

**CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT**

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2016



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Địa chỉ: Số 34 Hàn Thuyên, Phạm Đình Hổ, Hai Bà Trưng, Hà Nội

Tel : (84-4) 3944 5474 Fax : (84-4) 3944 5475

MỤC LỤC

NỘI DUNG

TRANG

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

02 - 03

BÁO CÁO SOÁT XÉT

04 - 05

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

06 - 13

103
CÔ
CÔ
CHỦ
Q
BA

C.T.T.N.
FY
HỮU HẠN
ĐỊNH GIÁ
AM
TP. HÀ

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

Chúng tôi các thành viên Ban Giám đốc Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc Gia (sau đây gọi tắt là “Công ty”) trình bày Báo cáo của Ban Giám đốc cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét tại ngày 30/06/2016.

Khái quát Chung về Công ty

Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc Gia được thành lập và hoạt động theo Giấy chứng nhận đăng ký Kinh doanh số 0103015005 ngày 11/12/2006 do Sở kế hoạch và Đầu tư thành phố Hà Nội cấp, Quyết định cấp giấy phép hoạt động kinh doanh chứng khoán số 27/UBCK-GPHĐKD ngày 15/12/2006, Quyết định số 49/UBCK-GP ngày 05/03/2009, Quyết định số 196/UBCK-GCN ngày 05/03/2009, Quyết định 89/GPĐC-UBCK ngày 31/05/2012, Quyết định số 97/GPĐC-UBCK ngày 04/7/2012 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước và Giấy phép điều chỉnh Giấy phép thành lập và hoạt động Công ty chứng khoán số 29/GPĐC-UBCK ngày 17/06/2013 của Chủ tịch Ủy ban Chứng khoán Nhà nước với số vốn điều lệ là 170.000.000.000 đồng. Ngày 17/06/2014 Chủ tịch Ủy ban Chứng khoán cấp Giấy phép điều chỉnh số 14/GPĐC-UBCK về việc thay đổi người đại diện theo Pháp luật của Công ty.

Theo giấy phép điều chỉnh số 29/GPĐC-UBCK thì vốn Điều lệ của Công ty là: **170.000.000.000 VND** (Một trăm bảy mươi tỷ đồng Việt Nam)

Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Ban Kiểm soát

Các thành viên Hội đồng quản trị, Ban Giám đốc và Ban Kiểm soát điều hành Công ty cho kỳ hoạt động kết thúc ngày 30/06/2016 và đến ngày lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính, gồm:

Hội đồng quản trị

Ông Nguyễn Hải Dương

Ông Trần Việt Anh

Ông Nguyễn Đình Thọ

Chức vụ

Chủ tịch

Ủy viên

Ủy viên

Ban Giám đốc

Ông Vũ Quang Vịnh

Ông Hồ Anh Dũng

Ông Nguyễn Lâm Tùng

Chức vụ

Phó Tổng giám đốc

Phó Tổng giám đốc (Bổ nhiệm ngày 12/04/2016)

Giám đốc chi nhánh

Ban Kiểm soát

Bà Nguyễn Thị Thu Hương

Chức vụ

Trưởng ban

Trụ sở chính:

Địa chỉ: Số 34B Hàn Thuyên, Phạm Đình Hồ, Hai Bà Trưng, Hà Nội

Công bố trách nhiệm của Ban Giám đốc đối với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Ban Giám đốc Công ty có trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2016 phản ánh một cách trung thực và hợp lý tình hình tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30/06/2016 và nhận thấy không có vấn đề bất thường xảy ra có thể ảnh hưởng đến khả năng hoạt động liên tục 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 quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính và đã được sửa đổi bổ sung theo Thông tư số

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Địa chỉ: Số 34 Hàn Thuyên, Phạm Đình Hổ, Hai Bà Trưng, Hà Nội

Tel : 04 3791 1818 Fax : 04 3791 5808

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

đính kèm Báo cáo tỷ lệ an toàn tài

chính tại thời điểm 31/12/2015

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

(tiếp theo)

165/2012/TT-BTC ngày 09/12/2012 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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.

