") được lập ngày 16 tháng 03 năm 2018, từ trang 04 đến trang 11 kèm theo.

**Trách nhiệm của Ban Giám đốc**

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm lập và trình bày trung thực và hợp lý Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 31/12/2017 phù hợp quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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 các chỉ tiêu an toàn tài chính 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 tại thời điểm 31/12/2017 không có sai sót trọng yếu do gian lận hoặc 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.

**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 31/12/2017 được lập và trình bày phù hợp với các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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 các chỉ tiêu an toàn tài chính.



**Phạm Hùng Sơn**  
Phó Tổng giám đốc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0813-2018-034-1

**Ngô Bá Duy**  
Kiểm toán viên

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 1107-2018-034-1

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

Số:

V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Hà Nội ngày 16 tháng 03 năm 2018

**Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước**  
**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**  
Tại thời điểm: 31/12/2017

Chúng tôi cam đoan rằng:

- (1) Báo cáo được xây dựng trên cơ sở số liệu được cập nhật tại ngày lập báo cáo theo đúng quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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 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.

**Kế toán trưởng**



**Đâu Thị Hương**

**Kiểm soát nội bộ**



**Nguyễn Thu Hằng**

**Tổng Giám đốc**



**Phạm Quang Trung**

**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm: 31/12/2017

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)                   |
| <b>A</b>   | <b>Nguồn vốn chủ sở hữu</b>                                                           |                 |                      |                       |
| 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 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 (nếu có)                                                        | 297.571.576     |                      |                       |
| 6          | Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ                                            | 595.143.152     |                      |                       |
| 7          | Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu                                                         | -               |                      |                       |
| 8          | Lợi nhuận sau thuế chưa phân phối                                                     | (5.826.218.671) |                      |                       |
| 9          | Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản                                               | 10.129.660.987  |                      |                       |
| 10         | Chênh lệch đánh giá lại tài sản cố định                                               | -               |                      |                       |
| 11         | Chênh lệch tỷ giá hối đoái                                                            | -               |                      |                       |
| 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 |                 | 6.994.620.500        | -                     |
| 14         | Vốn khác (nếu có)                                                                     | -               |                      |                       |
| <b>1A</b>  | <b>Tổng</b>                                                                           |                 |                      | <b>33.201.536.544</b> |
| <b>B</b>   | <b>Tài sản ngắn hạn</b>                                                               |                 |                      |                       |
| <b>I</b>   | <b>Tiền và các khoản tương đương tiền</b>                                             |                 |                      |                       |
| <b>II</b>  | <b>Các khoản đầu tư tài chính ngắn hạn</b>                                            |                 |                      |                       |
| 1          | Đầu tư ngắn hạn                                                                       |                 | -                    |                       |
|            | Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9                |                 | -                    |                       |
|            | Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 6                |                 | -                    |                       |
| 2          | Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn                                                     |                 |                      |                       |
| <b>III</b> | <b>Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác</b>               |                 | <b>1.522.000.000</b> |                       |
|            | Phải thu của khách hàng                                                               |                 | -                    |                       |
| 1          | - Phải thu của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống         |                 | -                    |                       |
|            | - Phải thu của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày                 |                 | -                    |                       |
| 2          | Trả trước cho người bán                                                               |                 | 22.000.000           |                       |

**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

**I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)**

|           |                                                                                                |  |                   |  |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------|--|
| 3         | Phải thu hoạt động nghiệp vụ                                                                   |  |                   |  |
|           | - Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống             |  | -                 |  |
| 4         | Phải thu nội bộ ngắn hạn                                                                       |  |                   |  |
|           | - Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống                          |  | -                 |  |
| 5         | Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán                                                       |  | -                 |  |
|           | - Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống |  | -                 |  |
| 6         | Các khoản phải thu khác                                                                        |  | -                 |  |
|           | - Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống                            |  | -                 |  |
| 7         | Dự phòng phải thu ngắn hạn khó đòi                                                             |  | -                 |  |
| <b>IV</b> | <b>Hàng tồn kho</b>                                                                            |  | -                 |  |
| <b>V</b>  | <b>Tài sản ngắn hạn khác</b>                                                                   |  | -                 |  |
| 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                                                                                        |  | -                 |  |
|           | - Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại từ 90 ngày trở xuống                                    |  | -                 |  |
| 4.2       | Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại trên 90 ngày                                              |  | -                 |  |
|           | Tài sản ngắn hạn khác                                                                          |  | -                 |  |
| <b>1B</b> | <b>Tổng</b>                                                                                    |  | <b>22.000.000</b> |  |
| <b>C</b>  | <b>Tài sản dài hạn</b>                                                                         |  |                   |  |
| <b>I</b>  | <b>Các khoản phải thu dài hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác</b>                         |  | -                 |  |
| 1         | Phải thu dài hạn của khách hàng                                                                |  |                   |  |
|           | - Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống          |  |                   |  |

