



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

tại ngày 30/06/2018

đã được soát xét

**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, P. Đa Kao, Quận 1, TP. Hồ Chí Minh, Tel: 028. 3910 3908; 3910 6162 - Fax: 028. 3910 4880

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

MỤC LỤC

NỘI DUNG	TRANG
BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC	01 – 02
BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ	03 – 04
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT	05 – 16

30521
CÔNG
RÁCH NH
DỊCH V
ÀI CHÍN
VÀ KIẾ
NAM
1 - TP

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Địa chỉ: Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội
Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

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 30/06/2018.

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 08 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 06 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 03 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.

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

Vốn cổ phần: 58.619.400.000 đồng.

Hoạt động kinh doanh chính trong năm: Môi giới chứng khoán; Lưu ký chứng khoán và Tư vấn tài chính.

Hội đồng Quản trị, Ban Tổng Giám đốc, Ban kiểm soát trong kỳ kế toán từ ngày 01/01/2018 đến ngày 30/06/2018 và đến ngày lập báo cáo này như sau:

Hội đồng Quản trị

<i>Họ và tên</i>	<i>Vị trí</i>
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

Ban Tổng Giám đốc

<i>Họ và tên</i>	<i>Vị trí</i>
Ông Nguyễn Quốc Hùng	Tổng Giám đốc
Ông Lê Văn Cường	Phó Tổng Giám đốc kiêm Giám đốc khối Tư vấn tài chính doanh
Bà Trương Thị Minh Thọ	Giám đốc khối Kinh doanh chứng khoán
Ông Võ Thanh Hải	Giám đốc khối Công nghệ thông tin

Ban kiểm soát

<i>Họ và tên</i>	<i>Vị trí</i>
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

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC (tiếp theo)

Người đại diện theo pháp luật

Người đại diện theo pháp luật của Công ty trong kỳ và tại ngày lập báo cáo này là Ông Nguyễn Quốc Hùng.

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 tại ngày 30 tháng 06 năm 2018 cho Công ty.

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 tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 30 tháng 06 năm 2018. 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 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài Chính về việc quy định chi tiêu an toàn tài chính và biện pháp xử lý đối với tổ chức kinh doanh chứng khoán không đáp ứng chi tiêu an toàn tài chính.

Thay mặt Ban Tổng Giám đốc



Nguyễn Quốc Hùng
Tổng Giám đốc

Thành phố Hà Nội, ngày 09 tháng 08 năm 2018

Số:213/BCSX/TC

BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ

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

Chúng tôi đã soát xét báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo tại ngày 30 tháng 06 năm 2018 của Công ty Cổ phần Chứng khoán Alpha (“Công ty”), được lập ngày 09 tháng 08 năm 2018, từ trang 05 đến trang 16. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo được lập theo quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài Chính về việc quy định 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.

Trách nhiệm của Ban Tổng Giám đốc

Ban Tổng Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm lập và trình bày trung thực và hợp lý báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty theo các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài Chính về việc quy định 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 và chịu trách nhiệm về kiểm soát nội bộ mà Ban Tổng Giám đốc xác định là cần thiết để đảm bảo 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 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 đính kèm 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 ngày 30 tháng 06 năm 2018, phù hợp với quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 của Bộ Tài Chính về việc quy định 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.

Vấn đề khác

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại ngày 31 tháng 12 năm 2017 đã được kiểm toán bởi kiểm toán viên và doanh nghiệp kiểm toán khác. Báo cáo kiểm toán lập ký ngày 26/03/2018 đã đưa ra ý kiến của kiểm toán viên là chấp nhận toàn phần.

