

Công ty chứng khoán Trí Việt

Địa chỉ: Tầng 2, số 142 Đội Cấn, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

Điện thoại: Fax:

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH THÁNG 03/2018

Thông tư số 87/2017/TT-BTC

| STT | Nội dung | Tên sheet |
|------|---|------------|
| I | Bảng tính vốn khả dụng | I_06101 |
| II.A | Bảng tính giá trị rủi ro (rủi ro thị trường) | II.A_06102 |
| II.B | Bảng tính giá trị rủi ro (rủi ro thanh toán) | II.B_06104 |
| II.C | Bảng tính giá trị rủi ro (rủi ro hoạt động) | II.C_06107 |
| III | Bảng tổng hợp các chỉ tiêu rủi ro và vốn khả dụng | III_06045 |

Ghi chú

Không đổi tên sheet

Những chỉ tiêu không có số liệu có thể không phải trình bày nhưng không được đánh lại "Mã chỉ tiêu".

Không xóa cột trên sheet

Kế toán trưởng

(Ký, họ tên)

Nguyễn Thị Hồng Trung

Trưởng bộ phận kiểm soát nội bộ

(Ký, họ tên)

Nguyễn Thị Huệ

Lập, ngày 10 tháng 03 năm 2018

K.T. Tổng Giám đốc

Giám đốc khối kiểm soát tuân thủ

(Ký, họ tên, đóng dấu)

CÔNG TY CHỨNG KHOÁN

CỔ PHẦN

TRÍ VIỆT

QUẬN BA ĐÌNH, THÀNH PHỐ HÀ NỘI

Nguyễn Trung Kiên

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

| NỘI DUNG | Mã chi tiêu | VKD | Vốn khả dụng | |
|--|-------------|-----------------|----------------------|------------------------|
| | | | Khoản giảm trừ | Khoản tăng thêm |
| A - Nguồn vốn chủ sở hữu | 6175 | | | |
| 1. Vốn góp của chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có) | 6176 | 150,200,000,000 | | |
| 2. Thặng dư vốn cổ phần, vốn khác không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có) | 6177 | | | |
| 3. Cổ phiếu quỹ | 6178 | | | |
| 4. Quyền chọn chuyển đổi trái phiếu - Cấu phần vốn | 6179 | | | |
| 5. Vốn khác của chủ sở hữu | 6180 | | | |
| 6. Chênh lệch đánh giá tài sản theo giá trị hợp lý | 6181 | | | |
| 7. Quỹ dự trữ bổ sung vốn điều lệ | 6182 | 953,442,750 | | |
| 8. Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ | 6183 | 953,442,750 | | |
| 9. Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu | 6184 | | | |
| 10. Lợi nhuận chưa phân phối | 6185 | 15,667,609,375 | | |
| 11. Số dự phòng suy giảm giá trị tài sản | 6186 | | | |
| 12. Chênh lệch đánh giá lại tài sản cố định | 6187 | | | |
| 13. Chênh lệch tỷ giá hối đoái | 6188 | | | |
| 14. Các khoản nợ có thể chuyển đổi | 6189 | | | |
| 15. Toàn bộ phần giảm đi hoặc tăng thêm của các chứng khoán tại chi tiêu đầu tư tài chính | 6190 | | 51,349,567 | 1,803,669 |
| 16. Vốn khác (nếu có) | 6191 | | | |
| IA - Tổng | 6192 | | | 167,827,648,111 |
| B - Tài sản ngắn hạn | 6193 | | | |
| I. Tài sản tài chính | 6194 | | 9,104,995,785 | |
| 1. Tiền và các khoản tương đương tiền | 6195 | | | |
| 2. Các tài sản tài chính ghi nhận thông qua lãi/lỗ (FVTPL) | 6196 | | | |
| <i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường</i> | 6197 | | | |
| <i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng</i> | 6198 | | | |
| 3. Các khoản đầu tư nắm giữ đến ngày đáo hạn (HTM) | 6199 | | | |
| <i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường</i> | 6200 | | | |
| <i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng</i> | 6201 | | | |
| 4. Các khoản cho vay | 6202 | | | |
| 5. Tài sản tài chính sẵn sàng để bán (AFS) | 6203 | | | |
| <i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường</i> | 6204 | | | |
| <i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng</i> | 6205 | | 7,353,843 | |
| 6. Dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính và tài sản thế chấp | 6206 | | | |
| 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) | 6207 | | | |
| <i>Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống</i> | 6208 | | | |
| <i>Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày</i> | 6209 | | 1,023,777,779 | |

