**QUỸ ETF SSIAM VNX50**

Số/No.: 403 /2020/TB-SSIAM-NVQ

**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 05 tháng 06 năm 2020*
*Ha Noi, 05 June 2020*

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

**DISCLOSURE OF INFORMATION ON THE STATE SECURITIES COMMISION'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/ *Name of Fund Management Company*: 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/ *Published by: Bà Tô Thùy Linh*
- Chức vụ/ *Position*: Phó Tổng Giám Đốc/ *COO*

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 tháng 5/2020

Monthly Report May 2020

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của Công ty/Quỹ vào ngày 05/06/2020 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 05 June 2020 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 mispresentation.*

*Tài liệu đính kèm/*
*Attachment:*
*Báo cáo tháng 05.2020 Quỹ ETF SSIAM VNX50*
*Monthly Report May 2020 of SSIAM VNX50 ETF*

**Người công bố thông tin**
***Publisher***

S.G.P: 19 - C.T.T.N.H.H
CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI
Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

*Tô Thùy Linh*
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Mẫu số B01 - ETF. Báo cáo thu nhập**
**Template B01 - ETF. Statement of Comprehensive Income**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 181/2015/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)*
*(Issued in association with Circular 181/2015/TT-BTC guiding establishment and management of Exchange Traded Fund)*

# BÁO CÁO THU NHẬP
# STATEMENT OF COMPREHENSIVE INCOME

*Tháng 05 năm 2020 /May 2020*

1. **Tên công ty quản lý quỹ:** / Management Fund Company name: — **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI** / SSI Asset Management Company Limited
2. **Tên ngân hàng giám sát:** / Supervising bank: — **Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành** / Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch
3. **Tên Quỹ:** / Fund name: — **Quỹ ETF SSIAM VNX50** / SSIAM VNX50 ETF
4. **Ngày lập báo cáo:** / Reporting Date: — Ngày 01 tháng 06 năm 2020 / 01 Jun 2020

