

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
TẠI NGÀY 30 THÁNG 6 NĂM 2012

CÔNG TY CỔ PHẦN
CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

MỤC LỤC

	Trang
1. Mục lục	1
2. Báo cáo của Hội đồng quản trị	2 - 4
3. Báo cáo kết quả công tác soát xét	5
4. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2012	6 - 14



BÁO CÁO CỦA HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ

Hội đồng quản trị Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam trình bày báo cáo của mình cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2012 đã được soát xét.

Khái quát về Công ty

Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam được thành lập theo Nghị quyết của cổ đông sáng lập ngày 03 tháng 04 năm 2007 về việc cùng nhau góp vốn thành lập Công ty Cổ phần Chứng khoán Đông Dương (nay là Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam).

Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam được cấp giấy phép thành lập và hoạt động theo Quyết định số 62/UBCK-GP ngày 30 tháng 10 năm 2007 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước. Trong quá trình hoạt động Công ty được điều chỉnh theo Quyết định số 67/UBCK-GP ngày 26 tháng 12 năm 2011 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước do thay đổi vốn điều lệ của Công ty.

Vốn điều lệ theo Giấy phép hoạt động kinh doanh chứng khoán như sau:

	<u>Số lượng cổ phần</u>	<u>Thành tiền</u>
Tổng Công ty Cổ phần Tái Bảo hiểm Quốc gia Việt Nam	269.500	2.695.000.000
Ông Lê Minh Tuấn	785.799	7.857.990.000
Ông Trịnh Quốc Vân	931.710	9.317.100.000
Ông Trần Quang Luyến	434.000	4.340.000.000
Ông Trần Đức Chiến	1.088.560	10.885.600.000
Bà Trần Thị Hồng Hà	599.640	5.996.400.000
Bà Lê Phương Huyền	40.000	400.000.000
Các cổ đông khác	3.350.791	33.507.910.000
Cộng	<u>7.500.000</u>	<u>75.000.000.000</u>

Trụ sở hoạt động

Địa chỉ : Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phường Phạm Đình Hồ - Quận Hai Bà Trưng - TP Hà Nội
Điện thoại : (84.4) 39 726 178
Fax : (84.4) 39 726 179
Mã số thuế : 0 1 0 2 4 5 9 1 0 6

Hoạt động kinh doanh của Công ty là:

Công ty thực hiện các hoạt động kinh doanh trong lĩnh vực chứng khoán, gồm: môi giới chứng khoán, tư vấn đầu tư chứng khoán và lưu ký chứng khoán.

Sự kiện phát sinh sau ngày 30 tháng 6 năm 2012

Hội đồng quản trị Công ty khẳng định không có sự kiện nào phát sinh sau ngày 30 tháng 6 năm 2012 cho đến thời điểm lập báo cáo này mà chưa được xem xét điều chỉnh số liệu hoặc công bố trong Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

Hội đồng quản trị và Ban điều hành, quản lý

Hội đồng quản trị và Ban điều hành, quản lý của Công ty trong năm và cho đến thời điểm lập báo cáo này bao gồm:

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM
BÁO CÁO CỦA HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ (tiếp theo)

Hội đồng quản trị

Họ và tên	Chức vụ	Ngày bổ nhiệm
Ông Trịnh Quốc Vân	Chủ tịch	30 tháng 3 năm 2012
Ông Lê Minh Tuấn	Ủy viên	15 tháng 11 năm 2011
Ông Đỗ Anh Đức	Ủy viên	29 tháng 05 năm 2010
Ông Nguyễn Trung Duy	Ủy viên	29 tháng 05 năm 2010
Ông Trần Đức Chiến	Ủy viên	29 tháng 05 năm 2010
Ông Phùng Danh Thắm	Ủy viên	14 tháng 05 năm 2011

Ban kiểm soát

Họ và tên	Chức vụ	Ngày bổ nhiệm
Bà Lê Thị Thùy	Trưởng ban	26 tháng 05 năm 2012
Ông Nguyễn Tuấn Hoàng	Ủy viên	29 tháng 05 năm 2010
Ông Chu Quốc Vinh	Ủy viên	29 tháng 05 năm 2010

Ban điều hành, quản lý

Họ và tên	Chức vụ	Ngày bổ nhiệm	Ngày miễn nhiệm
Ông Trần Dũng Tiến	Quyền Tổng Giám đốc	27 tháng 3 năm 2012	
Ông Lê Minh Tuấn	Tổng Giám đốc	15 tháng 11 năm 2011	27 tháng 3 năm 2012

Kiểm toán viên

Công ty TNHH Kiểm toán và Tư vấn (A&C) đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2012 của Công ty.

Xác nhận của Hội đồng quản trị

Hội đồng quản trị Công ty chịu trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính phản ánh trung thực và hợp lý tỷ lệ an toàn vốn khả dụng của Công ty. Trong việc lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này, Hội đồng quản trị phải:

- Thực hiện các phán đoán và các 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 trên cơ sở hoạt động liên tục trừ trường hợp không thể giả định rằng Công ty sẽ tiếp tục hoạt động liên tục.