| | | | |
|--|-------------|--|-----------------------|
| 8. Chứng quyền có bảo đảm chưa phát hành hết | 6210 | | |
| 9. Chứng khoán cơ sở phục vụ mục đích phòng ngừa rủi ro khi phát hành chứng quyền có bảo đảm | 6211 | | |
| 10. Phải thu các dịch vụ công ty chứng khoán cung cấp | 6212 | | |
| Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống | 6213 | | |
| Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày | 6214 | | 573.806,770 |
| 11. Phải thu nội bộ | 6215 | | |
| Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống | 6216 | | |
| Phải thu nội bộ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày | 6217 | | |
| 12. Phải thu về lỗi giao dịch chứng khoán | 6218 | | |
| Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống | 6219 | | |
| Các khoản phải thu có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày | 6220 | | |
| 13. Các khoản phải thu khác | 6221 | | |
| Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống | 6222 | | |
| Phải thu khác có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày | 6223 | | 7.500,057,393 |
| 14. Dự phòng suy giảm giá trị các khoản phải thu | 6224 | | |
| 6225 | | | 4.142,982,899 |
| 6226 | | | |
| 6227 | | | |
| 6228 | | | 3.583,313,233 |
| 6229 | | | |
| 6230 | | | 439,872,654 |
| 6231 | | | 98.543,870 |
| 6232 | | | 21,253,142 |
| 6233 | | | |
| 6234 | | | |
| 6235 | | | |
| IB - Tổng | 6236 | | 13,247,978,684 |
| C - Tài sản dài hạn | 6237 | | |
| I. Tài sản tài chính dài hạn | | | 22,000,000,000 |
| 1. Các khoản phải thu dài hạn | 6238 | | |
| 2. Các khoản đầu tư | 6239 | | |
| 2.1 Các khoản đầu tư nắm giữ đến ngày đáo hạn | 6240 | | |
| Các khoản tiềm ẩn rủi ro thị trường | 6241 | | |
| 6242 | | | |
| Các khoản bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng | 6243 | | |
| 6244 | | | |
| 2.2. Đầu tư vào công ty con | 6245 | | |
| 2.3 Đầu tư vào công ty liên doanh, liên kết | 6246 | | 22,000,000,000 |
| 2.4. Đầu tư dài hạn khác | 6247 | | 1,734,641,024 |
| II. Tài sản cố định | 6248 | | |
| III. Bất động sản đầu tư | 6249 | | 2,000,000,000 |
| IV. Chi phí xây dựng cơ bản dở dang | 6250 | | 3,752,997,618 |
| V. Tài sản dài hạn khác | | | |

| | | | | |
|--|------|--|------------------------|--|
| 1. Cầm cổ, thế chấp, ký quỹ, ký cược dài hạn | 6251 | | 13,000,019 | |
| 2. Chi phí trả trước dài hạn | 6252 | | 77,165,851 | |
| 3. Tài sản thuế thu nhập hoãn lại | 6253 | | | |
| 4. Tiền nộp Quỹ hỗ trợ thanh toán | 6254 | | 3,662,831,748 | |
| 5. Tài sản dài hạn khác | 6255 | | | |
| VI. Dự phòng suy giảm giá trị tài sản dài hạn | 6256 | | - | |
| 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 | | | | |
| IC - Tổng | 6258 | | 29,487,638,642 | |
| D. Tài khoản ký quỹ đảm bảo | 6259 | | | |
| I. Giá trị ký quỹ | 6260 | | | |
| I.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) | 6261 | | | |
| I.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) | 6262 | | | |
| I.3. Khoản ký quỹ bằng tiền và giá trị bảo lãnh thanh toán của ngân hàng khi phát hành chứng quyền có bảo đảm | 6263 | | | |
| 2. Giá trị tài sản bảo đảm cho các nghĩa vụ phải trả có thời hạn còn lại trên 90 ngày | 6264 | | | |
| ID- Tổng | 6265 | | | |
| VỐN KHẢ DỤNG = IA-IB-IC-ID | 6266 | | 125,092,030,785 | |