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| TT / NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | MÃ SỐ / CODE | NĂM BÁO CÁO/ THIS YEAR | | NĂM TRƯỚC/ LAST YEAR | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | LŨY KẾ TỪ ĐẦU NĂM ĐẾN CUỐI KỲ BÁO CÁO/ ACCUMULATED FROM THE BEGINNING OF THIS YEAR | CÙNG KỲ NĂM TRƯỚC/ SAME PERIOD LAST YEAR | LŨY KẾ TỪ ĐẦU NĂM ĐẾN CUỐI KỲ NÀY NĂM TRƯỚC/ ACCUMULATED FROM THE BEGINNING OF LAST YEAR |
| **I.** | **THU NHẬP, DOANH THU HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ<br>INVESTMENT INCOME** | **01** | **17,839,568,707** | **(12,519,413,601)** | **(2,590,419,420)** | **7,349,488,200** |
| ***1.1*** | Cổ tức được chia<br>Dividend income | ***02*** | 108,684,000 | 324,703,000 | 366,124,050 | 637,720,350 |
| ***1.2*** | Tiền lãi được nhận<br>Interest income | ***03*** | 189,157 | 734,879 | 346,460 | 989,500 |
| ***1.3*** | *Thu nhập từ Trái tức<br>Income from Bond Coupon* | | - | - | - | - |
| ***1.4*** | Lãi (lỗ) bán các khoản đầu tư<br>Realized gain (losses) from disposal investments | ***04*** | (21,985,323) | (436,314,111) | (3,986,373) | 39,744,861 |
| | *Lãi (lỗ) bán các khoản đầu tư<br>Realized gain (losses) from disposal investments* | | *(21,985,323)* | *(436,314,111)* | *(206,373)* | *43,524,861* |
| | *Lãi (lỗ) trong giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ<br>Realized gain (losses) from exchange trade fund certificate* | | - | - | - | - |
| | *Lãi (lỗ) giao dịch chứng khoán hạn chế trong giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ* | | - | - | *(3,780,000)* | *(3,780,000)* |
| ***1.5*** | Chênh lệch tăng, giảm đánh giá lại các khoản đầu tư chưa thực hiện<br>Unrealized gain (losses) from investment revaluation | ***05*** | 17,752,680,873 | (12,408,537,369) | (2,952,903,557) | 6,671,033,489 |
| ***1.6*** | Doanh thu khác<br>Other income | ***06*** | - | - | - | - |
| ***1.7*** | Chênh lệch lãi, lỗ tỷ giá hối đoái đã và chưa thực hiện<br>Realized and unrealized gain (losses) from foreign exchange | ***07*** | - | - | - | - |
| ***1.8*** | Doanh thu khác về đầu tư<br>Other investment income | ***08*** | - | - | - | - |
| **II.** | **CHI PHÍ ĐẦU TƯ<br>INVESTMENT EXPENSE** | **10** | **5,258,758** | **16,918,217** | **13,929,873** | **39,586,011** |
| ***2.1*** | Chi phí giao dịch mua, bán các khoản đầu tư<br>Expense for purchasing and selling investments | ***11*** | 5,258,758 | 16,918,217 | 13,929,873 | 39,586,011 |
| | *Phí môi giới<br>Brokerage fee* | *11.1* | *5,258,758* | *16,918,217* | *13,929,873* | *39,586,011* |
| | *Chi phí thanh toán bù trừ<br>Clearing Settlement Fee* | *11.2* | - | - | - | - |
| ***2.2*** | **Chi phí đầu tư khác<br>Other investments expense** | ***15*** | - | - | - | - |
| **III.** | **CHI PHÍ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ<br>OPERATING EXPENSE** | **20** | **169,895,511** | **866,394,906** | **156,200,539** | **764,759,063** |
| ***3.1*** | Phí quản lý Quỹ<br>Management fee | ***20.1*** | 88,300,505 | 439,971,100 | 70,830,287 | 334,765,749 |
| ***3.2*** | Phí dịch vụ lưu ký tài sản Quỹ<br>Custodian fee | ***20.2*** | 17,824,886 | 105,010,774 | 21,977,112 | 108,515,684 |
| | *Phí dịch vụ lưu ký - bảo quản tài sản<br>Custodian service - Safekeeping fee* | *20.2.1* | *16,000,000* | *96,000,000* | *20,000,000* | *100,000,000* |
| | *Phí dịch vụ lưu ký - giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán<br>Custodian service - Transaction fee* | *20.2.2* | 369,181 | *1,221,787* | 1,020,068 | *2,951,006* |
| | *Phí dịch vụ lưu ký - giao dịch hoán đổi<br>Custodian service - Transaction fee for exchange traded transaction* | *20.2.3* | - | - | - | - |
| | *Phí dịch vụ lưu ký tại VSD<br>Custodian service - VSD fee* | *20.2.4* | *1,455,705* | *7,788,987* | *957,044* | *5,564,678* |
| ***3.3*** | Phí dịch vụ giám sát<br>Supervising fee | ***20.3*** | 4,400,000 | 26,400,000 | 5,500,000 | 27,500,000 |

