

**CÔNG TY CỔ PHẦN
QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI**

**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được soát xét
tại ngày 30 tháng 6 năm 2018**



MỤC LỤC

	Trang
BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC	1 - 2
BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ	3
BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC SOÁT XÉT	4 - 12

2
VG
PH
LN
SÁ
G
- 1

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

Ban Giám đốc hân hạnh đệ trình báo cáo này cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2018 đã được soát xét của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI.

1. Thông tin chung

Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI ("Công ty") là công ty cổ phần được thành lập tại Việt Nam và hoạt động theo Giấy phép thành lập và hoạt động số 42/UBCK-GP ngày 29 tháng 10 năm 2008 và các quyết định điều chỉnh do Ủy ban chứng khoán Nhà nước cấp:

<u>Quyết định số</u>	<u>Ngày cấp</u>	<u>Nội dung điều chỉnh</u>
50/UBCK-GP	12/08/2009	Tăng vốn điều lệ
168/QĐ-UBCK	15/03/2010	Lập văn phòng đại diện tại TP. Hồ Chí Minh
724/QĐ-UBCK	03/10/2011	Thay đổi, bổ sung về địa chỉ văn phòng đại diện của Công ty
16/GPĐC-UBCK	03/10/2011	Thay đổi địa chỉ trụ sở chính và người đại diện theo pháp luật
37/GPĐC-UBCK	19/12/2013	Thay đổi người đại diện theo pháp luật
02/GPĐC-UBCK	13/01/2014	Tăng vốn điều lệ
15/GPĐC-UBCK	23/10/2014	Bổ sung nghiệp vụ kinh doanh "Tư vấn đầu tư chứng khoán"
858/QĐ-UBCK	15/08/2016	Chấp nhận giao dịch làm thay đổi tỷ lệ sở hữu chiếm từ 10% trở lên vốn điều lệ của Công ty
879/QĐ-UBCK	22/08/2016	Thay đổi về người đại diện và địa chỉ văn phòng đại diện của Công ty

Trụ sở chính của Công ty được đặt tại Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội.

Công ty có văn phòng đại diện đặt tại Lầu 3A, Tòa nhà TNG Global, 12 Phạm Đình Toái, Phường 6, Quận 3, TP. Hồ Chí Minh.

Hoạt động chính của Công ty trong kỳ tài chính kết thúc ngày 30 tháng 6 năm 2018 là quản lý danh mục đầu tư chứng khoán và kinh doanh chứng khoán.

Vốn điều lệ: 60.000.000.000 đồng (sáu mươi tỷ đồng Việt Nam).

Cơ cấu sở hữu của cổ đông:

<u>Tên cổ đông</u>	<u>Giá trị VND</u>	<u>Tỷ lệ sở hữu (%)</u>
Công ty cổ phần Đầu tư Sài Gòn	1.350.000.000	2,25
Ông Đặng Thành Tâm	2.060.000.000	3,43
Ông Nguyễn Cao Hữu Trí	4.950.000.000	8,25
Bà Ngô Thị Minh Tuyền	5.000.000.000	8,33
Ông Lê Chí Phúc	5.000.000.000	8,33
Ông Phan Anh Tuấn	9.610.000.000	16,02
Ông Trần Ngọc Diệp	32.030.000.000	53,39
Cộng	60.000.000.000	100,00

2. Hội đồng quản trị và Ban Giám đốc

Hội đồng quản trị và Ban Giám đốc trong kỳ tài chính này và cho đến ngày lập báo cáo này bao gồm:

Hội đồng quản trị

	<u>Chức vụ</u>	<u>Ngày bổ nhiệm</u>
Ông Nguyễn Cao Hữu Trí	Chủ tịch	30/06/2016
Ông Nguyễn Sơn	Thành viên	30/06/2016
Ông Lê Chí Phúc	Thành viên/ Tổng Giám đốc	30/06/2016

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI
Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội
BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC

Hội đồng quản trị và Ban Giám đốc (tiếp theo)

Ban Giám đốc

	<u>Chức vụ</u>	<u>Ngày bổ nhiệm</u>
Ông Lê Chí Phúc	Tổng Giám đốc	06/09/2013

3. Kiểm toán viên

Công ty TNHH Kiểm toán AFC Việt Nam được chỉ định là kiểm toán viên thực hiện soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI tại ngày 30 tháng 6 năm 2018.

