

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ
ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Số: 11 /2017/TDC-CBTT

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

TP.HCM, ngày 14 tháng 08 năm 2017

**CÔNG BỐ THÔNG TIN TRÊN CỔNG THÔNG TIN ĐIỆN TỬ CỦA
ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC**

Kính gửi: ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC

Tên Công ty : CTCP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Địa chỉ : Phòng 28-10, tầng 28, tòa nhà Petroland, 12 Tân Trào, P.Tân Phú, Quận 7.

Điện thoại : 08.5416 0779

Fax: 08.5416 0780

Người thực hiện công bố thông tin: Lê Quỳnh Chi

Địa chỉ : 98 Đường 47, P. Tân Quy, Quận 7

Điện thoại : 08.5416 0779

Fax: 08.5416 0780

Loại thông tin công bố: 24h 72h Yêu cầu Bất thường Định kỳ
(công ty đánh dấu X vào mục cần công bố)

Nội dung thông tin công bố: CTCP Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương công bố thông tin Tỷ lệ an toàn tài chính bán niên soát xét 2017

Chúng tôi xin cam kết các thông tin công bố trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu trách nhiệm trước pháp luật về nội dung các thông tin đã công bố.

Nơi nhận

- Như trên;
- Lưu HC-VP



TỔNG GIÁM ĐỐC

Lê Quỳnh Chi

Công ty CP Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương

Địa chỉ: Phòng 28.10, Tầng 28, Tòa nhà Petroland Tower, 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Q.7, TP HCM
ĐT: 84.8.54160779 – Fax: 84.8.54160780

**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ
ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG**

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2017



CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland

Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

NỘI DUNG	Trang
BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC	02 - 03
BÁO CÁO SOÁT XÉT BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	04
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	5
Bảng tính vốn khả dụng	06 - 08
Rủi ro thị trường	09 - 10
Rủi ro thanh toán	11
Rủi ro hoạt động	12
Bảng tổng hợp giá trị rủi ro và vốn khả dụng	13

Đ: E
CỘ
CỘ
H L Y
HỮN
THÁI
- T. P.

0305
TRÁCH
DỊCH
TÀI CHÍNH
VÀ
VI-

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland

Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Ban Tổng Giám đốc Công Ty Cổ Phần Quản Lý Quỹ Đầu Tư Chứng Khoán Thái Dương (sau đây gọi tắt là 'Công ty') trình bày Báo cáo của mình và Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

KHÁI QUÁT CHUNG VỀ CÔNG TY

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương được thành lập và hoạt động theo Giấy phép số 46/UBCK-GP do Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước cấp ngày 20 tháng 1 năm 2009, giấy phép điều chỉnh số 69/UBCK-GP ngày 27 tháng 4 năm 2010, giấy phép điều chỉnh số 20/GPĐC-UBCK ngày 4 tháng 7 năm 2013, giấy phép điều chỉnh số 24/GPĐC-UBCK ngày 09 tháng 09 năm 2015 và giấy phép điều chỉnh số 05/GPĐC-UBCK ngày 26 tháng 05 năm 2016.

Vốn điều lệ của Công ty là 29.000.000.000 đồng, tương đương 2.900.000 cổ phần, mệnh giá một cổ phần là 10.000 đồng

Trụ sở chính:

Địa chỉ: Phòng 28-10, Lầu 28, Tòa nhà Petroland, Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận 7, TP. Hồ Chí Minh

Điện thoại: +84-28-54160779

Fax: +84-28-54160780

Mã số thuế: 0306904274

Ngành nghề kinh doanh của công ty là:

- Lập và quản lý quỹ đầu tư chứng khoán, công ty đầu tư chứng khoán
- Quản lý danh mục đầu tư chứng khoán.
- Tư vấn đầu tư chứng khoán

HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ, BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Các thành viên của Hội đồng quản trị bao gồm:

Bà : Cao Ngọc Diệp	Chủ tịch
Bà : Nguyễn Thị Mai Hoa	Phó Chủ tịch
Ông : Cao Thanh Định	Phó Chủ tịch
Ông : Cao Duy Đông	Thành viên (miễn nhiệm từ ngày 31/07/2017)
Bà : Lê Quỳnh Chi	Thành viên (bổ nhiệm từ ngày 31/07/2017)

Các thành viên của Ban Tổng Giám Đốc và Kế toán trưởng

Bà : Lê Quỳnh Chi	Tổng Giám Đốc
Bà : Trần Thị Thiên Hương	Kế toán trưởng

KIỂM TOÁN VIÊN

Công ty TNHH Dịch vụ Tư vấn Tài chính Kế toán và Kiểm toán Nam Việt (AASCN) đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính cho Công ty.

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland

Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC (TIẾP THEO)

TRÁCH NHIỆM CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC ĐỐI VỚI BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Ban Tổng Giám Đốc chịu trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính và đảm bảo rằng báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý tình hình vốn khả dụng của Công ty tại ngày 30 tháng 06 năm 2017, báo cáo đã tuân thủ các quy định của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31 Tháng 12 năm 2010 và Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 do Bộ Tài chính ban hành về các tỷ lệ an toàn tài chính và biện pháp khắc phục cho các công ty chứng khoán không đáp ứng các quy định về tỷ lệ an toàn tài chính trong việc lập báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2017.