Hội đồng quản trị 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 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 của Bộ Tài chính về việc 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 chỉ tiêu an toàn tài chính.

Hội đồng quản trị Công ty cũng chịu trách nhiệm bảo vệ an toàn tài sản của Công ty và do đó đã thực hiện các biện pháp thích hợp để ngăn chặn và phát hiện các hành vi gian lận và các vi phạm khác.

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM
BÁO CÁO CỦA HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ (tiếp theo)

Phê duyệt Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Hội đồng quản trị phê duyệt Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đính kèm. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý tỷ lệ an toàn vốn khả dụng của Công ty tại thời điểm ngày 30 tháng 6 năm 2012, phù hợp với Thông tư số 226/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 của Bộ Tài chính về việc 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 chỉ tiêu an toàn tài chính.

Thay mặt Hội đồng quản trị,



Trịnh Quốc Vân

Ngày 28 tháng 8 năm 2012



**BAKER TILLY
A&C**

**CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN VÀ TƯ VẤN
AUDITING AND CONSULTING CO., LTD.**



Headquarters : 229 Dong Khoi St., Dist.1, Ho Chi
Tel: (84.8) 38 272 295 - Fax: (84.8)
Branch in Ha Noi : 40 Giang Vo St., Dong Da Dist., H
Branch in Nha Trang: 18 Tran Khanh Du St., Nha T
Branch in Can Tho : 162C/4 Tran Ngoc Que St., Can
www.a-c.com.vn

Số: 324/2012/BCTC-KTTV-KT1

**BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT
VỀ BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH TẠI NGÀY 30 THÁNG 6 NĂM 2012
CỦA CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM**

**Kính gửi: CÁC CỔ ĐÔNG, HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ VÀ BAN TỔNG GIÁM ĐỐC
CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM**

Chúng tôi đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2012 của Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam 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 thời điểm ngày 30 tháng 6 năm 2012, được lập ngày 28 tháng 8 năm 2012, từ trang 06 đến trang 14 kèm theo.

Việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này thuộc trách nhiệm của Ban Tổng Giám đốc Công ty. Trách nhiệm của chúng tôi là đưa ra Báo cáo nhận xét về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này trên cơ sở công tác soát xét của chúng tôi.

Chúng tôi đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính theo Chuẩn mực Kiểm toán Việt Nam về công tác soát xét. Chuẩn mực này yêu cầu công tác soát xét phải lập kế hoạch và thực hiện để có sự đảm bảo vừa phải rằng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính không còn chứa đựng những sai sót trọng yếu. Công tác soát xét bao gồm chủ yếu là việc trao đổi với nhân sự của Công ty, áp dụng các thủ tục phân tích trên những thông tin tài chính và tính toán lại các số liệu; công tác này cung cấp một mức độ đảm bảo thấp hơn công tác kiểm toán. Chúng tôi không thực hiện công việc kiểm toán nên cũng không đưa ra ý kiến kiểm toán.

Trên cơ sở công tác soát xét của chúng tôi, chúng tôi không thấy có sự kiện nào để chúng tôi cho rằng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đính kèm theo đây không phản ánh trung thực và hợp lý trên các khía cạnh trọng yếu tỷ lệ an toàn vốn khả dụng của Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Nam tại thời điểm ngày 30 tháng 6 năm 2012, phù hợp với Thông tư số 226/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 của Bộ Tài chính về việc 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 chỉ tiêu an toàn tài chính.

Báo cáo này thay thế Báo cáo Kết quả Kiểm tra số 286/2012/BCTC-KTTV-KT1 ngày 07 tháng 8 năm 2012 do bổ sung các thủ tục kiểm toán của Chuẩn mực kiểm toán Việt Nam số 910 "Công tác soát xét Báo cáo tài chính" theo hướng dẫn tại Công văn số 2737/UBCK-QLQ ngày 02 tháng 8 năm 2012 và Công văn số 3008/UBCK-QLKD ngày 22 tháng 8 năm 2012 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước.

Giám đốc



Nguyễn Hoàng Đức
Chứng chỉ kiểm toán viên số: 0368/KTV
Hà Nội, ngày 28 tháng 8 năm 2012

Kiểm toán viên

Hoàng Thị Việt
Chứng chỉ kiểm toán viên số: 0374/KTV

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Số:

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

**Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước, Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội
và Sở Giao dịch Chứng khoán TP Hồ Chí Minh**

Chúng tôi cam đoan rằng:

- 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 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 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;
- 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 sẽ cập nhật trong kỳ báo cáo tiếp theo;
- Chúng tôi xin hoàn toàn chịu trách nhiệm trước Pháp luật về tính chính xác và trung thực của nội dung báo cáo.

