

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

---o0o---

Số: 18./2022/TDC-CBTT
V/v CBTT BC TLATTC kiểm toán năm 2021

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

---o0o---

TP.HCM, ngày 14 tháng 3 năm 2022

**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 : CÔNG TY CỔ PHẦN 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, TP.HCM

Điện thoại : +84.2854160779 Fax: +84.285416780

Email : info@thaiduongcapital.com.vn

Người thực hiện công bố thông tin: Lê Quỳnh Chi

Địa chỉ : 98, đường 47, Phường Tân Quy, Quận 7, TP.HCM

Điện thoại : +84.2854160779 Fax: +84.285416780

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:

Công bố thông tin Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kiểm toán năm 2021 của Công ty Cổ phần Quản lý quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương.

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

Người thực hiện công bố thông tin



Lê Quỳnh Chi

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương

Địa chỉ: Phòng 28-10, Tầng 28, Tòa nhà Petroland, 12 Tân Trào, Phường Tân Phú, Quận 7, TP.HCM

Điện thoại: +84-28.5416 0779/+84.947002050 Fax: +84.28.5416 0780 Email: info@thaiduongcapital.com.vn

**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 2021
đã được kiểm toán**



MỤC LỤC

NỘI DUNG	TRANG
BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC	02 - 03
BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP	04
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	05 - 13



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 31 tháng 12 năm 2021.

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, giấy phép điều chỉnh số 05/GPĐC-UBCK ngày 26 tháng 05 năm 2016, giấy phép điều chỉnh số 15/GPĐC-UBCK ngày 31 tháng 03 năm 2020 và giấy phép điều chỉnh số 52/GPĐC-UBCK ngày 17 tháng 08 năm 2020.

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 (trung 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, P.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 tài chính.

Hội đồng Quản trị, Ban Giám đốc, Kế toán trưởng, Bộ phận kiểm soát nội bộ trong năm và đến ngày lập báo cáo này như sau:

Hội đồng Quản trị

Ông Cao Thanh Định	Chủ tịch	
Bà Lê Quỳnh Chi	Phó Chủ tịch thường trực	
Bà Nguyễn Thị Mai Hoa	Phó Chủ tịch	
Bà Nguyễn Thị Thuý	Thành viên	Từ ngày 26/01/2021

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 Thu Hà	Trưởng bộ phận
----------------------	----------------

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 Lê Quỳnh Chi.

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 các Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính cho Công ty.

1388
ÔNG T
VIỆM H
VỤ T
NH K
JEM T
M VI
P. H
39-
NG
PH
QU
G M
. I D
. P H

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC (tiếp theo)

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:

- 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 31/12/2021 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 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 của Bộ Tài chính về việc 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.



Lê Quỳnh Chi
Tổng Giám đốc

Tp. HCM, ngày 08 tháng 03 năm 2022

Số: **73** /BCKT/TC

BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

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 kiểm toán báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 31/12/2021 của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương, được lập ngày 08 tháng 03 năm 2022, từ trang 05 đến trang 13. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo được lập theo quy định tại Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 của Bộ Tài chính về việc 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.

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 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 đã phản ánh trung thực và hợp lý, trên các khía cạnh trọng yếu tình hình tài chính của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán Thái Dương tại ngày 31/12/2021, phù hợp với quy định của Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 của Bộ Tài chính về việc 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.

Công ty TNHH Dịch vụ Tư vấn Tài chính
Kế toán và Kiểm toán Nam Việt (AASCN)

Phó Giám đốc



Nguyễn Thị Cúc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0700-2018-152-1

Tp. HCM, ngày 4 tháng 03 năm 2022

Kiểm toán viên



Nguyễn Hồng Nga

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 1266-2018-152-1

Tp.HCM, ngày 08 tháng 03 năm 2022

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 31/12/2021

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 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 của Bộ Tài chính về việc 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 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 Thu Hà



Tổng Giám đốc

Lê Quỳnh Chi

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

Tại ngày 31 tháng 12 năm 2021

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
A	Nguồn vốn	(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	(2.569.344.405)		
9	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	44.000.000		
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)	-		
1A	Tổng	26.474.655.595	-	-
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			
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.		64.000.000	
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		-	

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

IV	Các khoản đầu tư tài chính dài hạn			
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.			
V	Tài sản dài hạn khác.		-	
1	Chi phí trả trước dài hạn		2.991.555	
2	Tài sản thuê thu nhập hoãn lại		-	
3	Ký cược, ký quỹ dài hạn		5.490.000	
	<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		-	
1C	Tổng		8.481.555	
VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C				26.399.628.586



II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Tại ngày 31 tháng 12 năm 2021