**Công ty TNHH Dịch vụ Tư vấn Tài chính
Kế toán và Kiểm toán Nam Việt (AASCN)**



Cao Thị Hồng Nga

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0613-2018-152-1

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 09 tháng 08 năm 2018

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30 tháng 06 năm 2018

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 theo đúng quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 08 năm 2017 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;
- (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



Đặng Thị Thương Trà
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Quốc Hùng
Tổng Giám đốc

Thành phố Hà Nội, ngày 09 tháng 08 năm 2018

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
A	Vốn chủ sở hữu			
1	Vốn góp 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 không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	1.779.850.000	-	-
3	Cổ phiếu quỹ	-	-	-
4	Quyền chọn chuyển đổi trái phiếu – cấu phần vốn	-	-	-
5	Vốn khác của chủ sở hữu	-	-	-
6	Chênh lệch đánh giá tài sản theo giá trị hợp lý	-	-	-
7	Quỹ dự trữ bổ sung vốn điều lệ	382.686.493	-	-
8	Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ	426.206.694	-	-
9	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-	-	-
10	Lợi nhuận chưa phân phối	(21.383.520.437)	-	-
11	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	525.641.911	-	-
12	Chênh lệch đánh giá lại TSCĐ	-	-	-
13	Chênh lệch tỷ giá hối đoái	-	-	-
14	Các khoản nợ có thể chuyển đổi	-	-	-
15	Toàn bộ phần giảm đi hoặc tăng thêm của các chứng khoán tại chi tiêu đầu tư tài chính	-	24.722	-
16	Vốn khác (nếu có)	-	-	-
1A	Tổng			40.350.239.889
B	Tài sản ngắn hạn			
I	Tài sản tài chính		588.117.139	
1	Tiền và các khoản tương đương tiền	-	-	-
2	Các tài sản tài chính ghi nhận thông qua lãi/(lỗ) (FVTPL)	-	-	-
	- Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường	-	-	-
	- Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
3	Các khoản đầu tư nắm giữ đến ngày đáo hạn (HTM)	-	-	-
	- Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường	-	-	-
	- Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
4	Các khoản cho vay	-	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
5	Tài sản tài chính sẵn sàng để bán (AFS) - Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường - Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
6	Dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính và tài sản thế chấp	-	-	-
7	Các khoản phải thu (Phải thu bán các tài sản tài chính; Phải thu và dự thu cổ tức, tiền lãi từ các tài sản tài chính) - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	394.180.663 394.180.663	-
8	Chứng quyền có bảo đảm chưa phát hành hết	-	-	-
9	Chứng khoán cơ sở phục vụ mục đích phòng ngừa rủi ro khi phát hành chứng quyền có bảo đảm	-	-	-
10	Phải thu các dịch vụ công ty chứng khoán cung cấp - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	35.500.000 35.500.000	-
11	Phải thu nội bộ - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	-	-
12	Phải thu về lỗi giao dịch chứng khoán - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	-	-
13	Các khoản phải thu khác - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống - Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	158.436.476 158.436.476	-
14	Dự phòng suy giảm giá trị các khoản phải thu	-	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
II	Tài sản ngắn hạn khác	-	435.268.304	-
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	-	-	-
2	Vật tư văn phòng, công cụ dụng cụ	-	-	-
3	Chi phí trả trước ngắn hạn	-	403.908.376	-
4	Cầm cố, thế chấp, ký quỹ, ký cược ngắn hạn	-	10.000.000	-
5	Thuế giá trị gia tăng được khấu trừ	-	-	-
6	Thuế và các khoản phải thu Nhà nước	-	21.359.928	-
7	Tài sản ngắn hạn khác	-	-	-
8	Dự phòng suy giảm giá trị tài sản ngắn hạn khác	-	-	-
1B	Tổng			1.023.385.443
C	Tài sản dài hạn			
I	Tài sản tài chính dài hạn	-	-	-
1	Các khoản phải thu dài hạn	-	-	-
2	Các khoản đầu tư	-	-	-
2.1	Các khoản đầu tư nắm giữ đến ngày đáo hạn	-	-	-
	- Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường	-	-	-
	- Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng	-	-	-
2.2	Đầu tư vào công ty con	-	-	-
2.3	Đầu tư vào công ty liên doanh, liên kết	-	-	-
2.4	Đầu tư dài hạn khác	-	-	-
II	Tài sản cố định	-	183.003.142	-
III	Bất động sản đầu tư	-	-	-
IV	Chi phí xây dựng cơ bản dở dang	-	-	-
V	Tài sản dài hạn khác	-	2.465.378.776	-
1	Cầm cố, thế chấp, ký quỹ, ký cược dài hạn	-	-	-
2	Chi phí trả trước dài hạn	-	49.883.801	-
3	Tài sản thuế thu nhập hoãn lại	-	-	-
4	Tiền nộp Quỹ hỗ trợ thanh toán	-	2.415.494.975	-
4	Tài sản dài hạn khác	-	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG (tiếp theo)
tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
		(1)	(2)	(3)
<i>VI</i>	<i>Dự phòng suy giảm giá trị tài sản dài hạn</i>	-	-	-
	<i>Các chỉ tiêu tài sản bị coi là khoản ngoại trừ, có ý 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 5</i>	-	-	-
1C	Tổng			2.648.381.918
D	Tài khoản ký quỹ đảm bảo			
1	Giá trị ký quỹ	-	-	-
1.1	Giá trị đóng góp vào quỹ hỗ trợ thanh toán của Trung tâm LKCK (đối với thị trường chứng khoán phái sinh)	-	-	-
1.2	Giá trị đóng góp vào quỹ bù trừ của đối tác thanh toán trung tâm đối với vị thế mở của chính thành viên bù trừ (đối với thị trường chứng khoán phái sinh)	-	-	-
1.3	Khoản ký quỹ bằng tiền và giá trị bảo lãnh thanh toán của ngân hàng khi phát hành chứng quyền có bảo đảm	-	-	-
STT	NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
		VKD	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
2	Giá trị tài sản bảo đảm cho các nghĩa vụ phải có thời hạn còn lại trên 90 ngày	-	-	-
1D	Tổng			-
VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C - 1D				36.678.472.528