Phê duyệt các báo cáo tài chính

Chúng tôi, Hội đồng quản trị Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương phê duyệt Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2017.

TP. HCM, ngày 30 tháng 06 năm 2017

Thay mặt Hội đồng quản trị

Chủ tịch Hội đồng quản trị

Cao Ngọc Diệp

TP. HCM, ngày 30 tháng 06 năm 2017

Thay mặt Ban Tổng Giám đốc

Tổng Giám đốc



Lê Quỳnh Chi



Số: 284a-2/BCSX/TC

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

**Kính gửi: Quý cổ đông, Hội đồng quản trị và Ban Tổng Giám đốc
Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương**

Chúng tôi đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương được lập ngày 30 tháng 06 năm 2017 gồm: Bảng tính vốn khả dụng, bảng tính giá trị rủi ro và bảng tổng hợp các chỉ tiêu rủi ro và vốn khả dụng tại ngày 30 tháng 06 năm 2017 được trình bày từ trang 5 đến trang 13 kèm theo.

Trách nhiệm của Ban Tổng Giám Đốc

Ban Tổng Giám đốc Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương chịu trách nhiệm lập và trình bày trung thực và hợp lý báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này phù hợp với các quy định của thông tư 226/2010/TT-BTC ban hành ngày 31 tháng 12 năm 2010 và Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 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. Ban Tổng giám đốc chịu trách nhiệm về kiểm soát nội bộ mà Ban Tổng Giám đốc xác định là cần thiết để đảm bảo việc lập và trình bày báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính 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 này dựa trên kết quả soát xét của chúng tôi. Chúng tôi đã thực hiện công việc soát xét theo 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.*

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.

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 việc lập và trình bày báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2017 của Công ty không được lập, trên các khía cạnh trọng yếu, phù hợp với các quy định của thông tư 226/2010/TT-BTC ban hành ngày 31 tháng 12 năm 2010 và Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 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.

Công ty TNHH Dịch vụ Tư vấn Tài chính

Kế toán và Kiểm toán Nam Việt

Phó Giám đốc

Nguyễn Ngọc Tuấn

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 2837-2014-152-1

TP. HCM, ngày 12 tháng 08 năm 2017

Số:

V/v : báo cáo chỉ tiêu an toàn tài chính

Kính gửi : ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
(BÁO CÁO TỶ LỆ VỐN KHẢ DỤNG)
Tại thời điểm 30 tháng 06 năm 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 và được lập theo đúng các quy định tại thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 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 Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 sửa đổi bổ sung một số điều của 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.

(2) : Đối với những vấn đề 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
Bà Trần Thị Thiên Hương



Trưởng Bộ phận kiểm soát nội bộ
Bà Trương Nguyễn Khanh



Tổng Giám đốc
Bà Lê Quỳnh Chi

Thành Phố Hồ Chí Minh, Việt Nam
Ngày 30 Tháng 06 Năm 2017

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 1: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	Nội dung	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng (VNĐ)	Khoản giảm trừ (VNĐ)	Khoản tăng thêm (VNĐ)
		(1)	(2)	(3)
A	Nguồn vốn	27.039.287.349	122.465.258	-
1	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	29.000.000.000	-	-
2	Thặng dư vốn cổ phần	-	-	-
3	Cổ phiếu quỹ	-	-	-
4	Quỹ dự trữ bổ sung vốn Điều lệ	-	-	-
5	Quỹ Đầu tư phát triển	-	-	-
6	Quỹ Dự phòng tài chính	-	-	-
7	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-	-	-
8	Lợi nhuận tích lũy và lợi nhuận chưa phân phối trước khi trích lập các khoản dự phòng theo quy định của pháp luật	(1.960.712.651)	-	-
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	-	122.465.258	-
1A	Tổng			26.916.822.091
B	Tài sản ngắn hạn	-	118.442.036	-
<i>I</i>	<i>Tiền và các khoản tương đương tiền</i>	-	-	-
<i>II</i>	<i>Các khoản đầu tư tài chính ngắn hạn</i>	-	-	-
1	Đầu tư ngắn hạn	-	-	-
	Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường (Thuyết minh 4)	-	-	-
	Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
2	Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn (*)	-	-	-
<i>III</i>	<i>Các khoản phải thu ngắn hạn</i>	-	44.000.000	-
1	Phải thu của khách hàng	-	-	-
	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	-	44.000.000	-
3	Phải thu nội bộ ngắn hạn	-	-	-
	Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống	-	-	-

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 1: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

	<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	-	74.442.036	-
1	Chi phí trả trước ngắn hạn	-	51.618.286	-
2	Thuế GTGT được khấu trừ	-	-	-
3	Thuế và các khoản phải thu nhà nước	-	-	-
4	Tài sản ngắn hạn khác	-	22.823.750	-
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	-	22.823.750	-
1B	Tổng		118.442.036	
C	Tài sản dài hạn	-	23.040.002	-
I	Các khoản phải thu dài hạn	-	-	-
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	-	-	-
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>	-	-	-

