

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016
(đã được soát xét)

NỘI DUNG

	Trang
Báo cáo của Ban Tổng Giám đốc	02-03
Báo cáo soát xét thông tin tài chính giữa niên độ	04-05
Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét	06-13



BÁO CÁO CỦA BAN TỔNG GIÁM ĐỐC

Ban Tổng Giám đốc Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Dương (sau đây gọi tắt là “Công ty”) trình bày Báo cáo của mình và Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016.

CÔNG TY

Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Dương là Công ty cổ phần được thành lập tại Việt Nam theo Giấy phép kinh doanh số 0103015027 ngày 22 tháng 12 năm 2006 do Sở kế hoạch và Đầu tư thành phố Hà Nội cấp, Giấy phép hoạt động kinh doanh Chứng khoán số 48/UBCK-GPHĐKD do Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 29 tháng 12 năm 2006 và các Giấy phép điều chỉnh bổ sung (Giấy phép điều chỉnh bổ sung mới nhất số 10/GPĐC-UBCK cấp ngày 20 tháng 05 năm 2016 về thay đổi trụ sở chính về Tầng 2, Tòa nhà VNT Tower, số 19 Nguyễn Trãi, phường Khương Trung, quận Thanh Xuân, Hà Nội).

Trụ sở của Công ty tại: Tầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân, Hà Nội.

HỘI ĐỒNG QUẢN TRỊ, BAN TỔNG GIÁM ĐỐC VÀ BAN KIỂM SOÁT

Các thành viên của Hội đồng Quản trị trong kỳ và tại ngày lập báo cáo này bao gồm:

Ông Vũ Hồng Sơn	Chủ tịch	
Bà Nguyễn Thị Phương Thảo	Ủy viên	
Bà Lê Thị Ánh Tuyết	Ủy viên	Bổ nhiệm ngày 27/04/2016
Ông Hoàng Văn Tuyền	Ủy viên	Miễn nhiệm ngày 27/04/2016

Các thành viên của Ban Tổng Giám đốc đã điều hành Công ty trong năm và tại ngày lập báo cáo này bao gồm:

Ông Vũ Hồng Sơn	Tổng Giám đốc	
Bà Nguyễn Thị Phương Thảo	Phó Tổng Giám đốc	
Ông Vũ Hồng Minh	Phó Tổng Giám đốc	
Ông Đặng Văn Hậu	Phó Tổng Giám đốc	Miễn nhiệm ngày 27/05/2016
Ông Nguyễn Tiến Dũng	Phó Tổng Giám đốc	

Các thành viên của Ban Kiểm soát bao gồm:

Ông Vũ Xuân Dương	Trưởng ban	Bổ nhiệm ngày 27/04/2016
Bà Lại Thị Sen	Ủy viên	
Bà Nguyễn Thị Linh	Ủy viên	
Bà Nguyễn Thị Hồng Ngọc	Ủy viên	Miễn nhiệm ngày 27/04/2016

KIỂM TOÁN VIÊN

Công ty TNHH Hãng Kiểm toán AASC đã thực hiện soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính cho Công ty.

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG

Tầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân, Hà Nội

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 tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016. Trong quá trình lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính, Ban Tổng Giám đốc Công ty cam kết đã tuân thủ các yêu cầu tại Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 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 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 ngày 30 tháng 06 năm 2016, phù hợp với các quy định tại Thông tư 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 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 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.

Cam kết khác

Ban Điều hành cam kết rằng Công ty không vi phạm nghĩa vụ công bố thông tin theo quy định tại Thông tư số 155/2015/TT-BTC ngày 06 tháng 10 năm 2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn về việc công bố thông tin trên thị trường chứng khoán.

Thay mặt Ban Tổng Giám đốc



Vũ Hồng Sơn
Tổng Giám đốc

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2016

1001
CỘNG HÒA
CHÍNH
NG KI
AA
KIỂM

NG T
PH
NG KI
DUC
TIEN

Vấn đề khác

Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Dương đã lập một bộ Báo cáo tài chính giữa niên độ cho kỳ kế toán từ ngày 01/01/2016 đến ngày 30/06/2016 theo Chuẩn mực kế toán, Chế độ kế toán Việt Nam áp dụng đối với công ty chứng khoán và các quy định pháp lý có liên quan đến việc lập và trình bày báo cáo tài chính và chúng tôi đã phát hành Báo cáo soát xét thông tin tài chính giữa niên độ về Báo cáo tài chính đó cho Công ty Cổ phần Chứng khoán Đại Dương vào ngày 15/08/2016.



