

**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ
QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC**
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT

Tại ngày 30 tháng 6 năm 2013

MỤC LỤC

	<u>TRANG</u>
BÁO CÁO CỦA TỔNG GIÁM ĐỐC	2 - 4
BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT	5 - 6
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH	7
I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG	8 - 9
II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO	10 - 12
III. BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG	13

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

BÁO CÁO CỦA TỔNG GIÁM ĐỐC

Tổng Giám đốc Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán An Phúc (gọi tắt "Công ty") trình bày Báo cáo của mình cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 30 tháng 6 năm 2013 đã được soát xét.

KHÁI QUÁT VỀ CÔNG TY

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng Khoán An Phúc (tên giao dịch tiếng Anh là An Phúc Investment) được thành lập và hoạt động theo Giấy chứng nhận đăng ký kinh doanh số 4103005793 do Sở Kế hoạch và Đầu tư thành phố Hồ Chí Minh cấp ngày 26 tháng 12 năm 2006 và Giấy phép hoạt động số 15/UBCK-GPHĐQLD do Chủ tịch Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 28 tháng 12 năm 2006.

Trong quá trình hoạt động, Công ty được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp các quyết định điều chỉnh như sau:

- Quyết định số 379/QĐ-UBCK do Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 22 tháng 6 năm 2007, chuẩn y các việc: bổ sung nghiệp vụ "Quản lý danh mục đầu tư chứng khoán", thay đổi tên giao dịch tiếng Anh và tên viết tắt của Công ty;
- Quyết định số 56/UBCK-GPĐC do Chủ tịch Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 7 tháng 12 năm 2009, chuẩn y việc điều chỉnh tăng vốn điều lệ của Công ty từ 8.100.000.000 VND lên 25.000.000.000 VND.
- **Vốn pháp định** : 25.000.000.000 VND
- **Vốn điều lệ** : 25.000.000.000 VND

Cơ cấu vốn điều lệ như sau:

Stt	Tên cổ đông	Số cổ phần	Giá trị cổ phần (VND)	Tỷ lệ (%)
-	Công ty Cổ phần Tài Việt	81.000	810.000.000	3,24
-	Ông Nguyễn Văn Dương	1.995.000	19.950.000.000	79,80
-	Bà Nguyễn Thị Hạnh	130.000	1.300.000.000	5,20
-	Ông Lê Văn Thanh Long	120.000	1.200.000.000	4,80
-	Bà Nguyễn Thị Hồng Anh	64.000	640.000.000	2,56
-	Bà Nguyễn Thị Hiền Khanh	30.000	300.000.000	1,20
-	Bà Phạm Thị Thu Hằng	80.000	800.000.000	3,20
	Cộng	2.500.000	25.000.000.000	100,00

- **Trụ sở hoạt động**
Địa chỉ : 81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh
Điện thoại : (84 - 08) 38 445 448
Fax : (84 - 08) 38 444 958
Mã số thuế : 0 3 0 4 7 5 6 8 6 3

- **Ngành, nghề kinh doanh**

Lập và quản lý quỹ đầu tư chứng khoán. Tư vấn tài chính và tư vấn đầu tư chứng khoán. Quản lý danh mục đầu tư chứng khoán.

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

BÁO CÁO CỦA TỔNG GIÁM ĐỐC (tiếp theo)

HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ VÀ TỔNG GIÁM ĐỐC

Hội đồng Quản trị và Tổng Giám đốc trong kỳ và cho đến thời điểm lập Báo cáo này bao gồm:

<u>Họ và tên</u>	<u>Chức vụ</u>	<u>Ngày bổ nhiệm</u>	<u>Ngày từ nhiệm</u>
<u>Hội đồng Quản trị</u>			
Ông Nguyễn Văn Dương	Chủ tịch		6/8/2013
Bà Phạm Thị Thanh Nga	Chủ tịch	6/8/2013	
Ông Lê Văn Thanh Long	Ủy viên		
Bà Nguyễn Thị Hiền Khanh	Ủy viên		
<u>Ban Kiểm soát</u>			
Bà Hồ Thị Thanh Nguyên	Trưởng ban		
Bà Phạm Thị Thu Hằng	Thành viên		
Bà Nguyễn Quỳnh Anh	Thành viên		
<u>Tổng Giám đốc</u>			
Ông Nguyễn Văn Dương	Tổng Giám đốc		22/4/2013
Bà Nguyễn Thị Hồng Mai	Tổng Giám đốc	22/4/2013	

TÌNH HÌNH VỐN KHẢ DỤNG

Tình hình vốn khả dụng tại ngày 30 tháng 6 năm 2013 của Công ty được trình bày trong Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đính kèm Báo cáo này (từ trang 7 đến trang 13).

SỰ KIỆN PHÁT SINH SAU NGÀY 30 THÁNG 6 NĂM 2013

Kể từ ngày 6 tháng 8 năm 2013, bà Phạm Thị Thanh Nga sẽ đảm nhiệm vị trí Chủ tịch Hội đồng Quản trị của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán An Phúc theo Quyết định số 03/ĐHĐCĐ/BBH/API/2013 của Đại hội Đồng cổ đông và Quyết định số 09/HĐQT/QĐ/API/2013 của Hội đồng Quản trị Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán An Phúc ngày 6 tháng 8 năm 2013.