Ban Giám đốc Công ty cam kết rằng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại thời điểm ngày 30/06/2016, phù hợp với quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 đã được sửa đổi, bổ sung theo Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 của Bộ Tài chính.

Thay mặt và đại diện cho Ban Giám đốc,

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA



Hồ Anh Dũng

Phó Tổng giám đốc

(Giấy ủy quyền số 24/2016/CT.HĐQT-UQ ngày 19/04/2016)

Hà Nội, ngày 14 tháng 07 năm 2016

3-C
Y
N
OÁN
IA
-TP

01018
CÔ
TRÁCH
KIỂM TO
VI
CÁU GI



CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN VÀ ĐỊNH GIÁ VIỆT NAM
THÀNH VIÊN HẠNG KIỂM TOÁN BKR INTERNATIONAL
Chuyên ngành Kiểm toán, Định giá, Tư vấn tài chính, kế toán, thuế

Số: ~~487~~-16/BC-TC/VAE

Hà Nội, ngày ~~15~~ tháng 08 năm 2016

BÁO CÁO SOÁT XÉT
Về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2016

Kính gửi : **Hội đồng Quản trị và Ban Giám đốc**
Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia

Chúng tôi đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2016 kèm theo của Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia (gọi tắt là "Công ty") được lập ngày 14 tháng 07 năm 2016, từ trang 06 đến trang 13 đã được Ban Giám đốc của Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia lập theo các quy định về lập và trình bày báo cáo tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 đã được sửa đổi, bổ sung theo Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 9/10/2012 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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.

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 tại thời điểm 30/06/2016 phù hợp quy định tại Thông tư số 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 đã được sửa đổi, bổ sung theo Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 9/10/2012 của Bộ Tài chính về việc quy định các 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 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 tại thời điểm 30/06/2016 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 thời điểm 30/06/2016 dựa trên kết quả soát xét của chúng tôi. Chúng tôi đã thực hiện công việc soát xét theo các nguyên tắc của 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, trong phạm vi các nguyên tắc này có thể được áp dụng cho công việc soát xét thông tin tài chính quá khứ do kiểm toán viên độc lập của đơn vị thực hiện.

Công việc soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính 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 đính kèm không được lập và trình bày, trên các khía cạnh trọng yếu, phù hợp với quy định tại Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 đã được sửa đổi, bổ sung theo Thông tư 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 của Bộ Tài chính về việc quy định các chỉ tiêu



BÁO CÁO SOÁT XÉT
Về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2016
(tiếp theo)

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.



Phạm Hùng Sơn

Phó Tổng giám đốc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0813-2013-34-1

Thay mặt và đại diện cho

CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN VÀ ĐỊNH GIÁ VIỆT NAM



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Số:

V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

Hà Nội, ngày 14 tháng 07 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2016

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

Chúng tôi cam đoan rằng:

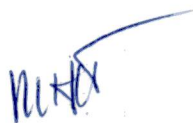
- (1) Báo cáo được xây dựng trên cơ sở số liệu được cập nhật tại ngày lập báo cáo và được lập theo đúng các quy định tại Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31/12/2010 của Bộ Tài chính quy định về chỉ tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với các tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng các chỉ tiêu an toàn tài chính và Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09/10/2012 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 226/2010/TT-BTC 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.