Hà Nội, ngày 28 tháng 8 năm 2012

Kế toán trưởng



Vũ Thị Thúy



Trịnh Quốc Vân

TH

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG**

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
A - NGUỒN VỐN				
1.	Vốn chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	75.000.000.000		
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	636.000.000		
7.	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-		
8.	Lợi nhuận lũy kế và lợi nhuận chưa phân phối trước khi trích lập các khoản dự phòng theo quy định của pháp luật	(18.101.285.138)		
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		1.640.129.420	-
	CỘNG	57.534.714.862	1.640.129.420	-
1A.	TỔNG CỘNG NGUỒN VỐN	55.894.585.442		

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

I. Bảng tính vốn khả dụng (tiếp theo)

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
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 8			
	Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 5			-
2.	Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn			
III. Các khoản phải thu ngắn hạn				
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	177.637.500		
3.	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			-
4.	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			-
5.	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			-
6.	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	408.297.176		
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	Phải thu khác, tài sản ngắn hạn khác			-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

I. Bảng tính vốn khả dụng (tiếp theo)

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
C - TÀI SẢN DÀI HẠN				
I. Các khoản phải thu dài hạn				
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			
II.	Tài sản cố định		2.230.521.881	
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 vào công ty liên kết, liên doanh			-
3.	Đầu tư chứng khoán dài hạn			
	Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 8			
	Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định tại khoản 5 Điều 5			-
4.	Đầu tư dài hạn khác			-
5.	Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn			
V.	Tài sản dài hạn khác			
	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 theo quy định tại Điều 5			2.634.428.535
1C. CỘNG			4.864.950.416	
VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C		50.443.700.350		

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

Đơn vị tính: VND

A - RỦI RO THỊ TRƯỜNG

Các hạng mục đầu tư		Hệ số rủi ro (1)	Quy mô rủi ro (2)	Giá trị rủi ro (3) = (1) * (2)
I.	Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ			-
1.	Tiền mặt (VND)	0%	5.310.390.225	-
2.	Các khoản tương đương tiền	0%	7.040.873.333	-
3.	Giấy tờ có giá, công cụ chuyên nhượng 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 cố định			-
5.1	Trái phiếu Chính phủ, 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%	-	-
5.2	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm;	3%	-	-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 tới 5 năm;	4%	-	-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên;	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 tới 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 tới 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%	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

II. Bảng tính giá trị rủi ro (tiếp theo)

Các hạng mục đầu tư	<u>Hệ số rủi ro</u> (1)	<u>Quy mô rủi ro</u> (2)	<u>Giá trị rủi ro</u> (3) = (1) * (2)
IV. Cổ phiếu			1.686.924.100
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 mở	10%	555.841.000	55.584.100
9. Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	96.000.000	14.400.000
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%	283.500.000	56.700.000
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 đầu (IPO)	30%	-	-
12. Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	3.120.480.000	1.560.240.000
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 giao dịch	40%	-	-
16. Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	-	-
VII. Chứng khoán khác			-
Cô phân, phân vốn góp và các loại chứng khoán			
17. khác	80%	-	-
VIII. Rủi ro tăng thêm			-
Mã chứng khoán	<u>Mức tăng thêm</u>	<u>Quy mô rủi ro</u>	<u>Giá trị rủi ro</u>
		-	-
		-	-
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG			<u>1.686.924.100</u>

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

II. Bảng tính giá trị rủi ro (tiếp theo)

B - RỦI RO THANH TOÁN	Loại hình giao dịch	Giá trị rủi ro				Tổng giá trị rủi ro
		0%	0,8%	3,2%	4,8%	
I. Rủi ro trước thời hạn thanh						422.452.400
1. Tiền gửi kỳ hạn và các khoản tiền cho vay không có tài sản bảo đảm	-	-	-	-	7.040.873.333	422.452.400
2. Cho vay chứng khoán	-	-	-	-	-	-
3. Vay chứng khoán	-	-	-	-	-	-
4. Hợp đồng mua chứng khoán có cam kết bán lại	-	-	-	-	-	-
5. Hợp đồng bán chứng khoán có cam kết mua lại	-	-	-	-	-	-
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						7.248.987.000
Thời gian quá hạn						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						7.248.987.000
III. Rủi ro tăng thêm						-
Chi tiết tới từng khoản vay, tới từng đối tác						Giá trị rủi ro
						-
						-
B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN						7.671.439.400

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

II. Bảng tính giá trị rủi ro (tiếp theo)

C - RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)	
I. Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	20.607.530.493
II. Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	(5.155.665.185)
1. Chi phí khấu hao	1.069.557.334
2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	(6.833.472.519)
3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
4. Dự phòng phải thu khó đòi	608.250.000
III. Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)	25.763.195.678
IV. 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	6.440.798.920
V. 20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	7.000.000.000
C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max {IV, V})	7.000.000.000
D - TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A + B + C)	16.358.363.500

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOẢN ĐẠI NAM

Địa chỉ: Số 28 Tầng Bạt Hồ - Phạm Đình Hồ - Hai Bà Trưng - Hà Nội

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**III. BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG**

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2012

STT	CHỈ TIÊU	Vốn khả dụng/Tổng giá trị rủi ro	Ghi chú
1.	Tổng giá trị rủi ro thị trường	1.686.924.100	
2.	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	7.671.439.400	
3.	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	7.000.000.000	
4.	Tổng giá trị rủi ro (4 = 1 + 2 + 3)	<u>16.358.363.500</u>	
5.	Vốn khả dụng	50.443.700.350	
6.	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6 = 5/4)	308%	