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG

Đơn vị tính: VND

Các hạng mục đầu tư		Hệ số rủi ro (1)	Quy mô rủi ro (2)	Giá trị rủi ro (3)=(1)x(2)
I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ				
1	Tiền mặt (VND)	0%	10.679.768.832	-
2	Các khoản tương đương tiền	0%	9.500.000.000	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi	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	<i>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</i>	3%	-	-
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 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%	-	-
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 từ 1 năm đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	30%	-	-
	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	35%	-	-
	Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG (tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

Các hạng mục đầu tư	Hệ số rủi ro (1)	Quy mô rủi ro (2)	Giá trị rủi ro (3)=(1)x(2)
IV. Cổ phiếu			
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%	478.800	47.880
9 Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	-	-
10 Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của 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%	15.568.770.000	7.784.385.000
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 đầu tư chứng khoán riêng lẻ	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 phái sinh			
17 Hợp đồng tương lai chỉ số cổ phiếu	8%	-	-
18 Hợp đồng tương lai trái phiếu chính phủ	3%	-	-
VIII. Chứng khoán khác			
19 Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	-	-
20 Cổ phiếu niêm yết trên các thị trường nước ngoài thuộc chỉ số đạt chuẩn	25%	-	-
21 Cổ phiếu niêm yết trên các thị trường nước ngoài không thuộc chỉ số đạt chuẩn	100%	-	-
22 Chứng quyền bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Tp.HCM	8%	-	-
23 Chứng quyền bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội	10%	-	-
24 Chứng quyền bảo đảm do công ty chứng khoán phát hành		-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG (tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

Các hạng mục đầu tư	Hệ số rủi ro (1)	Quy mô rủi ro (2)	Giá trị rủi ro (3)=(1)x(2)
25 Chứng khoán hình thành từ hoạt động phòng ngừa rủi ro cho chứng quyền có bảo đảm do công ty chứng khoán đã phát hành (trường hợp chứng quyền có bảo đảm không có lãi)		-	-
26 Phần chênh lệch giữa giá trị chứng khoán cơ sở dùng để phòng ngừa rủi ro và giá trị chứng khoán cơ sở cần thiết để phòng ngừa rủi ro cho chứng quyền có bảo đảm		-	-
IX. 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)			2.335.315.500
Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1 Công ty Cổ phần Bia và Nước giải khát Việt Hà	30%	7.784.385.000	2.335.315.500
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII+IX)			10.119.748.380

