

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ

NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẠI CHỨNG VIỆT NAM

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2022

(đã được soát xét)



NỘI DUNG

	Trang
Báo cáo của Ban Giám đốc	02-03
Báo cáo soát xét thông tin tài chính giữa niên độ	04-05
Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét	06-15

311
CỔ
PHẦN
HÀNG
1

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

Ban Giám đốc Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chứng Việt Nam (sau đây gọi tắt là "Công ty") trình bày Báo cáo của mình và Báo cáo tự lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 30/06/2022.

CÔNG TY

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chứng Việt Nam (PVCB Capital) là doanh nghiệp có phần được thành lập và hoạt động theo Giấy phép thành lập và hoạt động số 23/UBCK-GP ngày 14/12/2007 và các Giấy phép Điều chỉnh số 31/UBCK-GPDC ngày 19/01/2009, số 75/UBCK-GPDC ngày 27/07/2010, số 19/GPDC-UBCK ngày 21/10/2011, số 07/GPDC-UBCK ngày 28/03/2014, số 08/GPDC-UBCK ngày 31/05/2016, số 78/GPDC-UBCK ngày 27/09/2018, số 48/GPDC-UBCK ngày 10/08/2020 do Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp. Giấy chứng nhận đăng ký Doanh nghiệp Công ty có phần do Sở kế hoạch đầu tư Thành phố Hà Nội cấp, thay đổi lần thứ 2 ngày 30/06/2022, đổi tên từ Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư Tài chính Dầu khí thành Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chứng Việt Nam.

Trụ sở của Công ty tại: Tầng 9, Tòa nhà Hapro, 11B Cát Linh, Đống Đa, Hà Nội.

HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ, BAN GIÁM ĐỐC, BAN KIỂM SOÁT VÀ KIỂM TOÁN NỘI BỘ

Các thành viên của Hội đồng Quản trị trong kỳ và tại ngày lập báo cáo này bao gồm:

Ông Nguyễn Việt Hà

Ông Trần Quang Vinh

Bà Hồ Việt Hà

Các thành viên của Ban Giám đốc đã điều hành Công ty trong kỳ và tại ngày lập báo cáo này bao gồm:

Ông Trần Quang Vinh

Ông Vũ Đức Trung

Các thành viên của Ban Kiểm soát bao gồm:

Bà Nguyễn Thị Kim Tân

Bà Nguyễn Lan Hương

Bà Đỗ Thị Minh Nguyệt

Ông Vũ Đức Trung

Các thành viên của Ban Kiểm toán nội bộ bao gồm:

Bà Nguyễn Thị Thu Thủy

Trưởng ban

KIỂM TOÁN VIÊN

Công ty TNHH Hàng Kiểm toán AASC đã thực hiện soát xét Báo cáo tự lệ an toàn tài chính 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 đảm bảo rằng hệ thống thông tin và hệ thống kiểm soát nội bộ được xây dựng và duy trì để đảm bảo tỷ lệ an toàn tài chính được phản ánh trung thực, hợp lý tại bất cứ thời điểm nào theo những yêu cầu của Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 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.

Ban Giám đốc Công ty cam kết đã tuân thủ những yêu cầu của Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 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 trong việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2022.

Cam kết khác

Ban Giám đốc cam kết rằng Công ty tuân thủ Nghị định 155/2020/NĐ-CP của Chính Phủ ngày 31/12/2020 hướng dẫn về quy định chi tiết thi hành một số điều của luật chứng khoán và Công ty không vi phạm nghĩa vụ công bố thông tin theo quy định tại Thông tư số 96/2020/TT-BTC ngày 16/11/2020 của Bộ Tài chính hướng dẫn công bố thông tin trên thị trường chứng khoán.

Thay mặt Ban Giám đốc



Trần Quang Vinh
Giám đốc

Hà Nội, ngày 01 tháng 08 năm 2022

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 Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam

Chúng tôi đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30/06/2022 kèm theo của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam được lập ngày 01 tháng 08 năm 2022 được trình bày từ trang 06 đến trang 15, đã được Ban Giám đốc của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam lập theo các quy định về lập và trình bày báo cáo tại Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 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.