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

| Các hạng mục đầu tư | Mã chi tiêu | Hệ số rủi ro | | Quy mô rủi ro (2) | Giá trị rủi ro (3) = (1) x (2) |
|--|-------------|--------------|-----|----------------------|-----------------------------------|
| | | (1) | (2) | | |
| A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG | | | | | |
| I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ | | | | | |
| 1. Tiền mặt, tiền gửi ngân hàng không kỳ hạn (VND) | 6267 | | | 55,281,175,779 | - |
| 2. Các khoản tương đương tiền, tiền gửi có kỳ hạn | 6268 | 0% | | 35,281,175,779 | - |
| 3. Giấy tờ có giá, công cụ chuyển nhượng trên thị trường tiền tệ, chứng chỉ tiền gửi | 6269 | 0% | | 20,000,000,000 | - |
| 4. Trái phiếu Chính phủ | 6270 | 0% | | | |
| 5. Trái phiếu Chính phủ không trả lãi | 6271 | | | | |
| 6. Trái phiếu Chính phủ có lãi | 6272 | 0% | | | |
| 5. Trái phiếu Chính phủ trả lãi suất cố định: 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 | 6273 | 3% | | | |
| III. Trái phiếu doanh nghiệp | | | | | |
| 6.1 Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6274 | 8% | | | |
| 6.2 Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 1 đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6275 | 10% | | | |
| 6.3 Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 3 năm đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6276 | 15% | | | |
| 6.4 Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6277 | 20% | | | |
| 7.1 Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn còn lại dưới 1 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6278 | 25% | | | |
| 7.2 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 | 6279 | 30% | | | |
| 7.3 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 | 6280 | 35% | | | |
| 7.4 Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi | 6281 | 40% | | | |
| 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 | 6282 | 10% | | 17,254,820 | 2,475,737 |
| 9. Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của các tổ chức niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội | 6283 | 15% | | 3,182,320 | 318,232 |
| 10. Cổ phiếu phổ thông, cổ phiếu ưu đãi của công ty đại chúng chưa niêm yết, đang ký giao dịch qua hệ thống UpCom | 6284 | 20% | | 13,139,900 | 1,970,985 |
| 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) | 6285 | 30% | | 932,600 | 186,520 |
| 12. Cổ phiếu của các công ty đại chúng khác | 6286 | 50% | | | |
| | 6287 | | | | |
| | 6288 | | | | |

| | | | | |
|---|------|----------------------|----------------------|------------------|
| V. Chứng chỉ quỹ đầu tư chứng khoán | | | | |
| 13. Quỹ đại chúng bao gồm cả công ty đầu tư chứng khoán đại chúng | 6289 | | | |
| 14. Quỹ thành viên, công ty đầu tư chứng khoán riêng lẻ | 6290 | 10% | | |
| VI. Chứng khoán bị hạn chế giao dịch | 6291 | 30% | | |
| 15. Chứng khoán bị tạm ngừng giao dịch | 6292 | | | |
| 16. Chứng khoán bị huỷ niêm yết, huỷ giao dịch | 6293 | 40% | | |
| VII. Chứng khoán phái sinh | 6294 | 50% | | |
| 17. Hợp đồng tương lai chỉ số cổ phiếu | 6295 | | | |
| 18. Hợp đồng tương lai trái phiếu chính phủ | 6296 | 8% | | |
| VIII. Các tài sản khác | 6297 | 3% | | |
| 19. Cổ phần, phần vốn góp và các loại chứng khoán khác | 6298 | | | |
| 20. Cổ phiếu niêm yết trên các thị trường nước ngoài thuộc chỉ số đạt chuẩn | 6299 | 80% | | |
| 21. Cổ phiếu niêm yết trên các thị trường nước ngoài không thuộc các chỉ số đạt chuẩn | 6300 | 25% | | |
| | 6301 | 100% | | |
| 22. Chứng quyền có bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh | 6302 | 8% | | |
| 23. Chứng quyền có bảo đảm niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội | 6303 | 10% | | |
| 24. Chứng quyền có bảo đảm do công ty chứng khoán phát hành | 6304 | | | |
| 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) | 6305 | | | |
| 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 | 6306 | | | |
| 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) | 6307 | Mức tăng thêm | Quy mô rủi ro | GT rủi ro |
| A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII+IX) | 6308 | | | |
| | 6310 | | | 2,475,737 |

