

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

**Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã được kiểm toán
tại ngày 31 tháng 12 năm 2017**



MỤC LỤC

| | Trang |
|--|--------|
| BÁO CÁO CỦA BAN GIÁM ĐỐC | 1 – 2 |
| BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP | 3 – 4 |
| BÁO CÁO TỶ LỆ AN TOÀN TÀI CHÍNH ĐÃ ĐƯỢC KIỂM TOÁN | 5 – 13 |

CÔNG
CỔ
QUỸ
ĐÌNH

3448
CÔNG
NHỆM
HÀ TO
VIỆT
HỒ

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 đề trình báo cáo này cùng với Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính tại ngày 31 tháng 12 năm 2017 đã được kiểm toán 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 năm tài chính kết thúc ngày 31 tháng 12 năm 2017 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 năm 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 |

GT
 CHẤP
 NHẬN
 ĐẦU
 TƯ
 SGI

PPS-C
 TY
 TƯ
 ĐẦU
 TƯ
 SGI
 CHỈ
 MÃ

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 kiểm toán Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI tại ngày 31 tháng 12 năm 2017.

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 31 tháng 12 năm 2017, 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 sổ 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 31 tháng 12 năm 2017, 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 05 tháng 3 năm 2018

QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

Đ. NH. - TP. HÀ NỘI



Số: 115B/2018/BCKT-HCM.00617

BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP

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 kiểm toán 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 05 tháng 3 năm 2018, từ trang 05 đến trang 13. 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 ý kiến về Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính dựa trên kết quả của cuộc kiểm toán. Chúng tôi đã tiến hành kiểm toán theo các chuẩn mực kiểm toán Việt Nam. Các chuẩn mực này yêu cầu chúng tôi tuân thủ chuẩn mực và các quy định về đạo đức nghề nghiệp, lập kế hoạch và thực hiện cuộc kiểm toán để đạt được sự đảm bảo hợp lý về việc liệu Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính của Công ty có còn sai sót trọng yếu hay không.

Công việc kiểm toán bao gồm thực hiện các thủ tục nhằm thu thập các bằng chứng kiểm toán về các số liệu trên Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính. Các thủ tục kiểm toán được lựa chọn dựa trên xét đoán của kiểm toán viên, bao gồm đánh giá rủi ro có sai sót trọng yếu trọng Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính do gian lận hoặc nhầm lẫn. Khi thực hiện đánh giá các rủi ro này, kiểm toán viên đã xem xét kiểm soát nội bộ của Công ty liên quan đến việc lập và trình bày Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính trung thực, hợp lý nhằm thiết kế các thủ tục kiểm toán phù hợp với tình hình thực tế, tuy nhiên không nhằm mục đích đưa ra ý kiến về hiệu quả của kiểm soát nội bộ của Công ty. Công việc kiểm toán cũng bao gồm đánh giá tính thích hợp của các chính sách kế toán được áp dụng và tính hợp lý của các ước tính kế toán của Ban Giám đốc cũng như đánh giá việc trình bày tổng thể Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính.

Chúng tôi tin tưởng rằng các bằng chứng kiểm toán mà chúng tôi đã thu thập được là đầy đủ và thích hợp làm cơ sở cho ý kiến kiểm toán của chúng tôi.



BÁO CÁO KIỂM TOÁN ĐỘC LẬP (tiếp theo)

Ý kiến của kiểm toán viên

Theo ý kiến của chúng tôi, Báo cáo tỷ lệ an toàn tài chính đã phản ánh trung thực và hợp lý, trên các khía cạnh trong yếu tình hình tài chính của Công ty cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư SGI tại ngày 31 tháng 12 năm 2017, 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.



BUI TUYẾT VÂN

Phó Tổng Giám đốc

Số Giấy CN ĐKHN kiểm toán: 0071-2018-009-1

CÔNG TY TNHH KIỂM TOÁN AFC VIỆT NAM

TP. Hồ Chí Minh, ngày 05 tháng 3 năm 2018

A handwritten signature in blue ink, appearing to read "NGUYỄN NGỌC THỦY DUNG".

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 31 tháng 12 năm 2017

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 NHẬN
Kế toán trưởng



MAI HỮU ĐẠT
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ



LÊ CHÍ PHÚC
Tổng Giám đốc
Thành phố Hà Nội, ngày 05 tháng 3 năm 2018



CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ SGI

M.S.O.A
QUẢN LÝ
HÀ NỘI

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 31 tháng 12 năm 2017

| STT | NỘI DUNG | Vốn khả dụng | | |
|-----------|---|-----------------|----------------|-----------------------|
| | | VKD | 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 | (8.665.860.350) | - | - |
| 9 | Số dự dự phòng suy giảm giá trị tài sản | - | - | - |
| 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 | - | 391.728.002 | 1.262.210.296 |
| 14 | Vốn khác (nếu có) | - | - | - |
| 1A | Tổng | | | 62.204.621.944 |
| B | TÀI SẢN NGẮN HẠN | | | |
| I | <i>Tiền và các khoản tương đương tiền</i> | - | - | - |
| II | <i>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 | - | - | - |
| III | <i>Các khoản phải thu ngắn hạn, kể cả phải thu từ hoạt động ủy thác</i> | - | - | - |
| 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 | - | - | - |

