

**CÔNG TY TNHH DỊCH VỤ TƯ VẤN TÀI CHÍNH KẾ TOÁN VÀ KIỂM TOÁN NAM VIỆT**  
**NAM VIET AUDITING AND ACCOUNTING FINANCIAL CONSULTING SERVICES CO., LTD. (AASCN)**

29 Hoàng Sa, Quận 1, Thành Phố Hồ Chí Minh, Tel: (84-8) 39103908; 39104881 - Fax: (84-8) 39104880

# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

*Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính  
tại ngày 30 tháng 06 năm 2013  
đã được soát xét*



## MỤC LỤC

*Trang*

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

01 - 02

BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT

03

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT

04 - 12

TR  
D  
TÁ  
N

# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Ban Tổng Giám đốc Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha (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 30/06/2013.

### KHÁI QUÁT

Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha được thành lập và hoạt động tại Việt Nam theo:

- Giấy chứng nhận Đăng ký kinh doanh số 0103015116 do Sở Kế hoạch Đầu tư Thành phố Hà Nội cấp lần đầu ngày 19 tháng 12 năm 2006 và sửa đổi lần 1 vào ngày 22 tháng 12 năm 2006;
- Giấy phép thành lập và hoạt động kinh doanh chứng khoán số 44/UBCK-GPHĐKD do Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 28 tháng 12 năm 2006;
- Quyết định số 64/UBCK-GP của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước ngày 21 tháng 8 năm 2007 về việc thay đổi người đại diện theo pháp luật của Công ty;
- Quyết định số 133/UBCK-GP của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước ngày 18 tháng 6 năm 2008 về việc tăng vốn điều lệ của Công ty;
- Giấy phép số 211/UBCK-GP của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước ngày 16 tháng 3 năm 2009 về việc điều chỉnh Giấy phép thành lập và hoạt động kinh doanh chứng khoán số 44/UBCK-GPHĐKD được rút bớt nghiệp vụ tự doanh chứng khoán.

Vốn điều lệ của Công ty là **58.619.400.000** đồng.

Hoạt động đăng ký của Công ty bao gồm: Môi giới chứng khoán. Tư vấn đầu tư chứng khoán. Lưu ký chứng khoán.

Trụ sở chính của Công ty tại số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội.

### CÁC SỰ KIỆN SAU NGÀY KHÓA SỔ LẬP BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN 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 TỔNG GIÁM ĐỐC VÀ BAN KIỂM SOÁT TRONG KỶ VÀ ĐẾN NGÀY LẬP BÁO CÁO NÀY NHƯ SAU:

#### *Hội đồng quản trị*

Ông Nguyễn Quốc Hùng	Chủ tịch
Ông Lê Như Hùng	Phó chủ tịch
Ông Lê Văn Cường	Thành viên
Bà Trương Thị Minh Thọ	Thành viên
Ông Lê Đức Thắng	Thành viên (bỏ nhiệm từ 26 tháng 6 năm 2013)

#### *Ban Tổng Giám đốc*

Ông Nguyễn Quốc Hùng	Tổng Giám đốc
Ông Lê Văn Cường	Giám đốc khối tư vấn tài chính doanh nghiệp
Bà Nguyễn Thị Giáng Hương	Giám đốc khối Tài chính Kế toán – Hành chính nhân sự
Ông Võ Thanh Hải	Giám đốc khối Công nghệ thông tin
Bà Trương Thị Minh Thọ	Giám đốc Khối Kinh doanh chứng khoán

#### *Ban kiểm soát*

Ông Lê Thành Trung	Trưởng ban
Bà Nguyễn Đặng Bảo Linh	Thành viên
Bà Đỗ Bích Ngọc	Thành viên



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

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

### KIỂM TOÁN VIÊN

Công ty TNHH Dịch vụ Tư vấn Tài chính Kế toán và Kiểm toán Nam Việt (AASCN) đã thực hiện soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 30/06/2013.

