

**QUỸ ETF SSIAM VNX50**

Số/No.: 189/2020/TB-SSIAM-NVQ

**CÔNG BỐ THÔNG TIN  
TRÊN CÔNG THÔNG TIN ĐIỆN TỬ  
CỦA ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ  
NƯỚC VÀ SGDCX TP.HCM**

**CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM**

**Độc lập - Tự do - Hạnh phúc**

**THE SOCIALIST REPUBLIC OF VIETNAM**

**Independence - Freedom - Happiness**

*Hà Nội, ngày 27 tháng 03 năm 2020*

*Ha Noi, 27 March 2020*

**DISCLOSURE OF INFORMATION ON  
THE STATE SECURITIES  
COMMISSION'S PORTAL AND  
HOCHIMINH CITY STOCK  
EXCHANGE'S PORTAL**

Kính gửi/ To: Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM/ *Hochiminh City Stock Exchange*

- Tên CTQLQ: Công ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI
- Tên tổ chức / *Organization name*: Quỹ ETF SSIAM VNX50
- Mã chứng khoán/ *Security Symbol*: FUESSV50
- Địa chỉ trụ sở chính/ *Address*: Tầng 5, 1C Ngô Quyền, Quận Hoàn Kiếm, Hà Nội
- Điện thoại/ *Telephone*: 0243.9366321
- Fax: 0243.9366337
- Người thực hiện công bố thông tin/ *Submitted by*: Bà Lê Thị Lệ Hằng  
Chức vụ/ *Position*: Tổng Giám Đốc/ CEO

Loại thông tin công bố :  định kỳ  bất thường  24h  theo yêu cầu

*Information disclosure type*:  *Periodic*  *Irregular*  *24 hours*  *On demand*

**Nội dung thông tin công bố (\*)/ Content of Information disclosure (\*):**

Báo cáo tổng kết hoạt động của Công ty quản lý quỹ cho Quỹ ETF SSIAM VNX50 năm 2019

Operation Report of the year 2019 by SSIAM for SSIAM VNX50 ETF

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của công ty/quỹ vào ngày 27/03/2020 tại đường dẫn : <https://www.ssi.com.vn/ssiam/san-pham-va-dich-vu-ssiam>.

*This information was disclosed on Company/Fund's Portal on date 27/03/2020. Available at: <https://www.ssi.com.vn/ssiam/san-pham-va-dich-vu-ssiam>.*

Tôi cam kết các thông tin công bố trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu trách nhiệm trước pháp luật về nội dung các thông tin đã công bố./

*I declare that all information provided in this paper is true and accurate; I shall be legally responsible for any misrepresentation.*

*Tài liệu đính kèm/*

*Attachment:*

*Báo cáo tổng kết hoạt động của Công ty  
quản lý quỹ cho Quỹ ETF SSLIAM  
VNX50 năm 2019*

*Operation Report of the year 2019 by  
SSIAM for SSLIAM VNX50 ETF*

**Người công bố thông tin  
Publisher**



**TỔNG GIÁM ĐỐC  
Lê Thị Lệ Hằng**



## BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ CHO NĂM 2019 QUỸ ETF SSIAM VNX50

(thực hiện theo mẫu tại Phụ lục 16, ban hành kèm theo Thông tư Số 229/2012/TT-BTC ngày 27 tháng 12 năm 2012 của Bộ Tài Chính hướng dẫn về việc thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)

### 1. THÔNG TIN VỀ QUỸ

a) Tên Quỹ: Quỹ ETF SSIAM VNX50 ("Quỹ")

Loại hình quỹ: Quỹ hoán đổi danh mục

b) Mục tiêu đầu tư của Quỹ

Mục tiêu đầu tư của Quỹ ETF SSIAM VNX50 là hướng tới đạt hiệu quả đầu tư bám sát mức tăng trưởng thực tế của Chỉ Số VNX50 trong tất cả các giai đoạn.