A2
NG
PH
AN
ĐA
G

3.300
CỔ
HÀNG
KIỂM
AFC
VJ-T

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 31 tháng 12 năm 2017

| STT | NỘI DUNG | Vốn khả dụng | | |
|-----------|--|--------------|-------------------|-------------------|
| | | VKD | Khoản giảm trừ | Khoản tăng thêm |
| 3. | Phải thu hoạt động nghiệp vụ | - | - | - |
| | 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 | - | - | - |
| 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 | - | 10.074.706 | - |
| 1. | Chi phí trả trước ngắn hạn | - | 923.326 | - |
| 2. | Thuế GTGT được khấu trừ | - | - | - |
| 3. | Thuế và các khoản phải thu nhà nước | - | - | - |
| 4. | Tài sản ngắn hạn khác | - | 9.151.380 | - |
| 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 | - | 9.151.380 | - |
| 4.2 | Phải thu khác, tài sản ngắn hạn khác | - | - | - |
| 1B | Tổng | | | 10.074.706 |

CÔNG TY
 QUẢN LÝ
 QUỸ ĐẦU TƯ
 SGI

04896
 NG T
 (M)
 T T O P
 Ệ T N
 HỒ

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 31 tháng 12 năm 2017

| STT | NỘI DUNG | Vốn khả dụng | | |
|------------|--|--------------|--------------------|-----------------|
| | | VKD | Khoản giảm trừ | Khoản tăng thêm |
| C | TÀI SẢN DÀI HẠN | | | |
| <i>I</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</i> | <i>Tài sản cố định</i> | - | - | - |
| <i>III</i> | <i>Bất động sản đầu tư</i> | - | - | - |
| <i>IV</i> | <i>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 | - | - | - |
| | <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 tại khoản 5 Điều 6</i> | - | - | - |
| 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 | - | 346.987.449 | - |
| 1. | Chi phí trả trước dài hạn | - | 85.279.769 | - |
| 2. | Tài sản thuế thu nhập hoãn lại | - | - | - |
| 3. | Ký quỹ, ký cược dài hạn | - | 261.707.680 | - |
| | <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 | | 346.987.449 | |



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 31 tháng 12 năm 2017

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) |
|--|---|---------------------|----------------------|--------------------------------|
| I. Tiền và các khoản tương đương tiền, công cụ thị trường tiền tệ | | | | - |
| 1. | Tiền mặt (VND) | 0% | 22.743.750.068 | - |
| 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% | - | - |
| 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, 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

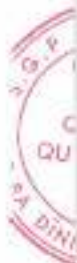
Phòng 601, Tầng 6, Tháp A, Tòa nhà Handi Resco, 521 Kim Mã, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội

BẢNG TÍNH GIÁ TRỊ RỦI RO

Ngày 31 tháng 12 năm 2017

A. RỦI RO THỊ TRƯỜNG

| | | | | 2.929.196.240 |
|---|--|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 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% | 29.291.962.400 | 2.929.196.240 |
| 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) | | | | 878.758.872 |
| | Mã chứng khoán | Mức tăng thêm | Quy mô rủi ro | Giá trị rủi ro |
| | HAG | 30% | 1.342.580.400 | 402.774.120 |
| | HNG | 30% | 1.586.615.840 | 475.984.752 |
| A. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO THỊ TRƯỜNG (A= I+II+III+IV+V+VI+VII+VIII) | | | | 3.807.955.112 |



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 31 tháng 12 năm 2017

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

| | | |
|---|---|----------------------|
| I. | Tổng chi phí hoạt động phát sinh trong vòng 12 tháng | 10.133.810.649 |
| II. | Các khoản giảm trừ khỏi tổng chi phí | 157.142.760 |
| | 1. Chi phí khấu hao | - |
| | 2. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng giám giá đầu tư chứng khoán ngắn hạn | 157.142.760 |
| | 3. Chi phí/ Hoàn nhập dự phòng giám 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) | 9.976.467.889 |
| IV. | 25% Tổng chi phí sau khi giảm trừ (IV = 25% III) | 2.494.116.972 |
| 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)) | | 5.000.000.000 |
| D. TỔNG GIÁ TRỊ RỦI RO (A+B+C) | | 8.807.955.112 |

CÔNG TY
QUẢN LÝ
QUỸ ĐẦU TƯ
S. G. I.

18-C.1
Y
VNAN
M
HÍ SANG


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 31 tháng 12 năm 2017

| STT | Các chỉ tiêu | Giá trị rủi ro/ vốn khả dụng | Ghi chú |
|-----|------------------------------------|---------------------------------|---------|
| 1 | Tổng giá trị rủi ro thị trường | 3.807.955.112 | |
| 2 | Tổng giá trị rủi ro thanh toán | - | |
| 3 | Tổng giá trị rủi ro hoạt động | 5.000.000.000 | |
| 4 | Tổng giá trị rủi ro (4=1+2++3) | 8.807.955.112 | |
| 5 | Vốn khả dụng | 51.847.559.789 | |
| 6 | Tỷ lệ an toàn vốn khả dụng (6=5/4) | 589% | |


CAO THỊ KIM NHẬN
Kế toán trưởng


MAI HỮU ĐẠT
Trưởng bộ phận
Kiểm soát nội bộ


LÊ CHÍ PHÚC
Tổng Giám đốc
Thành phố Hà Nội, ngày 05 tháng 3 năm 2018