Công ty TNHH Hãng Kiểm toán AASC

Nguyễn Thanh Tùng 

Phó Tổng Giám đốc

Giấy chứng nhận đăng ký hành nghề kiểm toán

Số: 0063-2013-002-1

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2016



Số:

V/v: Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH
Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

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 226/2010/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2010 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 Thông tư số 165/2012/TT-BTC ngày 09 tháng 10 năm 2012 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 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 Thị Thanh Hằng
Kế toán trưởng



Lại Thị Sen
Trưởng bộ phận Kiểm soát nội bộ



Vũ Hồng Sơn
Tổng Giám đốc

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2016

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNGTầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính**
Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016**BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH**

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
A	NGUỒN VỐN CHỦ SỞ HỮU	(1)	(2)	(3)
1	Vốn đầu tư của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	600.000.000.000		
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	3.893.448.265		
6	Quỹ dự phòng tài chính	4.029.118.053		
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	61.404.956.592		
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		745.634.280	2.754.561.032
1A	Tổng			671.336.449.662
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			
2	Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn			
III	Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác			
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			-

1-010
C
TRÁCH
HÀNG
A
KIẾN
9
PH
G KI
ĐUC
TÂN

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNGTầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính**

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
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		772.222.220	
6	Dự phòng phải thu ngắn hạn khó đòi			
IV	Hàng tồn kho		-	
V	Tài sản ngắn hạn khác			
1	Chi phí trả trước ngắn hạn		583.157.918	
2	Thuế GTGT được khấu trừ			
3	Thuế và các khoản phải thu Nhà nước			
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		1.491.336.350	
1B	Tổng			2.846.716.488
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			
	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			

11105
CÔNG TY
KIỂM HỮU HẠ
KIỂM TOÁN
SC
TP. HÀ NỘI
Y
IN
TOÁN
NG
T. 9

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG

Tầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

I. BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

STT	NỘI DUNG	VỐN KHẢ DỤNG		
		Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
II	Tài sản cố định		6.950.511.429	
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 tại 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		9.079.737.630	
	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		-	
1C	Tổng			16.030.249.059
VỐN KHẢ DỤNG = 1A-1B-1C				652.459.484.115



CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNGTầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính**

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A RỦI RO THỊ TRƯỜNG			
		Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro
Các hạng mục đầu tư		(1)	(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%	16.411.672.022
2	Các khoản tương đương tiền, tiền gửi có kỳ hạn	0%	40.782.222.220
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 cuống phiếu		
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%	-
	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%	-

Đ. N. - P.
TRÁI
HÀNG
A.
TÂN KIẾN

10
CƠ
CƠ
ĐẠI
X

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNGTầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính**

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

A RỦI RO THỊ TRƯỜNG				
		Hệ số rủi ro	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
Các hạng mục đầu tư		(1)	(2)	(3) = (1) x (2)
IV	Cổ phiếu			2.765.135.720
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%	11.736.697.400	1.173.669.740
9	Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội	15%	10.609.057.600	1.591.358.640
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%	536.700	107.340
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	14%	-	-
VI	Chứng khoán bị hạn chế giao dịch			965.000
15	Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch	40%	-	-
16	Chứng khoán bị hủy niêm yết, hủy giao dịch	50%	1.930.000	965.000
VII	Các tài sản khác			-
17	Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác	80%	-	-
18	Các tài sản đầu tư khác	80%	-	-
VIII	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)			-
	Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
1	...	0%	-	-
2	...	0%	-	-
3	...	0%	-	-
A	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)			2.766.100.720

30
CƠ
NH
KI
18
TP
C
IG
PH
K
DU
AI

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG

Tầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân,
Hà Nội

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính
Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

B		RỦI RO THANH TOÁN						Tổng giá trị rủi ro
Loại hình giao dịch		Giá trị rủi ro						
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
I		Rủi ro trước thời hạn thanh toán						2.627.911.145
1	Tiền gửi có 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	-	9.257.600	-	-	2.458.385.833	160.267.712	2.627.911.145
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 ký quỹ (cho khách hàng vay mua chứng khoán)/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất	-	-	-	-	-	-	-
II		Rủi ro quá thời hạn thanh toán						274.970.400.281
Thời gian quá hạn		Hệ số 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%						-
3	31 – 60 ngày sau thời hạn thanh toán, chuyển giao chứng khoán	48%						-
4	Từ 60 ngày trở đi	100%						274.970.400.281
III		Rủi ro tăng thêm (nếu có)						-
B		TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)						277.598.311.426

12
CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG
HÀ NỘI

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN ĐẠI DƯƠNG

Tầng 2, Tòa nhà VNT, 19 Nguyễn Trãi, Thanh Xuân, Hà
Nội

Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại thời điểm ngày 30 tháng 06 năm 2016

II. BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

C	RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG)	Giá trị rủi ro
I	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	225.983.026.504
II	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	162.147.846.421
	1. Chi phí khấu hao	3.574.767.000
	2. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	127.436.142
	3. Dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
	4. Dự phòng phải thu khó đòi	158.445.643.279
III	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I – II)	63.835.180.083
IV	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	15.958.795.021
V	20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	60.000.000.000
C	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max {IV, V})	60.000.000.000
D	TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)	340.364.412.146

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	2.766.100.720	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	277.598.311.426	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	60.000.000.000	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3)	340.364.412.146	
5	Vốn khả dụng	652.459.484.115	
6	Tỷ lệ Vốn khả dụng (6=5/4)	191,69%	


Vũ Thị Thanh Hằng
Kế toán trưởng


Lại Thị Sen
Trưởng bộ phận Kiểm soát nội bộ


Vũ Hồng Sơn
Tổng Giám đốc

Hà Nội, ngày 12 tháng 08 năm 2016