

**CÔNG BỐ THÔNG TIN TRÊN CÔNG 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 : 028.5416 0779 Fax: 028.5416 0780

Người thực hiện công bố thông tin: Lê Quỳnh Chi

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

Điện thoại : 028.5416 0779 Fax: 028.5416 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 báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kiểm toán năm 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

TP.HCM, ngày 20 tháng 03 năm 2018

Người thực hiện công bố thông tin



Lê Quỳnh Chi

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

*BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH*

*Tại ngày 31 tháng 12 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

---

<b>NỘI DUNG</b>	<b>Trang</b>
BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC	02 - 03
BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP	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

## 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 31 tháng 12 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 (Bỏ 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 : Nguyễn Thị Phương Dung	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 kiểm toán Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính cho Công ty.

219  
CÓN  
NH  
H V  
HINH  
KI  
NAM  
TP.

69  
NG  
PH  
QU  
3 K  
DU  
HC

**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 31 tháng 12 năm 2017, báo cáo đã tuân thủ các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 Tháng 08 năm 2017 do Bộ Tài chính ban hành quy định chi tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chi tiêu an toàn tài chính tại ngày 31 tháng 12 năm 2017.

*Phê duyệt báo cáo an toàn 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 31 tháng 12 năm 2017.*

TP. HCM, ngày 31 tháng 01 năm 2018

Thay mặt Hội đồng quản trị  
Chủ tịch Hội đồng quản trị

Cao Ngọc Diệp

TP. HCM, ngày 31 tháng 01 năm 2018

Thay mặt Ban Tổng Giám đốc  
Tổng Giám đốc



Lê Quỳnh Chi

Số: 52a-9/BCKT/TC

## BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

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 kiểm toán 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 31 tháng 12 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 31 tháng 12 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 số 87/2017/TT-BTC ngày 15 Tháng 08 năm 2017 do Bộ Tài chính ban hành quy định chi tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chi 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 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 này 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. Khi thực hiện đánh giá các rủi ro này, kiểm toán viên đã xem xét kiểm soát nội bộ của Công ty liên quan đến việc lập và trình bày báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính trung thực, hợp lý nhằm thiết kế các thủ tục kiểm toán phù hợp với tình hình thực tế, tuy nhiên không nhằm mục đích đưa ra ý kiến về hiệu quả của kiểm soát nội bộ của Công ty. Công việc kiểm toán cũng bao gồm đánh giá tính thích hợp của các chính sách lập báo cáo được áp dụng cũng như đánh giá việc trình bày tổng thể báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

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 của chúng tôi, báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 31 tháng 12 năm 2017 của Công ty đã được lập và trình bày, trên các khía cạnh trọng yếu, phù hợp với các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 Tháng 08 năm 2017 do Bộ Tài chính ban hành quy định chi tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chi 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

Chứng nhận ĐKHN kiểm toán số:

2837-2014-152-1

TP. HCM, ngày 15 tháng 03 năm 2018

Kiểm toán viên



Nguyễn Xuân Giang

Chứng nhận ĐKHN kiểm toán số:

2784-2014-152-1

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 31 tháng 12 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 số 87/2017/TT-BTC ngày 15 Tháng 08 năm 2017 do Bộ Tài chính ban hành quy định chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng 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.



Người lập  
Bà Nguyễn Thị Phương Dung



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 31 Tháng 12 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 31 tháng 12 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)
<b>A</b>	<b>Nguồn vốn</b>	<b>26.603.363.888</b>	-	-
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 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)	-	-	-
6	Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ	-	-	-
7	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-	-	-
8	Lợi nhuận sau thuế chưa phân phối	(4.136.412.302)	-	-
9	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	1.739.776.190	-	-
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	-	-	-
14	Vốn khác (nếu có)	-	-	-
<b>1A</b>	<b>Tổng</b>			<b>26.603.363.888</b>
<b>B</b>	<b>Tài sản ngắn hạn</b>	-	<b>92.550.666</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 (Thuyết minh 4)	-	-	-
	Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
2	Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn (*)	-	-	-
<b>III</b>	<b>Các khoản phải thu ngắn hạn</b>	-	<b>82.000.000</b>	-
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	-	82.000.000	-
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	-	-	-
	Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	-	-
4	Phải thu nội bộ ngắn hạn	-	-	-



