



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT
Tại thời điểm 30/06/2018

HÀ NỘI, THÁNG 08 NĂM 2018

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Tầng 6, Tòa nhà Prime Centre, số 53 Quang Trung, phường Nguyễn Du, quận Hai Bà Trưng, Hà Nội

MỤC LỤC

NỘI DUNG

TRANG

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

02 - 03

BÁO CÁO SOÁT XÉT

04

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

05 - 14

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Chúng tôi các thành viên Ban Tổng giám đốc Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc Gia (sau đây gọi tắt là "Công ty") trình bày Báo cáo của Ban Tổng giám đốc cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét tại thời điểm 30/06/2018.

Khái quát Chung về Công ty

Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia (gọi tắt là "Công ty") được thành lập và hoạt động theo Giấy chứng nhận đăng ký kinh doanh số 0103015005 do Sở Kế hoạch và Đầu tư thành phố Hà Nội cấp ngày 11/12/2006, 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. Công ty có 6 (sáu) lần thay đổi Giấy chứng nhận kinh doanh.

Giấy chứng nhận đăng ký kinh doanh điều chỉnh	Ngày	Nội dung thay đổi
89/GPĐC-UBCK	31/12/2012	Thay đổi người đại diện theo pháp luật
97/GPĐC-UBCK	04/07/2012	Thay đổi địa chỉ trụ sở chính
29/GPĐC-UBCK	17/06/2013	Thay đổi vốn điều lệ
14/GPĐC-UBCK	17/06/2014	Thay đổi người đại diện theo pháp luật
26/GPĐC-UBCK	29/03/2018	Bổ sung nghiệp vụ Tự doanh chứng khoán
35/GPĐC-UBCK	22/05/2018	Thay đổi địa chỉ trụ sở chính

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 Tổng 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 từ 01/01/2018 đến 30/06/2018 và đến ngày lập Báo cáo này, gồm:

Hội đồng quản trị	Chức vụ
Ông Nguyễn Hải Dương	Chủ tịch
Ông Nguyễn Đình Thọ	Ủy viên
Bà Nguyễn Thu Trang	Ủy viên
Ban Giám đốc	Chức vụ
Ông Hồ Anh Dũng	Tổng Giám đốc
Ông Nguyễn Lâm Tùng	Giám đốc chi nhánh
Ban Kiểm soát	Chức vụ
Bà Nguyễn Thị Thu Hương	Trưởng ban

Trụ sở chính của Công ty: Tầng 6, Tòa nhà Prime Centre, số 53 Quang Trung, phường Nguyễn Du, quận Hai Bà Trưng, Hà Nội

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Chúng tôi các thành viên Ban Tổng giám đốc Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc Gia (sau đây gọi tắt là "Công ty") trình bày Báo cáo của Ban Tổng giám đốc cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét tại thời điểm 30/06/2018.

Khái quát Chung về Công ty

Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia (gọi tắt là "Công ty") được thành lập và hoạt động theo Giấy chứng nhận đăng ký kinh doanh số 0103015005 do Sở Kế hoạch và Đầu tư thành phố Hà Nội cấp ngày 11/12/2006, 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. Công ty có 6 (sáu) lần thay đổi Giấy chứng nhận kinh doanh.

Giấy chứng nhận đăng ký kinh doanh điều chỉnh	Ngày	Nội dung thay đổi
89/GPĐC-UBCK	31/12/2012	Thay đổi người đại diện theo pháp luật
97/GPĐC-UBCK	04/07/2012	Thay đổi địa chỉ trụ sở chính
29/GPĐC-UBCK	17/06/2013	Thay đổi vốn điều lệ
14/GPĐC-UBCK	17/06/2014	Thay đổi người đại diện theo pháp luật
26/GPĐC-UBCK	29/03/2018	Bổ sung nghiệp vụ Tự doanh chứng khoán
35/GPĐC-UBCK	22/05/2018	Thay đổi địa chỉ trụ sở chính

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 Tổng 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 từ 01/01/2018 đến 30/06/2018 và đến ngày lập Báo cáo này, gồm:

Hội đồng quản trị

	Chức vụ
Ông Nguyễn Hải Dương	Chủ tịch
Ông Nguyễn Đình Thọ	Ủy viên
Bà Nguyễn Thu Trang	Ủy viên

Ban Giám đốc

	Chức vụ
Ông Hồ Anh Dũng	Tổng Giám đốc
Ông Nguyễn Lâm Tùng	Giám đốc chi nhánh

Ban Kiểm soát

	Chức vụ
Bà Nguyễn Thị Thu Hương	Trưởng ban

Trụ sở chính của Công ty: Tầng 6, Tòa nhà Prime Centre, số 53 Quang Trung, phường Nguyễn Du, quận Hai Bà Trưng, Hà Nội

BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC
(tiếp theo)

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 có trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 phản ánh một cách trung thực và hợp lý tình hình tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 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 Tổng giám đốc Công ty cam kết đã tuân thủ các quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 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 Tổng 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 30/06/2018.