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

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính và đảm bảo Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý về tình hình tài chính tại ngày 30 tháng 6 năm 2018, phù hợp với chuẩn mực kế toán Việt Nam, chế độ kế toán công ty quản lý quỹ Việt Nam và các quy định của Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 8 năm 2017 có liên quan đến việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính. Để lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này, Ban Giám đốc Công ty được yêu cầu:

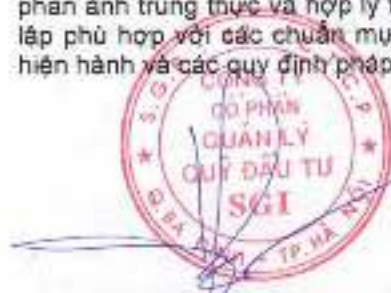
- Lựa chọn phù hợp và áp dụng nhất quán các chính sách kế toán; và
- Thực hiện các xét đoán và ước tính một cách hợp lý và thận trọng.

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm đảm bảo số kế toán được ghi chép đầy đủ, phản ánh trung thực và hợp lý tình hình tài chính của Công ty và đảm bảo Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty tuân thủ các chuẩn mực kế toán doanh nghiệp Việt Nam, chế độ kế toán công ty quản lý quỹ Việt Nam hiện hành và các quy định pháp lý có liên quan đến việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

Ban Giám đốc Công ty cam kết rằng đã tuân thủ các yêu cầu nêu trên trong việc lập Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

5. Công bố Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính

Chúng tôi công bố Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đính kèm. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính này phản ánh trung thực và hợp lý tình hình tài chính của Công ty tại ngày 30 tháng 6 năm 2018, được lập phù hợp với các chuẩn mực kế toán Việt Nam, chế độ kế toán công ty quản lý quỹ Việt Nam hiện hành và các quy định pháp lý có liên quan.



LÊ CHÍ PHÚC
Tổng Giám đốc

Thành phố Hà Nội, ngày 04 tháng 9 năm 2018



Số: 116C/2018/BCSX-HCM.00617

BÁO CÁO SOÁT XÉT THÔNG TIN TÀI CHÍNH GIỮA NIÊN ĐỘ

**Kính gửi: Quý cổ đông, Hội đồng quản trị và Ban Giám đốc
Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI**

Chúng tôi đã soát xét Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính kèm theo của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI (gọi tắt là "Công ty"), được lập ngày 04 tháng 9 năm 2018, từ trang 04 đến trang 12. Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính được lập theo quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 8 năm 2017 của Bộ Tài chính 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 Giám đốc

Ban Giám đốc Công ty chịu trách nhiệm về việc lập và trình bày trung thực và hợp lý Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty theo chuẩn mực kế toán, chế độ kế toán công ty quản lý quỹ Việt Nam và các quy định pháp lý có liên quan đến việc lập và trình Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính và chịu trách nhiệm về kiểm soát nội bộ mà Ban Giám đốc Công ty xác định là cần thiết để đảm bảo cho 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 tài chính của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI tại ngày 30 tháng 6 năm 2018, phù hợp với quy định tại Thông tư số 87/2017/TT-BTC ngày 15 tháng 8 năm 2017 của Bộ Tài chính 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.

Báo cáo này được phát hành để thay thế cho Báo cáo soát xét thông tin tài chính giữa niên độ số 116B/2018/BCSX-HCM.00617 ngày 05 tháng 8 năm 2018.



TRANG ĐẶC NHA
Phó Tổng Giám đốc
Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 2111-2018-009-1
CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN AFC VIỆT NAM
TP. Hồ Chí Minh, ngày 04 tháng 9 năm 2018

NGUYỄN NGỌC THỦY DUNG
Kiểm toán viên
Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 2782-2014-009-1

BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH

Tại ngày 30 tháng 6 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 15/08/2017 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 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.