c) Thời hạn hoạt động của quỹ: Không giới hạn

d) Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio): Chỉ số VNX50

e) Chính sách phân chia lợi nhuận

- Quỹ chi trả lợi tức quỹ bảo đảm nguyên tắc:
    - Phù hợp với chính sách phân chia lợi nhuận quy định tại Điều Lệ Quỹ;
    - Thực hiện sau khi Quỹ đã hoàn thành nghĩa vụ thuế và các nghĩa vụ tài chính khác theo quy định của pháp luật và trích lập đầy đủ các quỹ theo quy định tại Điều Lệ Quỹ (nếu có);
    - Sau khi chi trả, Quỹ vẫn phải bảo đảm có nguồn vốn để thanh toán đủ các khoản nợ, nghĩa vụ tài sản khác đến hạn và bảo đảm giá trị tài sản ròng không thấp hơn năm mươi (50) tỷ đồng;
  - Trường hợp phân phối lợi tức bằng chứng chỉ quỹ, Quỹ phải có đủ nguồn vốn đối ứng từ lợi nhuận sau thuế chưa phân phối căn cứ trên báo cáo tài chính kỳ gần nhất đã được kiểm toán hoặc soát xét.
  - Hình thức phân chia lợi nhuận có thể bằng tiền hoặc bằng chứng chỉ quỹ.
  - Việc phân chia lợi nhuận của Quỹ bằng đơn vị quỹ được thực hiện trên cơ sở đề xuất của Công Ty Quản Lý Quỹ và phải được Đại Hội Nhà Đầu Tư hoặc Ban Đại Diện Quỹ (nếu được ủy quyền) chấp thuận.
  - Nhà Đầu Tư có trong Danh sách Nhà Đầu Tư tại Ngày Giao dịch được công bố bởi Công Ty Quản Lý Quỹ cho việc phân chia lợi nhuận ("Ngày Chốt Danh Sách") được coi là đủ điều kiện để nhận lợi nhuận được phân chia. Trường hợp Nhà Đầu Tư đã chuyển nhượng số đơn vị quỹ của mình trong thời gian giữa thời điểm Ngày Chốt Danh Sách và thời điểm chi trả thì người chuyển nhượng là người nhận lợi nhuận.
- f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành (tại thời điểm 31/12/2019): 14.200.000 chứng chỉ quỹ (CCQ)

- g) Nội dung thay đổi tại Điều Lệ Quỹ trong năm: Quỹ không thay đổi Điều Lệ Quỹ trong năm.  
 h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong năm:

Vui lòng xem Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư thường niên năm 2019 theo đường link sau:

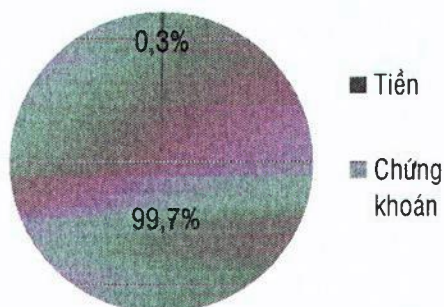
<https://www.ssi.com.vn/ssiam/cong-bo-thong-tin-vnx50-cbtt-chi-tiet/bien-ban-kiem-phiếu-lay-y-kien-nha-dau-tu-bang-van-ban-va-nghi-quyet-dai-hoi-nha-dau-tu-thuong-nien-nam-2019-cua-quy-etf-ssiam-vnx50>