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

| Loại hình giao dịch | Mã chỉ tiêu | Giá trị rủi ro | | | | | | Tổng GTRR |
|---|-------------|----------------|---------------|----------------|----------|--------|---------------|-----------|
| | | 0% (1) | 0.8% (2) | 3.2% (3) | 4.8% (4) | 6% (5) | 8% (6) | |
| B. RỦI RO THANH TOÁN | | | | | | | | |
| I. Rủi ro trước thời hạn thanh toán | | | | | | | | |
| 1. Tiền gửi có 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 tiền án rủi ro thanh toán khác | 6314 | | | | | | | |
| | 6315 | | | | | | | |
| 2. Cho vay tài sản tài chính/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất | 6316 | | | | | | | |
| 3. Vay tài sản tài chính/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất | 6317 | | | | | | | |
| 4. Hợp đồng mua tài sản tài chính có cam kết bán lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất | 6318 | | | | | | | |
| 5. Hợp đồng bán tài sản tài chính có cam kết mua lại/Các thỏa thuận kinh tế có cùng bản chất | 6319 | | | | | | | |
| | 6320 | | | | | | | |
| TỔNG RỦI RO TRƯỚC THỜI HẠN THANH TOÁN | | | | | | | | |
| | | Hệ số RR | Quy mô RR | Giá trị RR | | | | |
| | 6321 | | | | | | | |
| | 6322 | 16% | | | | | | |
| | 6323 | 32% | | | | | | |
| | 6324 | 48% | | | | | | |
| | 6325 | 100% | 5,164,053,630 | 5,164,053,630 | | | | |
| TỔNG RỦI RO QUÁ THỜI HẠN THANH TOÁN | | | | | | | | |
| | | Hệ số RR | Quy mô rủi ro | Giá trị rủi ro | | | | |
| | 6326 | | | | | | | |
| | 6327 | 10% | 1,200,000,000 | 120,000,000 | | | | |
| | 6328 | | | | | | | |
| | 6329 | | | | | | | |
| | 6330 | | | | | | | |
| TỔNG RỦI RO TĂNG THÊM | | | | | | | | |
| | | Hệ số RR | Quy mô rủi ro | Giá trị rủi ro | | | | |
| | 6326 | | | | | | | |
| | 6327 | 10% | 1,200,000,000 | 120,000,000 | | | | |
| | 6328 | | | | | | | |
| | 6329 | | | | | | | |
| | 6330 | | | | | | | |
| B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III) | | | | | | | | |
| | | | | | | | 2,558,382,285 | |
| | | | | | | | 2,558,382,285 | |

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

| Chỉ tiêu | Mã chỉ tiêu | Giá trị |
|---|-------------|-----------------------|
| C. RỦI RO HOẠT ĐỘNG (TÍNH TRONG VÒNG 12 THÁNG) | 6331 | |
| I. Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng tính tới tháng 02 năm 2018 | 6332 | 19,593,447,764 |
| II. Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí | 6333 | 486,569,651 |
| 1. Chi phí khấu hao | 6334 | 486,743,821 |
| 2. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng suy giảm giá trị các tài sản tài chính và tài sản thế chấp | 6335 | (174,170) |
| 3. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng suy giảm giá trị tài sản tài chính dài hạn | 6336 | |
| 4. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng suy giảm giá trị các khoản phải thu | 6337 | |
| 4. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng suy giảm giá trị tài sản ngắn hạn khác | 6339 | 19,106,878,113 |
| III. Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II) | 6340 | 4,776,719,528 |
| IV. 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III) | 6341 | 7,000,000,000 |
| V. 20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán | 6342 | 7,000,000,000 |
| C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max {IV, V}) | | 14,844,911,652 |
| D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C) | 6343 | |

BẢNG TỔNG HỢP CÁC CHỈ TIÊU RỦI RO VÀ VỐN KHẢ DỤNG

| Các chỉ tiêu | Giá trị rủi ro/ Vốn khả dụng | Ghi chú |
|-----------------------------------|------------------------------|---------|
| 1. Tổng giá trị rủi ro thị trường | 2,475,737 | |
| 2. Tổng giá trị rủi ro thanh toán | 7,842,435,915 | |
| 3. Tổng giá trị rủi ro hoạt động | 7,000,000,000 | |
| 4. Tổng giá trị rủi ro (4=1+2+3) | 14,844,911,652 | |
| 5. Vốn khả dụng | 125,092,030,785 | |
| 6. Tỷ lệ Vốn khả dụng (6=5/4) | 842.66% | |