| TT / NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | MÃ SỐ / CODE | NĂM BÁO CÁO/ THIS YEAR | | NĂM TRƯỚC/ LAST YEAR | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | LŨY KẾ TỪ ĐẦU NĂM ĐẾN CUỐI KỲ BÁO CÁO/ ACCUMULATED FROM THE BEGINNING OF THIS YEAR | CÙNG KỲ NĂM TRƯỚC/ SAME PERIOD LAST YEAR | LŨY KẾ TỪ ĐẦU NĂM ĐẾN CUỐI KỲ NÀY NĂM TRƯỚC/ ACCUMULATED FROM THE BEGINNING OF LAST YEAR |
| *3.4* | Phí dịch vụ quản trị Quỹ<br>Fund administrative fee | *20.4* | 13,200,000 | 79,200,000 | 16,500,000 | 82,500,000 |
| *3.5* | Phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng<br>Transfer agent fee | *20.5* | 5,500,000 | 27,500,000 | 5,500,000 | 27,500,000 |
| *3.6* | Phí dịch vụ khác của Nhà cung cấp dịch vụ cho Quỹ<br>Other service fees | *20.6* | *1,100,000* | *2,200,000* | - | - |
| *3.7* | Chi phí họp, Đại hội Quỹ<br>Meeting and General Meeting expense | *20.7* | 4,039,500 | 4,523,907 | - | 2,150,000 |
| *3.8* | Chi phí kiểm toán<br>Audit expense | *20.8* | 5,590,168 | 27,409,856 | 5,605,482 | 27,304,121 |
| *3.9* | Chi phí thanh lý tài sản Quỹ<br>Asset disposal expense | *20.9* | - | - | - | - |
| *3.10* | Chi phí hoạt động khác<br>Other operating expense | *20.10* | 29,940,452 | 154,179,269 | 30,287,658 | 154,523,509 |
| | *Phí thiết lập quỹ*<br>*Establishment fee* | *20.10.1* | - | - | - | - |
| | *Phí niêm yết, phí đăng ký chứng khoán*<br>*Listing fee* | *20.10.2* | - | *1,000,000* | - | - |
| | *Phí ngân hàng*<br>*Bank charges* | *20.10.3* | *36,084* | *266,738* | - | *57,813* |
| | *Phí thiết kế, in ấn, gửi thư...*<br>*Designing, prining, posting... expense* | *20.10.4* | - | - | - | - |
| | *Thù lao ban đại diện Quỹ*<br>*Remuneration of Fund's Board of Representatives* | *20.10.5* | *15,000,000* | *75,000,000* | *15,000,000* | *75,000,000* |
| | *Chi phí họp và chi phí công tác của ban đại diện*<br>*Fund's Board of Representatives meeting expense & travelling expense* | *20.10.6* | *3,387,990* | *16,612,080* | *3,397,259* | *16,547,939* |
| | *Phí quản lý thường niên phải trả cho UBCKNN, HOSE*<br>*Annual management fee paid to SSC, listing fee to HOSE* | *20.10.7* | *3,046,434* | *16,270,403* | *3,397,259* | *16,547,939* |
| | *Phí cấp quyền sử dụng chỉ số trả cho HOSE*<br>*Expenses payable to HOSE for Index usage* | *20.10.8* | *4,234,972* | *20,765,024* | *4,246,570* | *20,684,909* |
| | *Phí cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV) trả cho HOSE*<br>*Expenses payable to HOSE for iNAV calculation* | *20.10.9* | *4,234,972* | *20,765,024* | *4,246,570* | *20,684,909* |
| | *Phí thực hiện quyền trả cho VSD*<br>*Expenses for getting the list of investors from VSD* | *20.10.10* | - | *3,500,000* | - | *5,000,000* |
| | *Chi phí khác*<br>*Other expenses* | *20.10.11* | - | - | - | - |
| **IV** | **KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ**<br>**GAIN (LOSSES) FROM INVESTMENT**<br>**(23 = 01-10-20)** | **23** | **17,664,414,438** | **(13,402,726,724)** | **(2,760,549,832)** | **6,545,143,126** |
| **V** | **KẾT QUẢ THU NHẬP VÀ CHI PHÍ KHÁC**<br>**OTHER INCOME AND EXPENSE** | **24** | - | - | - | - |
| *5.1* | Thu nhập khác<br>Other income | *24.1* | - | - | - | - |
| *5.2* | Chi phí khác<br>Other expense | *24.2* | - | - | - | - |
| **VI** | **TỔNG LỢI NHUẬN KẾ TOÁN TRƯỚC THUẾ**<br>**PROFIT BEFORE TAX**<br>**(30=23+24)** | **30** | **17,664,414,438** | **(13,402,726,724)** | **(2,760,549,832)** | **6,545,143,126** |
| *6.1* | Lợi nhuận/(lỗ) đã thực hiện<br>Realized profit (losses) | 31 | (88,266,435) | (994,189,355) | 192,353,725 | (125,890,363) |
| *6.2* | Lợi nhận/(lỗ) chưa thực hiện<br>Unrealized profit (losses) | 32 | 17,752,680,873 | (12,408,537,369) | (2,952,903,557) | 6,671,033,489 |
| **VII** | **CHI PHÍ THUẾ TNDN**<br>**CORPORATE INCOME TAX** | **40** | - | - | - | - |
| **VIII** | **LỢI NHUẬN KẾ TOÁN SAU THUẾ TNDN**<br>**PROFIT AFTER TAX**<br>**(41=30-40)** | **41** | **17,664,414,438** | **(13,402,726,724)** | **(2,760,549,832)** | **6,545,143,126** |