### CÔNG BỐ TRÁCH NHIỆM CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC ĐỐI VỚI BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Ban Tổng Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm về việc lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính phản ánh trung thực, hợp lý tình hình tài chính của Công ty trong kỳ. Trong quá trình lập Báo cáo, Ban Tổng 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 Tổng Giám đốc Công ty 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/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 của Bộ Tài Chính và thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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.

Thay mặt Ban Tổng Giám đốc



Nguyễn Quốc Hùng  
Tổng Giám đốc

Ngày 12 tháng 8 năm 2013



Số: 292/BCSX/TC

## **BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT**

**Về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2013  
của Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha**

**Kính gửi: Các cổ đông, Hội đồng quản trị và Ban Tổng Giám đốc  
Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha**

Chúng tôi đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 06 năm 2013 của Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha được lập ngày 12 tháng 08 năm 2013. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo được lập theo quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính và thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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 được trình bày từ trang 5 đến trang 12 kèm theo.

Việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính thuộc trách nhiệm của Ban Tổng Giám đốc Công ty. Trách nhiệm của chúng tôi là đưa ra ý kiến về báo cáo này căn cứ trên kết quả soát xét của chúng tôi.

Chúng tôi đã thực hiện công việc soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính theo chuẩn mực kiểm toán Việt Nam số 910 và các chuẩn mực kiểm toán Việt Nam hiện hành khác. 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 Cổ phần chứng khoán Alpha và áp dụng các thủ tục phân tích trên những thông tin tài chính; 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 vấn đề đáng lưu ý nào để 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 chứng khoán Alpha tại thời điểm 30 tháng 06 năm 2013 phù hợp với quy định của Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính và thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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)**



**Nguyễn Minh Tiến**

Chứng nhận ĐKHN số: 0547-2013-152-1

**Kiểm toán viên**

**Lê Hồng Đào**

Chứng nhận ĐKHN số: 1732-2013-152-1

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 12 tháng 8 năm 2013



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

SỐ:

(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

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

Chúng tôi cam đoan rằng:

- (1) Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha từ trang 5 đến trang 12 kèm theo được xây dựng trên cơ sở số liệu được cập nhật tại ngày lập báo cáo theo đúng các quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 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 và Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 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;
- (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 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.



Vũ Thúy Anh  
Kế toán trưởng

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2013



Hà Huy Hoàng  
Trưởng bộ phận  
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Quốc Hùng  
Tổng Giám đốc



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

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)	58.619.400.000	-	-
2	Thặng dư vốn cổ phần, vốn khác không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	1.779.850.000	-	-
3	Cổ phiếu quỹ	-	-	-
4	Quỹ dự trữ bổ sung vốn điều lệ (nếu có)	-	-	-
5	Quỹ đầu tư phát triển	-	-	-
6	Quỹ dự phòng tài chính	808.893.187	-	-
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	(5.052.010.890)	-	-
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	-	3.814.205.668	358.600
<b>1A</b>	<b>Tổng</b>			<b>52.342.285.229</b>
<b>B</b>	<b>Tài sản ngắn hạn</b>			
<i>I</i>	<i>Tiền và các khoản tương đương tiền</i>	-	-	-
<i>II</i>	<i>Các khoản đầu tư tài chính ngắn hạn</i>	-	-	-
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 (*)	-	-	-
<i>III</i>	<i>Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác</i>	-	-	-
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	-	-	-



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
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	-	-	-
<b>IV</b>	<b>Hàng tồn kho</b>	-	-	-
<b>V</b>	<b>Tài sản ngắn hạn khác</b>	-	<b>244.848.123</b>	-
1.	Chi phí trả trước ngắn hạn	-	223.979.688	-
2.	Thuế GTGT được khấu trừ	-	-	-
3.	Thuế và các khoản phải thu nhà nước	-	20.868.435	-
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>244.848.123</b>
<b>C</b>	<b>Tài sản dài hạn</b>			
<b>I</b>	<b>Các khoản phải thu dài hạn</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	-	-	-

# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

**BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG**(tiếp theo)  
tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
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>	-	<b>2.332.508.528</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	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	-	-	-
<b>V</b>	<b>Tài sản dài hạn khác</b>	-	<b>6.340.383.506</b>	-
	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	-	-	-
<b>1C</b>	<b>Tổng</b>			<b>8.672.892.034</b>
<b>VỐN KHẢ DỤNG = 1A + 1B + 1C</b>				<b>43.424.545.072</b>



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

### 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 mặt (VND)	0%	11.278.455.309	-
2	Các khoản tương đương tiền, tiền gửi có kỳ hạn	0%	-	-
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%	-	-
		Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
		(1)	(2)	(3)=(1)x(2)
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%	-	-
<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 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%	-	-

# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo) tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

### A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG (tiếp theo)

Các hạng mục đầu tư		Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
		(1)	(2)	(3)=(1)x(2)
7	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%	-	-
<b>IV. Cổ phiếu</b>				<b>9.988.787.050</b>
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%	584.140.000	58.414.000
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	351.387.000	52.708.050
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 đầu (IPO)	30%	-	-
12	Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác	50%	19.755.330.000	9.877.665.000
<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 đình chỉ giao dịch	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	-	-
<b>VII. Các tài sản khác</b>				-
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	-	-
18	Các tài sản đầu tư khác	80%	-	-
<b>VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>				<b>2.963.299.500</b>
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	Công ty CP Bia và NGK Việt Hà	30%	9.877.665.000	2.963.299.500
2				
<b>A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)</b>				<b>12.952.086.550</b>



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo) tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

### B. RỦI RO THANH TOÁN

Loại hình giao dịch	Giá trị rủi ro					Tổng giá trị rủi ro
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	
<b>I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán</b>						
1	Tiền gửi kỳ hạn và 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	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	-	-	-	-	-
<b>II. Rủi ro quá thời hạn thanh toán</b>						<b>1.505.130.066</b>
<b>Thời gian quá hạn</b>						<b>Giá trị rủi ro</b>
1	0 – 15 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	Hệ số rủi ro		Quy mô rủi ro		-
				16%		-
2	16 – 30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán			32%		-
3	31 – 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán			48%		-
4	Từ 60 ngày trở đi			100%	1.505.130.066	1.505.130.066
<b>III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)</b>						-
<b>B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)</b>						<b>1.505.130.066</b>

# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

### C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)

<b>I</b>	<b>Tổng chi phí hoạt động</b>	<b>13.991.637.041</b>
	<b>Các khoản chi phí trừ khỏi tổng chi phí</b>	<b>312.039.581</b>
	1. Chi phí khấu hao	1.136.846.873
<b>II</b>	2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	(2.009.131.292)
	3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
	4. Dự phòng phải thu khó đòi	1.184.324.000
<b>III</b>	<b>Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)</b>	<b>13.679.597.460</b>
<b>IV</b>	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	3.419.899.365
<b>V</b>	20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	7.000.000.000
<b>C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max {IV, V})</b>		<b>7.000.000.000</b>
<b>D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)</b>		<b>21.457.216.616</b>



# CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

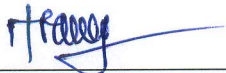
Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội

## BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG tại ngày 30 tháng 06 năm 2013

STT	Các chỉ tiêu	Giá trị rủi ro/vốn khả dụng	Ghi chú
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	12.952.086.550	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	1.505.130.066	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	7.000.000.000	
4	<b>Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)</b>	<b>21.457.216.616</b>	
5	<b>Vốn khả dụng</b>	<b>43.424.545.072</b>	
6	<b>Tỷ lệ an toàn Vốn khả dụng (6=5/4)</b>	<b>202%</b>	



Vũ Thúy Anh  
Kế toán trưởng



Hà Huy Hoàng  
Trưởng bộ phận  
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Quốc Hùng  
Tổng Giám đốc

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2013