Thay mặt và đại diện cho Ban Tổng giám đốc,

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA



Hồ Anh Dũng
Tổng Giám đốc

Hà Nội, ngày 08 tháng 08 năm 2018

Số: 513 -18/BC-TC/BKTTC-VAE

Hà Nội, ngày 10 tháng 08 năm 2018

BÁO CÁO SOÁT XÉT
về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018

Kính gửi : **Hội đồng quản trị và Ban Tổng giám đốc**
Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc gia

Chúng tôi, Công ty TNHH Kiểm toán và Định giá Việt Nam đã tiến hành soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại thời điểm 30/06/2018 của Công ty Cổ phần Chứng khoán Quốc Gia (gọi tắt là “Công ty”) được lập ngày 08 tháng 08 năm 2018, từ trang 05 đến trang 14 kèm theo.

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 tại thời điểm 30/06/2018 phù hợp quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 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 và chịu trách nhiệm về kiểm soát nội bộ mà Ban Tổng 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 30/06/2018 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 30/06/2018 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 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 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 nhận thấy có vấn đề gì khiến chúng tôi cho rằng báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo, trên các khía cạnh trọng yếu, được lập và trình bày không phù hợp với các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15/08/2017 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.



Trần Quốc Tuấn
Tổng Giám đốc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0148-2018-034-1

Thay mặt và đại diện cho
CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN VÀ ĐỊNH GIÁ VIỆT NAM

Số:

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Hà Nội, ngày 08 tháng 08 năm 2018

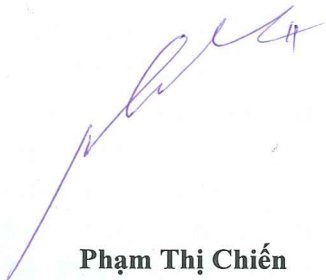
Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

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 15/08/2017 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.

Kế toán trưởng



Phạm Thị Chiến

Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



Nguyễn Thị Thu Hà



Hồ Anh Dũng

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(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	Vốn chủ sở hữu			
1	Vốn góp 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 không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	-		
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	-		
8	Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ	528.621.659		
9	Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	219.857.812		
10	Lợi nhuận chưa phân phối	29.113.596.670		
11	Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	-		
12	Chênh lệch đánh giá lại tài sản cố định	-		
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 chỉ tiêu đầu tư tài chính		16.422.868	7.814.611.554
16	Vốn khác (nếu có)	-		
1A	Tổng			207.660.264.827
B	Tài sản ngắn hạn			
I	Tài sản tài chính			
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			
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		-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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		-	
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		-	
11	Phải thu nội bộ			
	- 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		-	
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		-	
14	Dự phòng suy giảm giá trị các khoản phải thu		-	
II	Tài sản ngắn hạn khác			
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			
4	Cầm cố, thế chấp, ký quỹ, ký cược ngắn hạn			775.881.269
5	Thuế giá trị gia tăng được khấu trừ			276.288.100
			-	

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

6	Thuế và các khoản khác phải thu Nhà nước		-	
7	Tài sản ngắn hạn khác		-	
8	Dự phòng suy giảm giá trị tài sản ngắn hạn khác		-	
1B	Tổng			1.052.169.369
C	Tài sản dài hạn			
I	Tài sản tài chính dài hạn			
1	Các khoản phải thu dài hạn		-	
2	Các khoản đầu tư		-	
	Các khoản đầu tư nắm giữ đến ngày đáo hạn		-	
2.1	- 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			279.074.203
III	Bất động sản đầu tư			-
IV	Chi phí xây dựng cơ bản dở dang			150.000.000
V	Tài sản dài hạn khác			-
1	Cầm cố, thế chấp, ký quỹ, ký cược dài hạn		-	
2	Chi phí trả trước dài hạn		-	
3	Tài sản thuế thu nhập hoãn lại		-	
4	Tiền nộp Quỹ hỗ trợ thanh toán		3.755.601.097	
5	Tài sản dài hạn khác		-	
VI	Dự phòng suy giảm giá trị tài sản dài hạn			
	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		-	
1C	Tổng			4.184.675.300
D	Các 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 Lưu ký chứng khoán (đối với thị trường chứng khoán phái sinh)		-	
1.2	Giá trị đóng góp 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		-	
2	Giá trị tài sản bảo đảm cho các nghĩa vụ phải trả có thời hạn còn lại trên 90 ngày		-	
1D	Tổng			
	VỐN KHẢ DỤNG = 1A - 1B - 1C - 1D			202.423.420.158