Ngoài sự kiện nêu trên, Tổng Giám đốc Công ty khẳng định không có sự kiện nào xảy ra sau ngày 30 tháng 6 năm 2013 cho đến thời điểm lập Báo cáo này cần thiết phải có các điều chỉnh số liệu hoặc công bố trong Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

KIỂM TOÁN VIÊN

Công ty TNHH Kiểm toán - Tư vấn Đất Việt (Vietland) đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2013, Vietland bày tỏ nguyện vọng tiếp tục được chỉ định là Kiểm toán viên độc lập của Công ty.

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

Tổng Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính và đảm bảo rằng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý tình hình vốn khả dụng của Công ty tại ngày 30 tháng 6 năm 2013, phù hợp với 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 chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 9 tháng 10 năm 2012 của Bộ Tài chính sửa đổi, bổ sung một số điều của 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 chỉ tiêu an toàn tài chính.

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

BÁO CÁO CỦA TỔNG GIÁM ĐỐC (tiếp theo)

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 14 tháng 9 năm 2013



Handwritten signature

NGUYỄN THỊ HỒNG MAI - Tổng Giám đốc

BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT
VỀ BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
TẠI NGÀY 30 THÁNG 6 NĂM 2013
CỦA CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

Kính gửi: QUÝ CÔ ĐỒNG, HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ VÀ TỔNG GIÁM ĐỐC
CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

Chúng tôi đã thực hiện công tác soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán An Phúc tại ngày 30 tháng 6 năm 2013 bao gồm: Bảng tính vốn khả dụng, Bảng tính giá trị rủi ro và Tổng hợp các chỉ tiêu rủi ro và vốn khả dụng, được lập ngày 14 tháng 9 năm 2013 từ trang 7 đến trang 13 kèm theo.

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

Cơ sở ý kiến

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 số 910. Chuẩn mực này yêu cầu công tác soát xét phải được 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 các sai sót trọng yếu. Công tác soát xét bao gồm chủ yếu là việc trao đổi với nhân sự của Công ty và áp dụng các thủ tục kiểm tra đối chiếu các chỉ tiêu trên Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính. Công tác soát xét cũng bao gồm việc đánh giá trách nhiệm tính toán các chỉ tiêu an toàn tài chính cũng như trách nhiệm về tính chính xác của kết quả tính toán của Tổng Giám đốc Công ty; 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 không đưa ra ý kiến kiểm toán.

Kết luận về công tác soát xét

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 kèm theo không phản ánh trung thực và hợp lý, trên các khía cạnh trọng yếu, tình hình vốn khả dụng của Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Chứng khoán An Phúc tại ngày 30 tháng 6 năm 2013, phù hợp với 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 chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 9 tháng 10 năm 2012 của Bộ Tài chính sửa đổi, bổ sung một số điều của 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 chỉ tiêu an toàn tài chính.

BÁO CÁO KẾT QUẢ CÔNG TÁC SOÁT XÉT (tiếp theo)

Báo cáo được lập bằng tiếng Việt và tiếng Anh có giá trị như nhau. Bản tiếng Việt là bản gốc khi cần đối chiếu.

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 14 tháng 9 năm 2013



VÕ THÈ HOANG - Giám đốc điều hành
Số giấy CN ĐKHN Kiểm toán: 0484-2013-037-1

NGUYỄN CAO HOÀI THU - Kiểm toán viên
Số giấy CN ĐKHN Kiểm toán: 0474-2013-037-1

Nơi nhận:

- Như trên
- Luru Vietland

Số công văn: 20/2013/CV - API

V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 14 tháng 9 năm 2013

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30 tháng 6 năm 2013

Kính gửi: ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC

Chúng tôi cam đoan rằng:

- (1) 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 chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 9 tháng 10 năm 2012 của Bộ Tài chính sửa đổi, bổ sung một số điều của 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 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.



NGUYỄN THỊ HỒNG MAI
Tổng Giám đốc

PHẠM THỊ THU HẰNG
Kế toán trưởng

HỒ THỊ THANH NGUYÊN
Trưởng Bộ phận Kiểm soát nội bộ

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

PHẦN I: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI SUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		VKD	KHOẢN GIẢM TRỪ	KHOẢN TĂNG THÊM
		(1)	(2)	(3)
A.	Nguồn vốn	26.313.949.334	9.503.444.352	265.084
1.	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	25.000.000.000		
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	-		
7.	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu			
8.	Lợi nhuận tích lũy và lợi nhuận chưa phân phối trước khi trích lập các khoản dự phòng theo quy định pháp luật	1.313.949.334		
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 phần giảm đi hoặc tăng thêm của các chứng khoán tại chi tiêu đầu tư tài chính		9.503.444.352	265.084
B.	Tài sản ngắn hạn	-	40.498.221	-
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			-
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 trở xuống			-
5.	Các khoản phải thu khác			
	Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống			