CAO THỊ KIM NHÂN
Kế toán trưởng



MAI HỮU ĐẠT
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



LÊ CHÍ PHÚC
Tổng Giám đốc
Thành phố Hà Nội, ngày 04 tháng 9 năm 2018

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
	Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
A NGUỒN VỐN			
1 Vốn chủ sở hữu không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	60.000.000.000	-	-
2 Thặng dư vốn cổ phần không bao gồm cổ phần ưu đãi hoàn lại (nếu có)	-	-	-
3 Cổ phiếu quỹ	-	-	-
4 Quỹ dự trữ bổ sung vốn điều lệ (nếu có)	-	-	-
5 Quỹ đầu tư phát triển (nếu có)	-	-	-
6 Quỹ dự phòng tài chính và rủi ro nghiệp vụ	-	-	-
7 Quỹ khác thuộc vốn chủ sở hữu	-	-	-
8 Lợi nhuận sau thuế chưa phân phối	(25.245.234.648)	-	-
9 Số dư dự phòng suy giảm giá trị tài sản	1.809.114.994	-	-
10 Chênh lệch đánh giá lại tài sản cố định	-	-	-
11 Chênh lệch tỷ giá hối đoái	-	-	-
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	-	1.809.114.994	111.227.580
14 Vốn khác (nếu có)	-	-	-
1A Tổng			34.865.992.732
B TÀI SẢN NGẮN HẠN			
<i>I Tiền và các khoản tương đương tiền</i>	-	-	-
<i>II Các khoản đầu tư tài chính ngắn hạn</i>	-	-	-
1. Đầu tư ngắn hạn	-	-	-
<i>Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9</i>	-	-	-
<i>Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định khoản 5 Điều 6</i>	-	-	-
2. Dự phòng giảm giá đầu tư ngắn hạn	-	-	-
<i>III Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác</i>	-	321.891.145	-
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	-	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
	Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
3. Phải thu hoạt động nghiệp vụ	-	321.891.145	-
Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại từ 90 ngày trở xuống	-	-	-
Phải thu hoạt động nghiệp vụ có thời hạn thanh toán còn lại trên 90 ngày	-	321.891.145	-
4. 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	-	-	-
5. 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	-	-	-
6. 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	-	-	-
7. Dự phòng phải thu ngắn hạn khó đòi	-	-	-
IV Hàng tồn kho	-	-	-
V Tài sản ngắn hạn khác	-	23.261.504	-
1. Chi phí trả trước ngắn hạn	-	6.841.000	-
2. Thuế GTGT được khấu trừ	-	-	-
3. Thuế và các khoản phải thu nhà nước	-	-	-
4. Tài sản ngắn hạn khác	-	16.420.504	-
4.1 Tạm ứng	-	7.470.504	-
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	-	7.470.504	-
4.2 Phải thu khác, tài sản ngắn hạn khác	-	8.950.000	-
1B Tổng			345.152.649

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH VỐN KHẢ DỤNG

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT NỘI DUNG	Vốn khả dụng		
	Vốn khả dụng	Khoản giảm trừ	Khoản tăng thêm
C TÀI SẢN DÀI HẠN			
<i>I Các khoản phải thu dài hạn</i>	-	-	-
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	-	-	-
1.5 Dự phòng phải thu dài hạn khó đòi	-	-	-
<i>II Tài sản cố định</i>	-	-	-
<i>III Bất động sản đầu tư</i>	-	-	-
<i>IV Các khoản đầu tư tài chính dài hạn</i>	-	-	-
1. Đầu tư vào công ty con	-	-	-
2. Vốn góp liên doanh	-	-	-
3. Đầu tư vào công ty liên kết, liên doanh	-	-	-
4. Đầu tư chứng khoán dài hạn	-	-	-
Chứng khoán tiềm ẩn rủi ro thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 9	-	-	-
Chứng khoán bị giảm trừ khỏi vốn khả dụng theo quy định tại khoản 5 Điều 6	-	-	-
5. Các khoản đầu tư dài hạn ra nước ngoài	-	-	-
6. Đầu tư dài hạn khác	-	-	-
7. Dự phòng giảm giá đầu tư tài chính dài hạn	-	-	-
V Tài sản dài hạn khác	-	324.187.270	-
1. Chi phí trả trước dài hạn	-	58.479.590	-
2. Tài sản thuế thu nhập hoãn lại	-	-	-
3. Ký quỹ, ký cược dài hạn	-	265.707.680	-
<i>Các chỉ tiêu tài sản</i> bị coi là khoản ngoại trừ tại báo cáo tài chính năm đã được kiểm toán, soát xét mà không bị tính giảm trừ theo quy định tại Điều 6	-	-	-
1C Tổng			324.187.270
VỐN KHẢ DỤNG = 1A-1B-1C			34.196.652.813