**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 31 tháng 12 năm 2017

**PHẦN 1: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG**

	<i>Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>	-	-	-
	<i>Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>	-	-	-
5	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>	-	-	-
6	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>	-	-	-
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>	-	<b>10.550.666</b>	-
1	Chi phí trả trước ngắn hạn	-	10.550.666	-
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	-	-	-
<b>1B</b>	<b>Tổng</b>			<b>92.550.666</b>
<b>C</b>	<b>Tài sản dài hạn</b>	-	<b>21.339.998</b>	-
<b>I</b>	<b>Các khoản phải thu dài hạn</b>	-	-	-
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 31 tháng 12 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	-	-	-
<b>II</b>	<b>Tài sản cố định</b>	-	-	-
<b>III</b>	<b>Bất động sản đầu tư</b>	-	-	-
<b>IV</b>	<b>Các khoản đầu tư tài chính dài hạn</b>	-	-	-
1	Đầu tư vào công ty con	-	-	-
2	Vốn góp liên doanh	-	-	-
3	Đầu tư vào công ty liên kết, liên doanh	-	-	-
4	Đầu tư chứng khoán dài hạn	-	-	-
	<i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9</i>	-	-	-
	<i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định tại khoản 5 Điều 6</i>	-	-	-
5	Các khoản đầu tư dài hạn ra nước ngoài	-	-	-
6	Đầu tư dài hạn khác	-	-	-
7	Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn	-	-	-
<b>V</b>	<b>Tài sản dài hạn khác</b>	-	<b>21.339.998</b>	-
1	Chi phí trả trước dài hạn	-	849.998	-
2	Tài sản thuê thu nhập hoãn lại	-	-	-
3	Ký cược, ký quỹ dài hạn	-	20.490.000	-
	<i>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</i>	-	-	-
<b>1C</b>	<b>Tổng</b>			<b>21.339.998</b>
<b>VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C</b>				<b>26.489.473.224</b>

**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 31 tháng 12 năm 2017

**PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**

**A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG**

VND

Các hạng mục đầu tư		Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
		(1)	(2)	(3) = (1) x (2)
<b>I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ</b>			16.448.917.332	-
1	Tiền mặt (VND)	0%	16.098.917.332	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	350.000.000	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi	0%		-
<b>II. Trái phiếu Chính phủ</b>			-	-
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%	-	-
<b>III. Trái phiếu Doanh nghiệp</b>				
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%	-	-
	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>			318.171.509	159.085.755
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%	-	-
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	-	-

**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 31 tháng 12 năm 2017

**PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**

**A. GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG**

VND

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	30%	-	-
12	Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	318.171.509	159.085.755
<b>V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán</b>			-	-
13	Quỹ đại chúng	10%		-
14	Quỹ thành viên	30%		-
<b>VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch</b>			-	-
15	Chứng khoán bị tạm ngừng, đình chỉ giao dịch (không bao gồm trường hợp cổ phiếu tạm ngừng giao dịch để chuyển sản giao dịch)	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	-	-
<b>VII. Chứng khoán khác</b>			<b>8.014.840.460</b>	<b>6.411.872.368</b>
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	8.014.840.460	6.411.872.368
<b>VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>			-	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
<b>(A) TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A = I + II+ III+IV+ V+VI+VII+VIII)</b>			<b>24.781.929.301</b>	<b>7.330.132.597</b>

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 31 tháng 12 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)	
<b>I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán</b>							
1	Tiền gửi có kỳ hạn, các khoản tiền cho vay không có tài sản đảm bảo						-
2							-
3	Cho vay chứng khoán/Các thỏa						-
4	Vay chứng khoán/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất						-
5	Hợp đồng mua chứng khoán có cam kết bán lại/Các thỏa thuận kinh						-
6	Hợp đồng bán chứng khoán có cam kết mua lại (Reverse Repo)/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất						-
	<b>Cộng</b>						-
<b>II. Rủi ro quá thời hạn thanh toán</b>							
	<b>Thời gian quá hạn</b>	<b>Hệ số rủi ro</b>	<b>Quy mô rủi ro</b>	<b>Giá trị rủi ro</b>			
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			
	<b>Cộng</b>			<b>1.881.338.690</b>			
<b>III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>							
<b>(B) TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B= I+II+III)</b>							<b>1.881.338.690</b>

0305  
TRÁCH  
DỊCH  
CÁI CE  
VÀ  
N  
VI-7

69-1  
ÔNG T  
Ồ PHẢ  
Ý QUỸ  
NG KH  
ÁI ĐƯ  
PHỒ

**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. HCMBáo cáo tỷ lệ an toàn tài chính  
tại ngày 31 tháng 12 năm 2017**PHẦN 2: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**

<b>C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG</b>	
<b>I. Tổng Chi phí hoạt động phát sinh trong 12 tháng</b>	<b>3.890.980.645</b>
<b>II. Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí</b>	<b>1.739.776.190</b>
1. Chi phí khấu hao	-
2. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	-
3. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
4. Chi phí/Hoàn nhập dự phòng phải thu khó đòi	1.739.776.190
<b>III. Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)</b>	<b>2.151.204.455</b>
<b>IV. 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)</b>	<b>537.801.114</b>
<b>V. 20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán</b>	<b>5.000.000.000</b>
<b>C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C = MAX (IV, V))</b>	<b>5.000.000.000</b>

3884  
CÔNG TY  
THAI DƯƠNG  
QUẢN LÝ QUỸ  
ĐẦU TƯ CHỨNG  
KHOÁN THÁI  
DƯƠNG  
T. C  
HỒ CT. C  
C  
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 31 tháng 12 năm 2017

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

Tại ngày 31 tháng 12 năm 2017

STT	Các chỉ tiêu	Thuyết minh	Giá trị rủi ro / vốn khả dụng
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường		7.330.132.597
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)		14.211.471.287
5	Vốn khả dụng		26.489.473.224
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)		186,40%

Người lập

Bà Nguyễn Thị Phương Dung

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 31 Tháng 12 Năm 2017