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

PHẦN I: BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI SUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		VKD	KHOẢN GIẢM TRỪ	KHOẢN TĂNG THÊM
		(1)	(2)	(3)
	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		40.498.221	
1.	Chi phí trả trước ngắn hạn		21.603.558	
2.	Thuế GTGT được khấu trừ			
3.	Thuế và các khoản phải thu nhà nước		13.894.663	
4.	Tài sản ngắn hạn khác		5.000.000	
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		5.000.000	
C	Tài sản dài hạn	-	15.728.891	-
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		15.728.891	
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 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		-	
TỔNG CỘNG		26.313.949.334	9.559.671.464	265.084
VỐN KHẢ DỤNG			16.754.542.954	

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

PHẦN II: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG**

CÁC HẠN MỤC ĐẦU TƯ		HS RỦI RO	QUY MÔ RỦI RO	GIÁ TRỊ RỦI RO
		(1)	(2)	(3) = (1) * (2)
I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ				-
1.	Tiền	0%	716.806.438	-
2.	Các khoản tương đương tiền	0%	-	-
3.	Giấy tờ có giá 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 lãi suất cố định			-
5.1	Trái phiếu chính phủ, trái phiếu Chính phủ 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 hạn đáo hạn còn lại dưới 1 năm	3%		-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời hạn đáo hạn còn lại từ 1 tới 5 năm	4%		-
	Trái phiếu công trình được Chính phủ, Bộ Tài chính bảo lãnh có thời hạn 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 còn lại dưới từ 1 đến 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	15%		-
	Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 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 dưới từ 1 đến 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	30%		-
	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%		-

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

PHẦN II: BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG

CÁC HẠN MỤC ĐẦU TƯ		HS RỦI RO	QUY MÔ RỦI RO	GIÁ TRỊ RỦI RO
		(1)	(2)	(3) = (1) * (2)
IV. Cổ phiếu				3.059.932.660
8	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch chứng khoán Tp.HCM, chứng chỉ quỹ đại chúng mở	10%	315.969.100	31.596.910
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch chứng khoán Hà Nội.	15%	65.000.000	9.750.000
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%	-	-
11	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi các công ty đại chúng đã đăng ký lưu ký, chưa niêm yết hoặc đăng ký giao dịch	30%	-	-
12	Cổ phiếu của Công ty đại chúng khác	50%	6.037.171.500	3.018.585.750
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, đình chỉ giao dịch kể từ ngày giao dịch (không bao gồm trường hợp cổ phiếu tạm ngừng giao dịch để chuyển sản giao dịch)	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	-	-
VII. Chứng khoán khác				390.922.560
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	488.653.200	390.922.560
VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)				395.900.000
	Mã chứng khoán	M. tăng	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1.	Địa ốc Tân Bình	20%	1.979.500.000	395.900.000
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A = I + II + III + IV + V + VI + VII + VIII)				3.846.755.220

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

B. RỦI RO THANH TOÁN

STT	LOẠI HÌNH GIAO DỊCH	GIÁ TRỊ RỦI RO						TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán								660.000.000
1.	Tiền gửi kỳ hạn và các khoản cho vay không có tài sản đảm bảo	-	-	-	-	-	-	-
2.	Cho vay chứng khoán	-	-	-	-	-	-	-
3.	Vay chứng khoán	-	-	-	-	-	-	-
4.	Hợp đồng mua CK có cam kết bán lại (Repo)	-	-	-	-	-	-	-
5.	Hợp đồng bán CK có cam kết mua lại (Reverse Repo)	-	-	-	-	-	-	-
6.	Hợp đồng cho vay mua kỳ quỹ (cho khách hàng vay mua chứng khoán)/các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	660.000.000	-	-	-	-	-	660.000.000
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.	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 lên	-		-			-	
III. Rủi ro tăng thêm								198.000.000
	Chỉ tiết tới tăng khoản vay, tới từng đối tác	Mức tăng thêm		Quy mô rủi ro			Giá trị rủi ro	
1.	Kỳ quỹ mua chứng khoán OTC	30%		660.000.000			198.000.000	
B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B = I + II + III)								858.000.000

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

STT	NỘI DUNG	GIÁ TRỊ
I.	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	9.962.847.232
	Các khoản giảm trừ tổng chi phí	8.677.495.783
	1. Chi phí khấu hao	14.332.671
II.	2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	8.663.163.112
	3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
	4. Dự phòng phân thu khó đòi	-
III.	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)	1.285.351.449
IV.	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	321.337.862
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(III, IV))		5.000.000.000
D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (D = A + B + C)		9.704.755.220

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ CHỨNG KHOÁN AN PHÚC

81/10B, Hồ Văn Huê, Phường 9, Quận Phú Nhuận, Thành phố Hồ Chí Minh

PHẦN III: TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG

STT	CÁC CHỈ TIÊU	GIÁ TRỊ RỦI RO/VỐN KHẢ DỤNG	GHI CHÚ
1.	Tổng giá trị rủi ro thị trường	3.846.755.220	
2.	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	858.000.000	
3.	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.000.000.000	
4.	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	9.704.755.220	
5.	Vốn khả dụng	16.754.542.954	
6.	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	172,64%	

