

**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 : 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 2018.

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 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 2018  
đã được soát xét**

## MỤC LỤC

<b>NỘI DUNG</b>	<b>TRANG</b>
BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC	02 - 03
BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ	04
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	05 - 12



## **BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC**

Ban 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 2018.

### **Khái quát**

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương là công ty cổ phần được thành lập và hoạt động theo Giấy phép số 46/UBCK-GP do Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước cấp ngày 20 tháng 01 năm 2009 và các Giấy phép điều chỉnh như sau: 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, giấy phép điều chỉnh số 31/GPĐC-UBCK ngày 08 tháng 12 năm 2015 và giấy phép điều chỉnh số 05/GPĐC-UBCK ngày 26 tháng 05 năm 2016.

Hoạt động chính của Công ty là: Lập và quản lý quỹ đầu tư chứng khoán, công ty đầu tư chứng khoán; Tư vấn đầu tư chứng khoán; Quản lý danh mục đầu tư chứng khoán.

Vốn điều lệ của Công ty là 29.000.000.000 đồng (tương đương 2.900.000 cổ phần, mệnh giá cổ phần là 10.000 đồng/cổ phần).

Trụ sở chính của Công ty đặt tại Phòng 28-10, Tầng 28, Tòa nhà Petroland, Số 12 Tân Trào, Phường Tân Phú, Quận 7, TP. HCM.

### **Các sự kiện sau ngày khóa sổ kế toán lập báo cáo tài chính**

Không có sự kiện trọng yếu nào xảy ra sau ngày lập Báo cáo tài chính đòi hỏi được điều chỉnh hay công bố trên Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

**Hội đồng Quản trị, Ban Giám đốc, Kế toán trưởng, Ban Kiểm soát và Bộ phận kiểm soát nội bộ trong kỳ kế toán từ 01/01/2018 đến 30/06/2018 và đến ngày lập báo cáo này như sau:**

#### **Hội đồng Quản trị**

Bà Cao Ngọc Diệp	Chủ tịch
Bà Nguyễn Thị Mai Hoa	Phó Chủ tịch
Ông Cao Thanh Định	Phó Chủ tịch
Bà Lê Quỳnh Chi	Thành viên

#### **Ban Giám đốc và Kế toán trưởng**

Bà Lê Quỳnh Chi	Tổng Giám đốc
Bà Nguyễn Thị Phương Dung	Kế toán trưởng

#### **Bộ phận kiểm soát nội bộ**

Bà Nguyễn Thị Thủy	Trưởng bộ phận	Từ ngày 10/04/2018
Bà Trương Nguyên Khanh	Trưởng bộ phận	Đến ngày 10/04/2018
Bà Cao Thị Huyền Thương	Thành viên	

#### **Người đại diện theo pháp luật**

Người đại diện theo pháp luật của Công ty trong kỳ và tại ngày lập báo cáo này là Bà Cao Ngọc Diệp.

#### **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 tại ngày 30/06/2018 cho Công ty.

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

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm về việc lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính phản ánh trung thực, hợp lý tỷ lệ an toàn vốn khả dụng 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 yêu cầu sau:

138  
ÔNG  
HIỆM  
VỤ T  
ÍNH  
TẾM  
LM V  
P. F  
9-  
NG  
PH  
QU  
IG K  
I DI  
CH



## **BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC (tiếp theo)**

- Thực hiện các phán đoán và ước tính một cách thận trọng khi tính các chỉ tiêu của Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính;
- Lập báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính dựa trên cơ sở hoạt động liên tục, trừ trường hợp không thể giả định rằng Công ty sẽ tiếp tục hoạt động liên tục.

Ban Giám đốc Công ty đã phê chuẩn báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30/06/2018 đính kèm từ trang 05 đến trang 12 và đảm bảo rằng Công ty đã tuân thủ các yêu cầu nêu trên khi lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính và Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính được lập tuân thủ Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài chính về việc 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.

**Thay mặt Ban Giám đốc**



**Lê Quỳnh Chi**  
Tổng Giám đốc

*Tp. HCM, ngày 03 tháng 08 năm 2018*

C. 2  
BAN  
VĂN  
TOÁN  
ÁN  
CHỈ

C. 1  
ĐẦU TƯ  
ĐÁNH  
ĐIỂM

Số: 198/BCSX/TC

## **BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ**

**Kính gửi: Quý cổ đông, Hội đồng Quản trị và Ban 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 tại ngày 30/06/2018 của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương, được lập ngày 03 tháng 08 năm 2018, từ trang 05 đến trang 12. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo được lập theo quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài chính về việc 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.