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

A. GIÁ TRỊ 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)
I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ				
1	Tiền mặt (VND)	-	67.204.425.168	-
2	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
3	Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi	-	-	-
II. Trái phiếu Chính phủ				
4	Trái phiếu Chính phủ không trả lãi	-	-	-
5	Trái phiếu Chính phủ trả lãi suất cố định	-	-	-
5.1	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	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	-	-

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

IV. Cổ phiếu			129.126.960.870	19.427.729.202
8	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh; chứng chỉ quỹ mở	10	42.308.976.270	4.230.897.627
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15	43.335.306.900	6.500.296.035
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	43.482.677.700	8.696.535.540
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	-	-
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				3.326.323
15	Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch	40	2.927.701	1.171.080
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50	4.310.485	2.155.243
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 có bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh	8	-	-
23	Chứng quyền có bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội	10	-	-
24	Chứng quyền có bảo đảm do công ty chứng khoán phát hành		-	-

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

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)					3.650.506.800
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro	
	DSN	20,00%	3.058.000.000	611.600.000	
	DVN	20,00%	8.696.534.000	1.739.306.800	
	DNP	20,00%	6.498.000.000	1.299.600.000	
A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII+IX)					23.081.562.325

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO (tiếp theo)

B. GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN

	Giá trị rủi ro
Rủi ro trước thời hạn thanh toán (Thuyết minh 1)	53.885.106
Rủi ro quá thời hạn thanh toán (Thuyết minh 2)	-
Rủi ro tăng thêm (Thuyết minh 3)	-
Tổng giá trị rủi ro thanh toán	53.885.106

1. Rủi ro trước thời hạn thanh toán

Loại hình giao dịch	Hệ số rủi ro (%)	Giá trị rủi ro (VND)						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 và 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	-	-	-	-	-	53.885.106	53.885.106
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 có cam kết bán lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
5	Hợp đồng bán tài sản có cam kết mua lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
TỔNG RỦI RO TRƯỚC THỜI HẠN THANH TOÁN								53.885.106

Chi tiết hệ số rủi ro thanh toán theo đối tượng được xác định như sau:

TT	Đối tác thanh toán cho Công ty	Hệ số rủi ro thanh toán
(1)	Chính phủ, các tổ chức phát hành được Chính phủ bảo lãnh, Chính phủ và Ngân hàng Trung ương các nước thuộc khối OECD; Ủy ban nhân dân tỉnh, thành phố trực thuộc Trung ương;	0%
(2)	Sở giao dịch chứng khoán, Trung tâm lưu ký chứng khoán	0,8%

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

(3)	Tổ chức tín dụng, tổ chức tài chính, tổ chức kinh doanh chứng khoán thành lập ở các nước thuộc khối OECD và có hệ số tín nhiệm đáp ứng các điều kiện khác theo quy định nội bộ của tổ chức kinh doanh chứng khoán	3,2%
(4)	Tổ chức tín dụng, tổ chức tài chính, tổ chức kinh doanh chứng khoán thành lập ngoài các nước OECD; hoặc thành lập tại các nước thuộc khối OECD và không đáp ứng các điều kiện khác theo quy định nội bộ của Công ty	4,8%
(5)	Tổ chức tín dụng, tổ chức tài chính, tổ chức kinh doanh chứng khoán thành lập và hoạt động tại Việt Nam	6%
(6)	Các tổ chức, cá nhân khác	8%

2. Rủi ro quá thời hạn thanh toán

	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 lên sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	100	-	-
TỔNG RỦI RO QUÁ THỜI HẠN THANH TOÁN				-

3. Rủi ro tăng thêm

TT	Chi tiết tới từng khoản vay, tới từng đối tác	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
TỔNG RỦI RO TĂNG THÊM				-

C. GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG

	Chỉ tiêu	Giá trị
I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	22.554.658.520
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí (<i>Thuyết minh 1</i>)	435.398.762
III	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III=I-II)	22.119.259.758
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV=25%III)	5.529.814.939
V	20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	27.000.000.000
TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (Max{IV,V})		27.000.000.000

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm: 30/06/2018

(tiếp theo)

Đơn vị tính: VND

I. Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí

Chi phí khấu hao

Giá trị

447.523.363

Chi phí dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính và tài sản thế chấp

(12.124.601)

435.398.762

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 (nếu có)
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	23.081.562.325	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	53.885.106	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	27.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	50.135.447.431	
5	Vốn khả dụng	202.423.420.158	
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	404%	

Hà Nội, ngày 08 tháng 08 năm 2018

CÔNG TY CP CHỨNG KHOÁN QUỐC GIA

Kế toán trưởng

Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ

Tổng Giám đốc

Phạm Thị Chiến

Nguyễn Thị Thu Hà

Hồ Anh Dũng