**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

**I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)**

|                                    |                                                                                                                                                                                                             |  |                      |                       |
|------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|----------------------|-----------------------|
|                                    | - Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày                                                                                                                               |  | -                    |                       |
| 2                                  | Vốn kinh doanh ở đơn vị trực thuộc                                                                                                                                                                          |  |                      |                       |
|                                    | Phải thu dài hạn nội bộ                                                                                                                                                                                     |  | -                    |                       |
| 3                                  | - Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống                                                                                                                               |  |                      |                       |
|                                    | - Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày                                                                                                                                       |  | -                    |                       |
|                                    | Phải thu dài hạn khác                                                                                                                                                                                       |  |                      |                       |
| 4                                  | - Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống                                                                                                                                 |  |                      |                       |
|                                    | - Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày                                                                                                                                         |  | -                    |                       |
| 5                                  | Dự phòng phải thu dài hạn khó đòi                                                                                                                                                                           |  |                      |                       |
| <b>II</b>                          | <b>Tài sản cố định</b>                                                                                                                                                                                      |  | <b>1.013.867.794</b> |                       |
| <b>III</b>                         | <b>Bất động sản đầu tư</b>                                                                                                                                                                                  |  | -                    |                       |
| <b>IV</b>                          | <b>Các khoản đầu tư tài chính dài hạn</b>                                                                                                                                                                   |  | <b>2.511.644.800</b> |                       |
| 1                                  | Đầu tư vào công ty con                                                                                                                                                                                      |  | -                    |                       |
| 2                                  | Vốn góp liên doanh                                                                                                                                                                                          |  | -                    |                       |
| 3                                  | Đầu tư vào công ty liên kết, liên doanh                                                                                                                                                                     |  | -                    |                       |
|                                    | Đầu tư chứng khoán dài hạn                                                                                                                                                                                  |  | -                    |                       |
| 4                                  | - Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9                                                                                                                                    |  | -                    |                       |
|                                    | - Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 6                                                                                                                                    |  | -                    |                       |
| 5                                  | Các khoản đầu tư dài hạn ra nước ngoài                                                                                                                                                                      |  | -                    |                       |
| 6                                  | Đầu tư dài hạn khác                                                                                                                                                                                         |  | 2.511.644.800        |                       |
| 7                                  | Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn                                                                                                                                                                  |  | -                    |                       |
| <b>V</b>                           | <b>Tài sản dài hạn khác</b>                                                                                                                                                                                 |  | <b>58.672.571</b>    |                       |
| 1                                  | Chi phí trả trước dài hạn                                                                                                                                                                                   |  | 58.672.571           |                       |
| 2                                  | Tài sản thuế thu nhập hoãn lại                                                                                                                                                                              |  | -                    |                       |
| 3                                  | Ký cược, ký quỹ dài hạn                                                                                                                                                                                     |  | -                    |                       |
|                                    | <b>Các chỉ tiêu tài sản</b> bị coi là khoản ngoại trừ, có ý kiến trái ngược hoặc từ chối đưa ra ý kiến tại báo cáo tài chính đã được kiểm toán, soát xét mà không bị tính giảm trừ theo quy định tại Điều 6 |  | 1.500.000.000        |                       |
| <b>1C</b>                          | <b>Tổng</b>                                                                                                                                                                                                 |  | <b>5.084.185.165</b> |                       |
| <b>VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C</b> |                                                                                                                                                                                                             |  |                      | <b>28.095.351.379</b> |

## BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

### II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

| A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                  |                |                 |
|-------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------|-----------------|
| Các hạng mục đầu tư                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | Hệ số rủi ro (%) | Quy mô rủi ro  | Giá trị rủi ro  |
|                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | (1)              | (2)            | (3) = (1) x (2) |
| I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                  | 20.237.726.343 | -               |
| 1                                                                 | Tiền mặt (VND)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 0                | 737.726.343    |                 |
| 2                                                                 | Các khoản tương đương tiền                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 0                | 19.500.000.000 | -               |
| 3                                                                 | Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi                                                                                                                                                                                                                                                                               | 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: Trái phiếu Chính phủ (bao gồm công trái và trái phiếu công trình đã phát hành trước đây), 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                | -              | -               |
| 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 còn lại từ 1 năm đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                                                                                                                                                                                                           | 10               | -              | -               |
|                                                                   | Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                                                                                                                                                                                                           | 15               | -              | -               |
|                                                                   | Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                                                                                                                                                                                                                  | 20               | -              | -               |
| 7                                                                 | Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                                                                                                                                                                                                                  | 25               | -              | -               |
|                                                                   | Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 năm đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                                                                                                                                                                                                     | 30               | -              | -               |