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG

Các hạng mục đầu tư

Hệ số rủi ro
(1)

Quy mô rủi ro
(2)

Giá trị rủi ro
(3)= (1)x(2)

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%	18.864.751.661	-
2. Các khoản tương đương tiền	0%	-	-
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%	-	-
6. 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, ADB, 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 từ 1 tới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	10%	-	-
Trái phiếu niêm yết có thời gian đáo hạn từ 3 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 đến dưới 3 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	30%	-	-
Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 3 đến dưới 5 năm, kể cả trái phiếu chuyển đổi	35%	-	-
Trái phiếu không niêm yết có thời gian đáo hạn từ 5 năm trở lên, kể cả trái phiếu chuyển đổi	40%	-	-

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 801, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG

IV. Cổ phiếu

1.626.421.855

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%	16.264.218.550	1.626.421.855
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 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%	-	-

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. 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)

279.256.000

Mã chứng khoán	Mức tăng thêm	Quy mô rủi ro	Giá trị rủi ro
MBB	20%	628.800.000	125.760.000
HPG	20%	564.480.000	112.896.000
VCB	10%	406.000.000	40.600.000

A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII)

1.905.677.855

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

B. RỦI RO THANH TOÁN

Loại hình giao dịch

	Giá trị rủi ro						Tổng giá trị rủi ro
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	
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 và các khoản phải thu từ hoạt động giao dịch và nghiệp vụ kinh doanh chứng khoán	-	-	-	-	-	-	-
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 kỳ 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							-
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%	-	-	-	-	-	-
III. Rủi ro tăng thêm (nếu có)							-
Chỉ tiết tới từng khoản vay, tới từng đối tác	Mức tăng thêm						Giá trị rủi ro
B. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THANH TOÁN (B=I+II+III)							-

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

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

I.	Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng	24.241.911.333
II.	Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí	1.809.114.994
	1. Chi phí khấu hao	-
	2. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn	1.809.114.994
	3. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng giảm giá đầu tư chứng khoán dài hạn	-
	4. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng phải thu khó đòi	-
III.	Tổng chi phí sau khi giảm trừ (III = I - II)	22.432.796.339
IV.	25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III)	5.608.199.085
V.	20% Vốn pháp định của tổ chức kinh doanh chứng khoán	5.000.000.000
C. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO HOẠT ĐỘNG (C=Max (IV, V))		5.608.199.085
D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C)		7.513.876.940

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI


Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội


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

Ngày 30 tháng 6 năm 2018

Đơn vị tính: VND

STT	Các chỉ tiêu	Giá trị rủi ro/ vốn khả dụng	Ghi chú
1	Tổng giá trị rủi ro thị trường	1.905.677.855	
2	Tổng giá trị rủi ro thanh toán	-	
3	Tổng giá trị rủi ro hoạt động	5.608.199.085	
4	Tổng giá trị rủi ro (4=1+2++3)	7.513.876.940	
5	Vốn khả dụng	34.196.652.813	
6	Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4)	455%	


CAO THỊ KIM NHẬN
Kế toán trưởng


MAI HỮU ĐẠT
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ


LÊ CHÍ PHỤC
Tổng Giám đốc
Thành phố Hà Nội, ngày 04 tháng 9 năm 2018