## 2. BÁO CÁO VỀ KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ

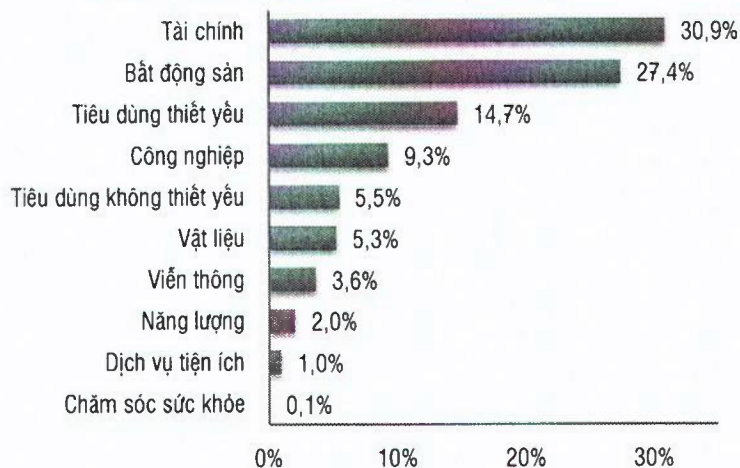
### a) Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12/2019

- Danh mục đầu tư của Quỹ phân bổ theo ngành, lĩnh vực và loại sản phẩm (cổ phiếu, tiền...)

#### Phân bổ tài sản



#### Cơ cấu danh mục theo ngành (%NAV)



- Giá trị tài sản ròng của Quỹ: 179.909.513.929 VND
- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ: 12.669,68 VND
- Số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành: 14.200.000 chứng chỉ quỹ (CCQ)
- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cao nhất/thấp nhất trong năm: 13.646,12 VND/ 11.739,24 VND
- Tổng lợi nhuận của Quỹ, nêu chi tiết phần lợi nhuận thu được từ sự tăng trưởng giá chứng khoán (giá trị lãi vốn) và phần lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...) (giá trị thu nhập);

Lãi bán các khoản đầu tư	244.136.545 VND
Chênh lệch tăng, giảm đánh giá lại các khoản đầu tư chưa thực hiện	6.294.475.953 VND

Thu nhập từ thu cổ tức	2.177.114.482 VND
------------------------	-------------------

- Chi phí hoạt động của Quỹ trong năm 2019: 1.995.645.099 VND
- Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận trong năm 2019.
- Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ và tốc độ quay vòng danh mục năm 2019:

Tỷ lệ chi phí hoạt động của Quỹ năm 2019	1,33%
Tốc độ vòng quay danh mục của Quỹ năm 2019	16,47%

#### b) Chi tiêu về lợi nhuận của quỹ

- Tổng lợi nhuận bình quân năm của Quỹ tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo: 5.043.889.827 VND

Lưu ý: Thông tin về kết quả hoạt động của quỹ chỉ mang tính tham khảo và không có nghĩa là việc đầu tư sẽ đảm bảo khả năng sinh lời cho nhà đầu tư.

### 3. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ TÀI SẢN CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ

Trong năm 2019, danh mục đầu tư của Quỹ có thay đổi cơ cấu 4 lần vào tháng 2, 5, 8 và tháng 11 do Sở giao dịch chứng khoán TP. Hồ Chí Minh tái cơ cấu lại danh mục và thay đổi tỷ lệ tự do chuyển nhượng (freefloat) của chỉ số VNX50 theo kỳ.

Trong năm, Quỹ có phát sinh giao dịch hoán đổi, số lượng chứng chỉ Quỹ tăng từ 9.700.000 CCQ tại thời điểm cuối năm 2018 lên 14.200.000 CCQ tại thời điểm cuối năm 2019.