**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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

| <b>A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (tiếp theo)</b>                         |                                                                                                                                                                              |               |                      |                      |
|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------------|----------------------|
|                                                                         | Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                  | 35            | -                    | -                    |
|                                                                         | Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi                                                                         | 40            | -                    | -                    |
| <b>IV. Cổ phiếu</b>                                                     |                                                                                                                                                                              |               | <b>5.968.964.000</b> | <b>1.115.554.600</b> |
| 8                                                                       | Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố 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            | 1.564.764.000        | 234.714.600          |
| 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            | 4.404.200.000        | 880.840.000          |
| 11                                                                      | Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các công ty đại chúng đã đăng ký lưu ký, nhưng 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            | -                    | -                    |
| <b>V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán</b>                              |                                                                                                                                                                              |               | -                    | -                    |
| 13                                                                      | Quỹ đại chúng, bao gồm cả công ty đầu tư chứng khoán đại chúng                                                                                                               | 10            | -                    | -                    |
| 14                                                                      | Quỹ thành viên, công ty đầu tư chứng khoán riêng lẻ                                                                                                                          | 30            | -                    | -                    |
| <b>VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch</b>                             |                                                                                                                                                                              |               | <b>301.448.630</b>   | <b>150.724.315</b>   |
| 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          |
| <b>VII. Các tài sản khác</b>                                            |                                                                                                                                                                              |               | -                    | -                    |
| 17                                                                      | Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác                                                                                                                           | 80            | -                    | -                    |
| <b>VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>                                  |                                                                                                                                                                              |               |                      | <b>88.084.000</b>    |
|                                                                         | Mã chứng khoán                                                                                                                                                               | Mức tăng thêm | Quy mô rủi ro        | Giá trị rủi ro       |
| 1                                                                       | PVR                                                                                                                                                                          | 10            | 880.840.000          | 88.084.000           |
| <b>A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)</b> |                                                                                                                                                                              |               |                      | <b>1.354.362.915</b> |

**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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

| B. RỦI RO THANH TOÁN                            |                                                                                                                                                   |                |     |               |     |                |               |                     |
|-------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----|---------------|-----|----------------|---------------|---------------------|
| Loại hình giao dịch                             |                                                                                                                                                   | Giá trị rủi ro |     |               |     |                |               | Tổng giá trị rủi ro |
|                                                 |                                                                                                                                                   | (1)            | (2) | (3)           | (4) | (5)            | (6)           |                     |
| I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán             |                                                                                                                                                   |                |     |               |     |                |               |                     |
| 1                                               | Tiền gửi kỳ hạn, các khoản tiền cho vay không có tài sản bảo đảm và các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán | -              | -   | -             | -   | -              | 1.170.000.000 | 1.170.000.000       |
| 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                                                               | -              | -   | -             | -   | -              | -             | -                   |
| 6                                               | Hợp đồng cho vay mua ký quỹ (cho khách hàng vay mua chứng khoán)/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                                               | Từ 0 đến 15 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán                                                                                 | 16%            |     | -             |     | -              |               |                     |
| 2                                               | Từ 16 đến 30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán                                                                                | 32%            |     | -             |     | -              |               |                     |
| 3                                               | Từ 31 đến 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán                                                                                | 48%            |     | -             |     | -              |               |                     |
| 4                                               | Từ 60 ngày trở lên sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán                                                                               | 100%           |     | 1.071.573.429 |     | 1.071.573.429  |               |                     |
| 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 |               |                     |
| 1                                               | Tiền gửi có kỳ hạn tại Ngân hàng TMCP Đầu tư và phát triển Việt Nam                                                                               | 30%            |     | 1.170.000.000 |     | 351.000.000    |               |                     |
| B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B= I+II+III) |                                                                                                                                                   |                |     |               |     |                | 2.592.573.429 |                     |

## BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 31/12/2017

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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

| C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)  |                                                                                 | Giá trị       |
|-------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| I                                               | Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới tháng 12 năm 2017 | 3.461.596.965 |
| II                                              | Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí                                            | 1.132.936.184 |
|                                                 | 1. Chi phí khấu hao                                                             | 246.616.384   |
|                                                 | 2. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn              | 777.901.000   |
|                                                 | 3. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn               | (27.761.086)  |
|                                                 | 4. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng phải thu khó đòi                                  | 136.179.886   |
| III                                             | Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III=I-II)                                        | 2.328.660.781 |
| IV                                              | 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV=25%III)                                   | 582.165.195   |
| 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)                  |                                                                                 | 8.946.936.344 |

### 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 (nếu có) |
|-----|------------------------------------|------------------------------|------------------|
| 1   | Tổng giá trị rủi ro thị trường     | 1.354.362.915                |                  |
| 2   | Tổng giá trị rủi ro thanh toán     | 2.592.573.429                |                  |
| 3   | Tổng giá trị rủi ro hoạt động      | 5.000.000.000                |                  |
| 4   | Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)      | 8.946.936.344                |                  |
| 5   | Vốn khả dụng                       | 28.095.351.379               |                  |
| 6   | Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4) | 314%                         |                  |

Hà Nội, ngày 16 tháng 03 năm 2018

**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG**

Kế toán trưởng



Đâu Thị Hương

Trưởng bộ phận  
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thu Hằng

Tổng Giám đốc



Phạm Quang Trung