4-C
Y
CỦA
VÁN
TOA
OÁN
T
CH

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)
tại ngày 30 tháng 06 năm 2018**B. GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN**

	<i>Đơn vị tính: VND</i>
	Giá trị rủi ro
Rủi ro trước thời hạn thanh toán (<i>thuyết minh 1</i>)	570.000.000
Rủi ro quá thời hạn thanh toán (<i>thuyết minh 2</i>)	561.759.333
Rủi ro tăng thêm (<i>thuyết minh 3</i>)	114.000.000
Tổng giá trị rủi ro thanh toán	1.245.759.333

1. Rủi ro trước thời hạn thanh toán

		<i>Đơn vị tính: VND</i>						
	Hệ số rủi ro	Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
		0%	0,8%	3,2%	4,8%	6%	8%	
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
1	Tiền gửi kỳ hạn, các khoản tiền cho vay không có tài sản bảo đảm, các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán và các khoản mục tiềm ẩn rủi ro thanh toán khác	-	-	-	-	570.000.000	-	570.000.000
2	Cho vay tài sản tài chính/ Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
3	Vay tài sản tài chính / Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
4	Hợp đồng mua tài sản tài chính có cam kết bán lại/ Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
5	Hợp đồng bán tài sản tài chính có cam kết mua lại/ Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
Tổng rủi ro trước thời hạn thanh toán								570.000.000

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Địa chỉ: Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội
Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

B. GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (tiếp theo)**2. Rủi ro quá thời hạn thanh toán**

Đơn vị tính: VND

STT	Thời gian quá hạn	Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	Từ 0 đến 15 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	16%	-	-
2	Từ 16 đến 30 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	32%	-	-
3	Từ 31 đến 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	48%	-	-
4	Từ 60 ngày trở đi	100%	561.759.333	561.759.333
Tổng rủi ro quá thời hạn thanh toán				561.759.333

3. Rủi ro tăng thêm

Đơn vị tính: VND

STT	Chi tiết tới từng đối tác	Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	Tiền gửi có kỳ hạn tại Ngân hàng TM TNHH MTV Dầu khí Toàn Cầu (GP Bank)	20%	570.000.000	114.000.000
Tổng rủi ro tăng thêm				114.000.000



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

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

Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

C. GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG

		<i>Đơn vị tính: VND</i>
	Chỉ tiêu	Giá trị
I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới tháng 12 năm 2017	9.244.083.387
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí (II = 1+2+3+4+5+6)	(3.085.107.305)
1	- Chi phí khấu hao	90.051.123
2	- Chi phí/(Hoàn nhập) dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính và tài sản thế chấp	(3.155.158.428)
3	- Chi phí/(Hoàn nhập) dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính dài hạn	-
4	- Chi phí/(Hoàn nhập) dự phòng suy giảm giá trị các khoản phải thu	(20.000.000)
5	- Chi phí/(Hoàn nhập) dự phòng suy giảm giá trị tài sản ngắn hạn khác	-
6	- Chi phí/(Hoàn nhập) dự phòng suy giảm giá trị tài sản dài hạn	-
III	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I – II)	12.329.190.692
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% * III)	3.082.297.673
V	20% Vốn pháp định của công ty chứng khoán	7.000.000.000
TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (Max {IV, V})		7.000.000.000



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ALPHA

Địa chỉ: Số 2, Phạm Ngũ Lão, Phường Phan Chu Trinh, Quận Hoàn Kiếm, Thành phố Hà Nội
Điện thoại: (024) 3933 4666 Fax: (024) 3933 4668

BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG
tại ngày 30 tháng 06 năm 2018

STT	Các chỉ tiêu	ĐVT	Giá trị rủi ro/vốn khả dụng	Ghi chú
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	VND	10.119.748.380	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	VND	1.245.759.333	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	VND	7.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	VND	18.365.507.713	
5	Vốn khả dụng	VND	36.678.472.528	
6	Tỷ lệ vốn khả dụng (6=5/4)	%	199,71%	



Vũ Thúy Anh
Kế toán trưởng



Đặng Thị Thương Trà
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Quốc Hùng
Tổng Giám đốc

Thành phố Hà Nội, ngày 09 tháng 08 năm 2018