#### CHỈ TIÊU TÀI CHÍNH TẠI NGÀY 31/12/2019

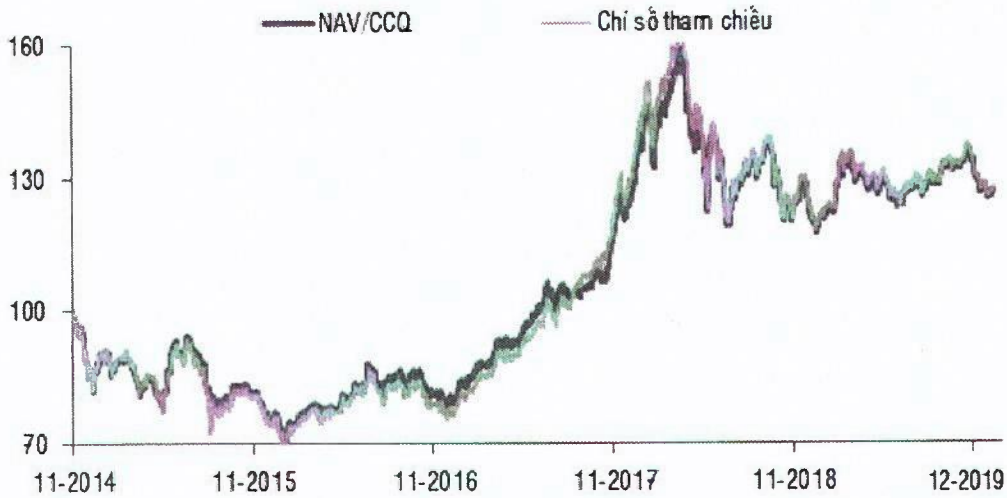
NAV/CCQ (VND)	12.669,68
Giá đóng cửa của CCQ trên sàn HOSE (VND)	12.650
Sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu (*)	0,27%(**)
Tổng số lượng CCQ lưu hành	14.200.000

Tăng trưởng (Từ ngày kết thúc đăng ký góp vốn 17/11/2014)	
Chỉ số tham chiếu (**)	27,35%
NAV/CCQ	26,70%

(\*) Sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu tại ngày 26/12/2019.

(\*\*) Từ 17/11/2014 đến 22/8/2018, Chỉ số tham chiếu là chỉ số HNX30, kể từ sau 22/8/2018, Chỉ số tham chiếu là chỉ số VNX50.

## BIẾN ĐỘNG NAV VÀ CHỈ SỐ THAM CHIẾU VNX50



## LỢI NHUẬN ĐẦU TƯ ĐỐI VỚI CÁC LOẠI TÀI SẢN

Lãi/lỗ theo tài sản	Lãi/lỗ đã thực hiện (VND)	Lãi/lỗ chưa thực hiện (VND)
Cổ phiếu	244.136.545	6.294.475.953
Trong đó:		
Vốn hóa lớn	2.155.617.060	6.436.822.340
Vốn hóa vừa	(1.513.368.668)	(401.671.934)
Vốn hóa nhỏ	(398.111.847)	259.325.547

## 4. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG GIÁM SÁT CỦA NGÂN HÀNG GIÁM SÁT

Vui lòng xem Báo cáo về hoạt động giám sát trong năm 2019, do ngân hàng giám sát của Quý (Ngân hàng Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - CN Hà Thành) thực hiện.

## 5. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG ỦY QUYỀN

Đối với quỹ ETF SSIAM VNX50, các đơn vị nhận ủy quyền bao gồm:

- Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam – Chi nhánh Hà Thành cung cấp dịch vụ quản trị quỹ.
- Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam cung cấp dịch vụ đại lý chuyển nhượng.
- Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP. Hồ Chí Minh cung cấp dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và tính toán mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (TE).
- Đại lý phân phối kiêm Thành viên lập quỹ:
  - Công ty Cổ phần Chứng khoán SSI (SSI)

- o Công ty Cổ phần Chứng khoán Bảo Việt (BVSC)
- o Công ty TNHH Chứng khoán Ngân Hàng Ngoại Thương Việt Nam (VCBS)
- o Công ty Cổ phần Chứng khoán VNDirect (VNDS)
- o Công ty TNHH Chứng khoán Mirae Asset Việt Nam (MAS)

a) Chi phí phải trả cho bên nhận ủy quyền so với lợi nhuận, thu nhập, tổng chi phí hoạt động của Quỹ:

	Tổng chi phí năm 2019 (VND)	Tỷ lệ so với Lợi nhuận	Tỷ lệ so với Thu nhập	Tỷ lệ so với Tổng chi phí hoạt động Quỹ
Giá dịch vụ quản trị quỹ	198.000.000	2,98%	2,27%	9,60%
Giá dịch vụ đại lý chuyển nhượng	66.000.000	0,99%	0,76%	3,20%
Giá dịch vụ tính iNAV và TE	50.000.000	0,75%	0,57%	2,42%
Giá dịch vụ giao dịch trả đại lý phân phối (*)	-	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền</b>	<b>314.000.000</b>	<b>4,72%</b>	<b>3,60%</b>	<b>15,22%</b>

(\*) Quỹ không phát sinh chi phí này trong năm 2019

b) Để quản lý và phòng ngừa rủi ro liên quan đến các hoạt động ủy quyền bao gồm dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ tính mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (TE), Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI đã thực hiện các biện pháp cụ thể như sau:

- Ký kết các hợp đồng chi tiết cung cấp dịch vụ, bản ghi nhớ hoạt động trong phạm vi dịch vụ với các bên nhận ủy quyền, trong đó nêu rõ trách nhiệm của bên nhận ủy quyền.
- Nhân viên giám sát hoạt động hoạt động ủy quyền (theo sự phân công của Công Ty) đã phối hợp chặt chẽ với các bên nhận ủy quyền tuyệt đối tuân thủ các chính sách và quy trình liên quan được quy định trong hợp đồng cung cấp dịch vụ.
- Thường xuyên kiểm tra, giám sát bảo đảm hoạt động đã được ủy quyền được thực hiện thận trọng, an toàn, phù hợp với quy định của pháp luật, quy định tại Điều Lệ Quỹ, bảo đảm chất lượng dịch vụ cung cấp phù hợp với tiêu chí và yêu cầu của Công Ty Quản Lý Quỹ.

**c) Đánh giá về hoạt động của các đơn vị nhận ủy quyền**

Trong năm 2019, các đơn vị nhận ủy quyền cung cấp dịch vụ quản trị quỹ, đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ tính mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (TE) cho Quỹ đã duy trì đủ trang thiết bị cơ sở vật chất, giải pháp kỹ thuật, an ninh hệ thống, hệ thống dự phòng thảm họa, hệ thống dự phòng nóng, quy trình nghiệp vụ, hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, nhân sự có kinh nghiệm và trình độ chuyên môn phù hợp để thực hiện các hoạt động ủy quyền. Các hoạt động ủy quyền trong năm đã được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của Nhà Đầu Tư của Quỹ.

### **Đánh giá dịch vụ Quản trị Quỹ**

Ngân hàng BIDV- chi nhánh Hà Thành hiện đang là đơn vị được ủy quyền hoạt động dịch vụ Quản trị Quỹ. Các hệ thống hiện có để cung cấp dịch vụ Quản trị Quỹ có nhiều ưu điểm và được thiết lập cơ chế bảo mật do mỗi hệ thống khi thiết lập quyền truy cập đều có các nguyên tắc thiết lập mang tính bảo mật cao. Các hệ thống đều được lưu trữ dữ liệu hàng kỳ và có chương trình dự phòng thảm họa. Quy trình dự phòng thảm họa của Ngân hàng được thiết lập chi tiết, bài bản để khắc phục các thảm họa trong khoảng thời gian phù hợp nhất để đảm bảo hoạt động ít bị ảnh hưởng và các tổn thất là tối thiểu.

Dữ liệu được lưu trữ đúng theo quy định hiện hành của Pháp luật Việt Nam. Hệ thống lưu trữ thông tin của khách hàng luôn được bảo mật cao với cơ chế bảo mật tối đa. Ngoài dữ liệu dạng cứng, ngân hàng còn thiết lập quy trình đảm bảo bảo mật thông tin một cách hiệu quả qua dữ liệu gửi qua email với các phương thức bảo mật như: tường lửa, yêu cầu xác nhận, thẩm quyền trong quá trình tương tác thông tin.