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

 Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
 Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
 tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 1: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

	<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	<i>Tài sản cố định</i>	-	-	-
III	<i>Bất động sản đầu tư</i>	-	-	-
IV	<i>Các khoản đầu tư tài chính dài hạn</i>	-	-	-
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	<i>Tài sản dài hạn khác</i>	-	23.040.002	-
	<i>Các chỉ tiêu tài sản bị coi là khoản ngoại trừ tại báo cáo tài chính năm đã được kiểm toán mà không bị tính giảm trừ tại điều 5 thông tư 226</i>	-	-	-
1C	Tổng			23.040.002
	VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C			26.775.340.053

CHỖ ĐÓNG CHỮ VÀ DẤU CHỈ
 ỦY BAN VẤN TOÁN ĐẢN T CHỈ

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG

VNĐ

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			17.754.829.923	-
1	Tiền mặt (VNĐ)	0%	17.663.029.923	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	91.800.000	-
3	Giấy tờ có giá 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 cuống phiếu			-
5,1	<i>Trái phiếu chính phủ, trái phiếu chính phủ các nước thuộc khối OECD hoặc được bảo lãnh bởi chính phủ hoặc các ngân hàng Trung ương của các nước thuộc khối này, trái phiếu được phát hành bởi các tổ chức quốc tế IBRD, IADC, AFDB, EIB và EBRD</i>	3%		-
5,2	<i>Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm</i>	3%		-
	<i>Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 tới 5 năm</i>	4%		-
	<i>Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên</i>	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 đến 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%		-
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 từ 1 đến 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			1.169.521.109	244.220.715

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG

VND

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 đại chúng dạng mở	10%	851.349.600	85.134.960
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%		-
10	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi các công ty đại chúng chưa niêm yết, đăng ký giao dịch qua hệ thống	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	30%		-
12	Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	318.171.509	159.085.755
V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán			-	-
13	Quỹ đại chúng	10%		-
14	Quỹ thành viên	30%		-
VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch			-	-
15	Chứng khoán bị tạm ngừng, đình chỉ giao dịch (không bao gồm trường hợp cổ phiếu tạm ngừng giao dịch để chuyển sàn giao dịch)	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	-	-
VII. Chứng khoán khác			6.229.840.460	4.983.872.368
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	6.229.840.460	4.983.872.368
VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)			-	759.174.474
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	Rủi ro tăng thêm CP Công ty CP DV Sản Xuất Thương Mại	20%	3.795.872.368	759.174.474
(A) TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A = I + II + III + IV + V + VI + VII + VIII)			25.154.191.492	5.987.267.556

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

B. GIÁ TRỊ 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 và các khoản tiền cho vay không có tài sản bảo đảm							-
2	Cho vay chứng khoán							-
3	Vay chứng khoán							-
4	Hợp đồng mua chứng khoán có cam kết bán lại (Repo)							-
5	Hợp đồng bán chứng khoán có cam kết mua lại (Reverse Repo)							-
6	Hợp đồng cho vay mua ký quỹ (cho khách hàng vay mua chứng khoán)/ Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất							-
7	Các khoản mục tiềm ẩn rủi ro thanh toán khác							
	Các khoản phải thu (bao gồm các khoản phải thu khác) có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống							
	Các tài sản khác có hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống							
	Cộng							-
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							
2	16 -30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán							
3	31-60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán							
4	Từ 60 ngày trở đi	100%	1.881.338.690	1.881.338.690				
	Cộng			1.881.338.690				
III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)								
(B) TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B= I+II+III)								1.881.338.690

30521
 CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG
 7.PH

CÔNG TY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG	
I. Tổng Chi phí hoạt động phát sinh trong 12 tháng	2.634.060.457
II. Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	1.184.301.001
1. Chi phí khấu hao	-
2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	(38.261.082)
3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
4. Dự phòng phải thu khó đòi	1.222.562.083
III. Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)	1.449.759.456
IV. 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	362.439.864
V. 25% 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

TY
VN
ĐÀI
HOÀ
NG
10/06

84-
TY
NHƯ
TƯ V
KẾ T
TOÁN
VIỆT
HỒ C

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN THÁI DƯƠNG

Phòng 28-10, tầng 28, Tòa nhà Petroland
Số 12 Tân Trào, P. Tân Phú, Quận. 7, TP. HCM

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

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

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2017

STT	Các chỉ tiêu	Thuyết minh	Giá trị rủi ro / vốn khả dụng
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường		5.987.267.556
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán		1.881.338.690
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động		5.000.000.000
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)		12.868.606.246
5	Vốn khả dụng		26.775.340.053
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)		208,07%



Kế toán trưởng
Bà Trần Thị Thiên Hương



Trưởng Bộ phận kiểm soát nội bộ
Bà Trương Nguyên Khanh



Tổng Giám đốc
Bà Lê Quỳnh Chi

Thành Phố Hồ Chí Minh, Việt Nam
Ngày 30 Tháng 06 Năm 2017