Trách nhiệm của Ban Giám đốc

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm về việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty theo các quy định pháp lý về lập và trình bày báo cáo tại Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 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 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 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 ngày 30 tháng 06 năm 2022 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 không phản ánh trung thực và hợp lý tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam tại ngày 30/06/2022, phù hợp với các quy định tại Thông tư số 91/2020/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2020 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.

Chính sách kế toán

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này được lập để giúp Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam đáp ứng các yêu cầu của cơ quan quản lý Nhà nước. Vì thế, Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này có thể không phù hợp để sử dụng cho mục đích khác.

Vấn đề khác

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam đã lập một bộ Báo cáo tài chính giữa niên độ cho kỳ kế toán từ ngày 01/01/2022 đến ngày 30/06/2022 theo Chuẩn mực kế toán, Chế độ kế toán Việt Nam áp dụng đối với công ty quản lý quỹ và các quy định pháp lý có liên quan đến việc lập và trình bày báo cáo tài chính giữa niên độ và chúng tôi đã phát hành Báo cáo soát xét thông tin tài chính giữa niên độ về Báo cáo tài chính đó cho Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đại chúng Việt Nam vào ngày 10/08/2022.

Công ty TNHH Hãng Kiểm toán AASC



Vũ Xuân Biển

Phó Tổng Giám đốc

Số: 0743-2018-002-1

Giấy chứng nhận đăng ký hành nghề kiểm toán

Hà Nội, ngày 10 tháng 08 năm 2022

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2022

I. BẢNG TÌNH VỐN KHẢ DỤNG		VỐN KHẢ DỤNG	
STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ
		(1)	(2)
		(3)	
A	NGUỒN VỐN CHỦ SỞ HỮU	100.000.000.000	
1	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)		
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)	1.119.048.486	
6	Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ	2.747.698.486	
7	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	2.232.661.788	
8	Lợi nhuận sau thuế chưa phân phối	8.375.652.637	
9	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	20.531.006.515	
10	Chênh lệch danh giá lại tài sản có 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 tài chính đầu tư tài chính	8.839.389.201	6.615.475.780
14	Vốn khác (nếu có)		
1A	Tổng	132.782.154.491	
B	Tài sản ngân hàng		
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		
	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	477.369.880	
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	7.271.058.396	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2022

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
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		621.624.315	
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		45.990.413	
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		12.020.970.150	
4.2	Tài sản ngắn hạn khác			
1B	Tổng			20.437.013.154
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			
	- 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			

STT		NỘI DUNG		VỐN KHẢ DỤNG	
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	394.422.800		
5		Dự phòng phải thu dài hạn khó đòi			
II		Tài sản cố định			
III		Bất động sản đầu tư			
IV		Các khoản đầu tư tài chính dài hạn			
1		Đầu tư vào công ty con			
2		Đầu tư chứng khoán dài hạn			
		- Chứng khoán niêm yết và có thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9			
		- Chứng khoán bị giám trị khỏi vốn khả dụng theo quy định tại khoản 5 Điều 6			
3		Các khoản đầu tư dài hạn ra nước ngoài			
4		Đầu tư dài hạn khác			
5		Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn			
V		Tài sản dài hạn khác			
1		Chi phí trả trước dài hạn			
2		Tài sản thuê thu nhập hoãn lại			
3		Ký cược, ký quỹ dài hạn			
		Các chi tiêu tài sản bị coi là khoản ngoài trừ, có y 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			
IC		Tổng			
			1.914.984.081		110.430.157.256
		VỐN KHẢ DỤNG		VỐN KHẢ DỤNG = IA-IB-IC	

1 BẢNG TÌNH VỐN KHẢ DỤNG

BÁO CÁO TỰ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2022

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QV
 NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẠI CHỨNG VIỆT NAM
 Tầng 9, Tòa nhà Hapro, 11B Cát Linh, Đống Đa, Hà Nội
 Báo cáo tự lệ an toàn tài chính
 Tại ngày 30/06/2022