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)
I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ				
1	Tiền (VND)	0%	16.760.364.637	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	-	-
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 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%		-
III. Trái phiếu tổ chức tín dụng				
6	Trái phiếu tổ chức tín dụng có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	3%		
	Trái phiếu tổ chức tín dụng có thời gian đáo hạn còn từ 1 năm đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	8%		
	Trái phiếu tổ chức tín dụng có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	10%		
	Trái phiếu tổ chức tín dụng có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	15%		
IV. Trái phiếu doanh nghiệp				
Trái phiếu doanh nghiệp niêm yết				
7	Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển	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%		-

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

	Trái phiếu doanh nghiệp không niêm yết			
	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp niêm yết phát hành có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	15%		
	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp niêm yết phát hành có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 năm đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	20%		
	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp niêm yết phát hành có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	25%		-
8	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp niêm yết phát hành có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	30%		-
	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp khác phát hành có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	25%		
	Trái phiếu không niêm yết do doanh nghiệp khác phát hành 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 do doanh nghiệp khác phát hành 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 do doanh nghiệp khác phát hành có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%		-
V. Cổ phiếu				
9	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%		-
10	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%		-
11	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%		-
12	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%		-
13	Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	2.868.171.509	1.434.085.755

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

VI. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán.				
14	Quỹ đại chúng, bao gồm cả công ty đầu tư chứng khoán đại chúng	10%		-
15	Quỹ thành viên, công ty đầu tư chứng khoán riêng lẻ	30%		-
VII. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch.				
16	Chứng khoán công ty đại chúng chưa niêm yết bị nhắc nhở do chậm công bố thông tin báo cáo tài chính kiểm toán/soát xét theo quy định	30%		-
17	Chứng khoán niêm yết bị cảnh báo	20%		-
18	Chứng khoán niêm yết bị kiểm soát	25%		
19	Chứng khoán bị tạm ngừng, hạn chế giao dịch	40%		
20	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	80%		
21	Cổ phiếu, trái phiếu của công ty chưa đại chúng phát hành không có báo cáo tài chính kiểm toán gần nhất đến thời điểm lập báo cáo hoặc có báo cáo tài chính kiểm toán nhưng có ý kiến kiểm toán là trái ngược, từ chối đưa ra ý kiến hoặc ý kiến không chấp thuận toàn phần.	100%		
VIII. Chứng tài sản khác.				
22	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	7.008.564.213	5.606.851.370
23	Các tài sản đầu tư khác	80%		
IX. 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)				
	Mã chứng khoán.	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	UEH	10%	2.160.000.000	216.000.000
2			-
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A = I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII+IX)				7.256.937.125



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. RỦI RO THANH TOÁN							
Loại hình giao dịch	Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
	0%	0,8%	3,2%	4,8%	6%	8%	
I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán.							
	-	-	-	-	2.997.831	-	2.997.831
1	Tiền gửi có 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				2.997.831	-	2.997.831
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 sau 60 ngày trở lên sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	100%			-	-	

984-C.T.
 TY
 HỮU HẠN
 TƯ VẤN
 KẾ TOÁN
 TOÁN
 TẾT
 TỔ CHỨC

C. T.
 TY
 IẢN
 Y Đ
 KHO
 ƯC

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

Các hợp đồng, giao dịch, các khoản sử dụng vốn ngoài các giao dịch, hợp đồng được ghi nhận ở các điểm a, b, c, d, đ, e, g khoản 1 Điều 10 Thông tư này; Các khoản phải thu từ mua bán nợ với đối tác giao dịch không phải Công ty Quản lý tài sản của các tổ chức tín dụng Việt Nam (VAMC), Công ty trách nhiệm hữu hạn mua bán nợ Việt Nam (DATC) (Chi tiết từng đối tượng). Khoản tạm ứng chiếm trên 5% vốn chủ sở hữu có thời gian hoàn ứng còn lại dưới 90 ngày (Chi tiết từng đối tượng).			
III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)			
Chi tiết tới từng khoản tiền gửi, cho vay tới từng đối tác	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
		-	-
B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)			2.997.831

C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)	
I.	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới tháng 12 năm 2021 3.171.477.275
II.	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí 44.000.000
	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 44.000.000
III.	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II) 3.127.477.275
IV.	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III) 781.869.319
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) 12.259.934.956	

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	7.256.937.125	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	2.997.831	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4 = 1+2+3)	12.259.934.956	
5	Vốn khả dụng	26.399.628.586	
6	Tỷ lệ vốn khả dụng (6=5/4)	215,33%	

Kế toán trưởng



Nguyễn Thị Phương Dung

Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thị Thu Hà

TP. HCM, ngày 08 tháng 03 năm 2022

Tổng Giám đốc





Lê Quỳnh Chi