Hệ thống quản trị rủi ro của Ngân hàng đảm bảo tất cả nhân viên của Ngân hàng tại các vị trí đều có trách nhiệm kiểm soát và tuân theo chính sách quản trị rủi ro. Các báo cáo chỉ số đánh giá hoạt động chính và báo cáo tiêu chuẩn kiểm soát chính được thực hiện hàng tháng và được xem xét bởi Ủy Ban Quản lý rủi ro tại các cuộc họp về rủi ro quản trị. Ngân hàng xây dựng các phương pháp nhằm hạn chế các rủi ro về hoạt động, rủi ro công nghệ, và rủi ro con người.

### **Đánh giá dịch vụ Đại Lý Chuyển Nhượng**

Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam đang là nhà cung cấp dịch vụ Đại lý chuyển nhượng cho Quỹ.

Về cơ sở vật chất kỹ thuật, hệ thống cung cấp dịch vụ Đại lý chuyển nhượng quỹ hoán đổi danh mục của VSD có các tính năng đáp ứng các nhu cầu dịch vụ của Đại Lý Chuyển Nhượng. Hệ thống có chức năng phân quyền linh hoạt, có thiết kế mở cho phép kết nối với các hệ thống thành viên khác. Hệ thống đáp ứng đầy đủ nhu cầu về nghiệp vụ Đại lý Chuyển Nhượng về việc Quản lý sổ nhà đầu tư, quản lý dữ liệu, phân bổ giao dịch và các hoạt động khác đáp ứng nhu cầu của Công Ty Quản Lý Quỹ, Đại lý phân phối, và Ngân hàng giám sát, tổ chức cung cấp dịch vụ quản trị quỹ....

Quy trình lưu trữ dữ liệu và kế hoạch dự phòng dữ liệu đảm bảo quy trình được diễn ra thông suốt. Hệ thống máy chủ của dịch vụ được đặt tại Trụ sở chính Hà Nội. Hệ thống dự phòng được đặt tại chi nhánh của VSD tại Hồ Chí Minh, đồng thời dữ liệu được sao lưu hàng ngày ra băng từ và được lưu trữ tại VSD và lưu trữ từ xa. Dữ liệu hàng ngày được đồng bộ từ hệ thống chính vào hệ thống dự phòng và được khởi động trong vòng 30 phút kể từ khi có sự cố xảy ra.

### **Đánh giá dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ tính mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (TE)**

Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP. Hồ Chí Minh hiện đang là tổ chức cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu và dịch vụ tính toán mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu.

Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP. Hồ Chí Minh đã đáp ứng được các yêu cầu về cơ sở vật chất kỹ thuật. Quy trình nghiệp vụ được thực hiện chính xác, giá trị Tài sản ròng tham chiếu trên một chứng chỉ quỹ (iNAV) được công bố mười lăm giây một lần và được công bố trên các trang thông tin điện tử của Sở Giao Dịch Chứng Khoán. Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP. Hồ Chí Minh đã tính toán mức sai lệch đúng theo công thức quy định tại Thông tư 229/2012/TT-BTC.



mu



### Đánh giá dịch vụ Thành Viên Lập Quỹ Đại Lý Phân Phối

Các Thành Viên Lập Quỹ kiêm Đại lý phân phối đều đáp ứng được yêu cầu về việc kết nối với Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam, đảm bảo quy trình nghiệp vụ của Đại lý phân phối diễn ra thông suốt không bị gián đoạn. Đại lý phân phối đã đáp ứng được yêu cầu về Quy trình ngân giao dịch muợn, các quy trình về lưu trữ thông tin và bảo mật thông tin khách hàng.

Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI <sup>nh</sup>



TỔNG GIÁM ĐỐC  
*Lê Thị Lê Hằng*