Kế toán trưởng



Phạm Thị Chiến

Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thị Thu Hà

Phó Tổng giám đốc



Hồ Anh Dũng

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
A	NGUỒN VỐN			
1	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	170.000.000.000		
2	Thặng dư vốn cổ phần, vốn khác 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	219.857.812		
6	Quỹ dự phòng tài chính	528.621.659		
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 pháp luật.	(7.138.415.473)		
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		11.563.565	15.638.381
1A	Tổng			163.614.138.814
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		-	
III	Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác		2.140.000	
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		2.140.000	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

3	Phải thu nội bộ ngắn hạn			
	<i>Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4	Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán		-	
	<i>Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>		-	
	<i>Phải thu hoạt động giao dịch chứng khoán có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
5	Các khoản phải thu khác		-	
	<i>Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
6	Dự phòng phải thu ngắn hạn khó đòi (*)			
IV	Hàng tồn kho		-	
V	Tài sản ngắn hạn khác		594.179.056	
1	Chi phí trả trước ngắn hạn		579.179.056	
2	Thuế GTGT được khấu trừ			
3	Thuế và các khoản phải thu nhà nước			
4	Tài sản ngắn hạn khác		15.000.000	
4.1	Tạm ứng		-	
	<i>Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>		-	
	<i>Tạm ứng có thời hạn hoàn ứng còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4.2	Phải thu khác, tài sản ngắn hạn khác		15.000.000	
1B	Tổng			596.319.056
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		-	
	<i>Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn của khách hàng có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
2	Vốn kinh doanh ở đơn vị trực thuộc		-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

3	Phải thu dài hạn nội bộ		-	
	<i>Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
4	Phải thu dài hạn khác		-	
	<i>Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i>			
	<i>Phải thu dài hạn khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i>		-	
5	Dự phòng phải thu dài hạn khó đòi (*)			
II	Tài sản cố định		1.229.634.436	
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		-	
	<i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 8</i>			
	<i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 5</i>		-	
4	Đầu tư dài hạn khác		-	
5	Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn		-	
V	Tài sản dài hạn khác		2.839.928.865	
	<i>Các chỉ tiêu tài sản bị coi là khoản ngoại trừ tại báo cáo tài chính năm đã kiểm toán mà không bị tính giảm trừ theo quy định tại Điều 5</i>		-	
1C	Tổng		4.069.563.301	
VỐN KHẢ DỤNG = (1A) - (1B) - (1C)				158.948.256.457

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO**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			153.395.161.550	-
1	Tiền mặt (VND)	0%	122.712.299	-
2	Các khoản tương đương tiền, tiền gửi có kỳ hạn	0%	153.272.449.251	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển 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%	-	-

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

	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%	-	-
IV. Cổ phiếu			32.430.300	4.689.950
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%	3.610.900	361.090
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	28.700.400	4.305.060
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%	119.000	23.800
11	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các công ty đại chúng đã đăng ký lưu ký, 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%	-	-
V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán			-	-
13	Quỹ đại chúng, bao gồm cả công ty đầu tư chứng khoán đại chúng	10%	-	-
14	Quỹ thành viên, công ty chứng khoán riêng lẻ	30%	-	-
VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch			2.466.700	1.226.530
15	Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch	40%	68.200	27.280
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	2.398.500	1.199.250
VII. Chứng khoán khác			-	-
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	-	-
VIII. Rủi ro tăng thêm (nếu có)			-	-
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)				5.916.480

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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
I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
1	Tiền gửi kỳ hạn và các khoản tiền cho vay không có tài sản đảm bảo và các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán	-	-	-	-	-	515.425.971	515.425.971
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	-	-	-	-	-	-	-

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	16%	-	-
2	16-30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	32%	-	-

III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)

	Chi tiết tới từng khoản 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)

515.425.971

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

Giá trị

I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	15.564.733.627
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	430.803.017
	1. Chi phí khấu hao	430.340.030
	2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	462.987
	3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
	4. Dự phòng phải thu khó đòi	-
III.	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III=I-II)	15.133.930.610
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV=25%xIII)	3.783.482.653
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)		7.521.342.451

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30/06/2016

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	5.916.480	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	515.425.971	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	7.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	7.521.342.451	
5	Vốn khả dụng	158.948.256.457	
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	2113,30%	

Hà Nội, ngày 14 tháng 07 năm 2016

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Kế toán trưởng

Trưởng bộ phận Kiểm
soát nội bộ

Phó Tổng giám đốc

Phạm Thị Chiến

Nguyễn Thị Thu Hà

Hồ Anh Dũng