### **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 theo chuẩn mực kế toán, chế độ kế toán doanh nghiệp Việt Nam và các quy định pháp lý có liên quan đến việc lập và trình bày báo cáo tỷ lệ 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 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 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 báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo không phản ánh trung thực và hợp lý, trên các khía cạnh trọng yếu, tình hình an toàn tài chính của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương tại thời điểm 30 tháng 06 năm 2018 phù hợp với quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài chính về việc 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 (AASCN)**

**Phó Giám đốc**



**Gao Thị Hồng Nga**

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0613-2018-152-1

*Tp. HCM, ngày 03 tháng 08 năm 2018*

Tp.HCM, ngày 03 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 15/8/2017 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;

(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 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



Nguyễn Thị Phương Dung

Trưởng bộ phận  
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thị Thuý

Tổng Giám đốc



Lê Quỳnh Chi



## I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
A	<b>Nguồn vốn</b>	(1)	(2)	(3)
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	(4.372.434.363)		
9	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	1.881.338.690		
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>26.508.904.327</b>	<b>-</b>	<b>-</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>			
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.		100.450.000	
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 - 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 - Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày			-
6	Các khoản phải thu khác - Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày			-
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		1.715.032	
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 - Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại trên 90 ngày			-
4.2	Tài sản ngắn hạn khác			-
<b>1B</b>	<b>Tổng</b>		<b>102.165.032</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 - 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.			-
3	Phải thu dài hạn nội bộ - 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			-
4	Phải thu dài hạn khác - 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>			-

213  
 CÔNG  
 (NHIE  
 H VỤ  
 HINH  
 KIEM  
 AM'  
 TP. H

0:6  
 CÔI  
 CỒ  
 N LÝ  
 HỨNG  
 HÁI  
 7.F

**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>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			
	- 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 tại khoản 5 Điều 6		-	
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>		-	
1	Chi phí trả trước dài hạn		-	
2	Tài sản thuế thu nhập hoãn lại		-	
3	Ký cược, ký quỹ dài hạn		20.490.000	
	<i>Các chỉ tiêu tài sản</i> 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		-	
<b>1C</b>	<b>Tổng</b>		<b>20.490.000</b>	
<b>VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C</b>				<b>26.386.249.295</b>

4-C.T.  
 TÀI SẢN  
 VỐN  
 TOÁN  
 ĐÁN  
 T  
 CHỈ

C.T.  
 TY  
 ẢN  
 Ỹ ĐẦU  
 HOÁN  
 ỜNG  
 5 CHỈ

## II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

A. 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)
<b>I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ</b>				
1	Tiền (VND)	0%	10.407.141.548	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	6.072.500.000	-
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: 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 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>				
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%		-
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, nhưng chưa niêm yết hoặc đăng ký giao dịch; cổ phiếu đang trong đợt phát hành lần	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, 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>				
15	Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch	40%		-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết hủy giao dịch	50%		-
<b>VII. Chứng khoán khác.</b>				
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	8.014.840.460	6.411.872.368
18	Các tài sản đầu tư khác	80%		
<b>VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có) (được xác định trên cơ sở vốn chủ sở hữu đã trích lập đầy đủ các khoản dự phòng)</b>				
	<b>Mã chứng khoán.</b>	<b>Mức tăng thêm</b>	<b>Quy mô rủi ro</b>	<b>Giá trị rủi ro</b>
1	Công ty CP DV Sản Xuất Thương Mại	3.795.872.368	20%	759.174.474
2	.....			-
<b>A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A = I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)</b>				<b>7.330.132.597</b>



**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>B. RỦI RO THANH TOÁN</b>							
Loại hình giao dịch	Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
	(1) 0%	(2) 0,8%	(3) 3,2%	(4) 4,8%	(5) 6%	(6) 8%	
<b>I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán.</b>	-	-	-	-	364.350.000	-	<b>364.350.000</b>
1	Tiền gửi có kỳ hạn, các khoản tiền cho vay không tài sản bảo đảm và các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán				364.350.000		<b>364.350.000</b>
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					-	-
<b>II. Rủi ro quá thời hạn thanh toán</b>							<b>1.881.338.690</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	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 sau 60 ngày trở lên sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	100%		1.881.338.690		1.881.338.690	
<b>III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>							<b>60.870.000</b>
	<b>Chi tiết tới từng khoản vay, tới từng đối tác</b>	<b>Mức tăng thêm</b>		<b>Quy mô rủi ro</b>		<b>Giá trị rủi ro</b>	
1	Hợp đồng tiền gửi có kỳ hạn tại ngân hàng	20%		304.350.000		60.870.000	
<b>B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)</b>							<b>2.306.558.690</b>

52138  
CÔNG  
H NHIỆM  
H VỤ T  
HÌNH I  
KIỂM  
NAM V  
TP. H

69  
CÔNG  
CỔ PH  
LÝ QU  
ỨNG I  
HẢI D  
TP. H



<b>C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)</b>		
<b>I.</b>	<b>Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới tháng 06 năm 2018</b>	<b>4.390.199.891</b>
<b>II.</b>	<b>Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí</b>	<b>658.776.607</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	658.776.607
<b>III.</b>	<b>Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)</b>	<b>3.731.423.284</b>
<b>IV.</b>	<b>25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)</b>	<b>932.855.821</b>
<b>V.</b>	<b>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>
<b>D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)</b>		<b>14.636.691.287</b>

**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	7.330.132.597	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	2.306.558.690	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4 = 1+2+3)	14.636.691.287	
5	Vốn khả dụng	26.386.249.295	
6	Tỷ lệ vốn khả dụng (6=5/4)	180,27%	

Kế toán trưởng



Nguyễn Thị Phương Dung

Trưởng bộ phận Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thị Thuỷ

Tp.HCM, ngày 03 tháng 08 năm 2018

Tổng Giám đốc



Lê Quỳnh Chi