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2022

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A RỦI RO THỊ TRƯỜNG		Hệ số rủi ro (%)	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
		(1)	(2)	(3) = (1) x (2)
Các hạng mục đầu tư				
I	Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ			-
1	Tiền mặt (VND)	0%	4.670.290.526	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	8.010.397.260	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi	0%	15.788.747.603	-
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, Trái phiếu chính quyền địa phương	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	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%	-	-
III	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 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%	-	-

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2022

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A	RỦI RO THỊ TRƯỜNG	Hệ số rủi ro (%)	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro	
		(1)	(2)	(3) = (1) x (2)	
Các hạng mục đầu tư					
VI	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%	-	-	
				15.999.885.106	
VII	Các tài sản khác				
21	Cổ phiếu, trái phiếu của công ty 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%	-	-	
22	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	19.999.856.382	15.999.885.106	
23	Các tài sản đầu tư khác	80%	-	-	
VII	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)			2.449.154.738	
I	Mã chứng khoán	Hệ số rủi ro	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	Quỹ đầu tư Giá trị Nemo-PVcom (NPMF)	30%	20%	19.922.957.749	1.195.377.465
2	Quỹ đầu tư Trái phiếu PVCom (PVBF)	10%	30%	41.792.575.780	1.253.777.273
A	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)				28.629.423.287

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
Tại ngày 30/06/2022

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

B	Loại hình giao dịch	Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
	Hệ số rủi ro	0,0%	0,8%	3,2%	4,8%	6,0%	8,0%	1.923.549.205
I	Rủi ro trước thời hạn thanh toán					1.629.591.825	293.957.380	1.923.549.205
1	Tiền gửi có kỳ hạn, chứng chỉ tiền gửi, các khoản tiền cho vay không có tài sản bảo đảm, các khoản phải thu từ hoạt động kinh doanh chứng khoán và các khoản mục tiềm ẩn rủi ro thanh toán khác	-	-	-	-	-	-	-
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 kỳ 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							11.768.659.565
	Thời gian quá hạn							
1	Từ 0-15 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán					16%		
2	Từ 16 – 30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán					32%		
3	Từ 31 – 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán					48%		
4	Trên 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán					100%	11.768.659.565	11.768.659.565

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
 Tại ngày 30/06/2022

III	Rủi ro từ các khoản tạm ứng, hợp đồng, giao dịch khác	Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	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, 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) (Chỉ tiết từng đối tượng). Khoản tạm ứng chiếm trên 5% vốn chủ sở hữu có thời gian hoàn ứng còn lại dưới 90 ngày (Chỉ tiết từng đối tượng).	100%	-	-
IV	Rủi ro tăng thêm (nếu có)			220.937.652
TT	Chi tiết từng khoản vay, tới từng đối tác	Hệ số rủi ro (%)	Mức tăng thêm	Giá trị rủi ro
1	Ngân hàng TMCP Đại chúng Việt Nam	6%	20%	220.937.652
B	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)			13.913.146.422





BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
 Tại ngày 30/06/2022


II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO		Giá trị rủi ro
C	RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)	46.488.365.255
I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới ngày 30/06/2022	7.381.039.674
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	265.211.922
	1. Chi phí khấu hao	7.115.827.752
	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	39.107.325.581
III	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)	9.776.831.395
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	5.000.000.000
V	20% vốn điều lệ tối thiểu cho các nghiệp vụ kinh doanh của tổ chức kinh doanh chứng khoán (25% vốn điều lệ tối thiểu cho các nghiệp vụ kinh doanh của tổ chức kinh doanh chứng khoán có nghiệp vụ chứng khoán phái sinh)	9.776.831.395
C	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max {IV, V})	52.319.401.104
D	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)	

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	28.629.423.287	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	13.913.146.422	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	9.776.831.395	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	52.319.401.104	
5	Vốn khả dụng	110.430.157.256	
6	Tỷ lệ Vốn khả dụng (6=5/4)	211,07%	


 Đỗ Thị Kim Cúc
 PP. Phụ trách phòng TCKT


 Hoàng Thị Út Quyên
 Trưởng bộ phận Kiểm soát nội bộ


 Trần Quang Vinh
 Giám đốc

Hà Nội, ngày 01 tháng 08 năm 2022

