

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT

Tại thời điểm 30/06/2018

HÀ NỘI, THÁNG 08 NĂM 2018

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 - 03

BÁO CÁO SOÁT XÉT

04 - 05

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

06 - 13

228-G
CÔNG TY
HỮU
VÀ DIN
T NA
4Y - T

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 soát xét tại thời điểm 30/06/2018.

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** (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 kỳ hoạt động từ ngày 01/01/2018 đến ngày 30/06/2018 và đến ngày lập Báo cáo này, gồm:

Hội đồng quản trị**Chức vụ**

Ông Lê Minh Thành

Chủ tịch

Ông Lê Đình Quang

Thành viên

Bà Lê Thị Quỳnh Trang

Thành viên

Ban Giám đốc**Chức vụ**

Ông Phạm Quang Trung

Tổng Giám đốc

Bộ phận Kiểm soát nội bộ**Chức vụ**

Bà Nguyễn Thu Hằng

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 30/06/2018 phản ánh một cách trung thực và hợp lý tình hình tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 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 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 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 30/06/2018, 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 05 tháng 08 năm 2018

Số: 54-18/BC-TC/VAE

Hà Nội, ngày 15 tháng 08 năm 2018

BÁO CÁO SOÁT XÉT

Về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018

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

Chúng tôi đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 kèm theo của Công ty CP Quản lý quỹ Thái Bình Dương (gọi tắt là "Công ty") được lập ngày 05 tháng 08 năm 2018, từ trang 06 đến trang 13 đã được Ban Giám đốc của Công ty lập theo các quy định về lập và trình bày báo cáo tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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.

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 30/06/2018 phù hợp quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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 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 30/06/2018 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 kết luận về báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 dựa trên kết quả soát xét của chúng tôi. Chúng tôi đã thực hiện công việc soát xét theo các nguyên tắc của Chuẩn mực Việt Nam về hợp đồng dịch vụ soát xét số 2410 - Soát xét thông tin tài chính giữa niên độ do kiểm toán viên độc lập của đơn vị thực hiện, trong phạm vi các nguyên tắc này có thể được áp dụng cho công việc soát xét thông tin tài chính quá khứ do kiểm toán viên độc lập của đơn vị thực hiện.

Công việc soát xét Thông tin tài chính giữa niên độ bao gồm việc thực hiện các cuộc phỏng vấn, chủ yếu là phỏng vấn những người chịu trách nhiệm về các vấn đề tài chính kế toán, và thực hiện thủ tục phân tích và các thủ tục soát xét khác. Một cuộc soát xét về cơ bản có phạm vi hẹp hơn một cuộc kiểm toán được thực hiện theo các Chuẩn mực kiểm toán Việt Nam và do vậy không cho phép chúng tôi đạt được sự đảm bảo rằng chúng tôi sẽ nhận biết được tất cả các vấn đề trọng yếu có thể được phát hiện trong một cuộc kiểm toán. Theo đó, chúng tôi không đưa ra ý kiến kiểm toán.

BÁO CÁO SOÁT XÉT

Về báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 (tiếp theo)

Kết luận của kiểm toán viên

Căn cứ trên kết quả soát xét của chúng tôi, chúng tôi không thấy có vấn đề gì khiến chúng tôi cho rằng báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo, trên các khía cạnh trọng yếu, được lập và trình bày không phù hợp với quy định của Thông tư 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 của Bộ Tài chính 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.



Phạm Hùng Sơn

Phó Tổng giám đốc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0813-2018-34-1

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 05 tháng 08 năm 2018

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

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.

Phụ trách kế toán



Đâu Thị Hương

**Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ**



Nguyễn Thu Hằng

Tổng Giám đốc



Phạm Quang Trung

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(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 chủ sở hữu			
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	(8.942.739.394)		
9	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	9.884.756.002		
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 chi tiêu đầu tư tài chính		6.701.715.515	-
14	Vốn khác (nếu có)	-		
1A	Tổng			30.133.015.821
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 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			
III	Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác		3.000.000.000	
	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		-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(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 hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày		-	
	Phải thu nội bộ ngắn hạn			
4	- Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống		-	
	- Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày		-	
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		-	
5	- Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày		-	
6	Các khoản phải thu khác		3.000.000.000	
	- Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống		-	
6	- Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày		3.000.000.000	
7	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		-	
	- Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại từ 90 ngày trở xuống		-	
4.1	- Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại trên 90 ngày		-	
4.2	Tài sản ngắn hạn khác		-	
1B	Tổng		3.000.000.000	
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			
	- 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: 30/06/2018

(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			
II	Tài sản cố định		898.070.710	
III	Bất động sản đầu tư		-	
IV	Các khoản đầu tư tài chính dài hạn		2.511.644.800	
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		-	
V	Tài sản dài hạn khác		41.905.640	
1	Chi phí trả trước dài hạn		41.905.640	
2	Tài sản thuế thu nhập hoãn lại		-	
3	Ký cược, ký quỹ dài hạn		-	
	Các chỉ tiêu tài sản 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	
1C	Tổng		4.951.621.150	
VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C				22.181.394.671

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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

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			15.995.241.146	-
1	Tiền mặt (VND)	0	495.241.146	-
2	Các khoản tương đương tiền	0	15.500.000.000	-
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: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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

A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG				
	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	-	-
IV. Cổ phiếu			4.649.960.000	882.934.000
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	941.160.000	141.174.000
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	3.708.800.000	741.760.000
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	-	-
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 đầu tư 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. Các tài sản khác			-	-
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80	-	-
VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)				74.176.000
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	PVR	10	741.760.000	74.176.000
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)				1.107.834.315

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(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	-	-	-	-	930.000.000	2.396.738	932.396.738
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		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%		930.000.000		279.000.000		
B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B= I+II+III)							2.282.970.167	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(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	7.045.835.363
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	2.018.544.782
	1. Chi phí khấu hao	235.349.716
	2. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	1.488.946.015
	3. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	182.069.165
	4. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng phải thu khó đòi	112.179.886
III	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III=I-II)	5.027.290.581
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV=25%III)	1.256.822.645
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)		8.390.804.482

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	1.107.834.315	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	2.282.970.167	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	8.390.804.482	
5	Vốn khả dụng	22.181.394.671	
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	264%	

Hà Nội, ngày 05 tháng 08 năm 2018

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ THÁI BÌNH DƯƠNG

Phụ trách kế toán

Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ

Tổng Giám đốc



Đâu Thị Hương



Nguyễn Thu Hằng




Phạm Quang Trung