| Người lập biểu<br>(Ký, họ tên) | Kế toán trưởng<br>(Ký, họ tên) | Tổng giám đốc<br>(Ký, họ tên, đóng dấu) |
|---|---|---|
| Nguyễn Thị Quỳ | KẾ TOÁN TRƯỞNG<br>Mai Huyền Ngọc | PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC<br>Lê Thùy Linh |

CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI

**Mẫu số B02 - ETF. Báo cáo tình hình tài chính**
**Template B02 - ETF. Statement of Financial Position**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 181/2015/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)*
*(Issued in association with Circular 181/2015/TT-BTC guiding establishment and management of Exchange Traded Fund)*

# BÁO CÁO TÌNH HÌNH TÀI CHÍNH
# STATEMENT OF FINANCIAL POSITION

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

| | | |
|---|---|---|
| 1. | **Tên công ty quản lý quỹ:**<br>Management Fund Company name: | **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**<br>SSI Asset Management Company Limited |
| 2. | **Tên ngân hàng giám sát:**<br>Supervising bank: | **Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**<br>Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch |
| 3. | **Tên Quỹ:**<br>Fund name: | **Quỹ ETF SSIAM VNX50**<br>SSIAM VNX50 ETF |
| 4. | **Ngày lập báo cáo:**<br>Reporting Date: | Ngày 01 tháng 06 năm 2020<br>01 Jun 2020 |

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| STT/ NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | Mã số | Thuyết minh | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC/ LAST PERIOD |
|---|---|---|---|---|---|
| **I.** | **TÀI SẢN**<br>**ASSETS** | | | - | - |
| **1.** | **Tiền gửi ngân hàng và các khoản tương đương tiền**<br>**Cash at bank and cash equivalent** | **110** | | **242,701,301** | **3,530,057,538** |
| | *Trong đó:*<br>*In which:* | | | - | - |
| *1.1* | *Tiền gửi ngân hàng cho hoạt động của Quỹ*<br>*Cash at bank for Fund's operation* | 111 | | 242,701,301 | 3,530,057,538 |
| **2.** | **Các khoản đầu tư thuần**<br>**Investments** | **120** | | **166,395,244,920** | **145,575,281,770** |
| ***2.1*** | Các khoản đầu tư<br>Investments | ***121*** | | 166,395,244,920 | 145,575,281,770 |
| | *Cổ phiếu*<br>*Shares* | *121.1* | | 166,395,244,920 | 145,575,281,770 |
| | *Trái phiếu*<br>*Bonds* | *121.2* | | - | - |
| | *Quyền mua*<br>*Rights* | *121.3* | | - | - |
| | *Tiền gửi có kỳ hạn hơn 3 tháng*<br>*Deposit greater than 3 months* | *121.4* | | - | - |
| | *Chứng chỉ tiền gửi ghi danh*<br>*Registered Deposit Certificate* | *121.5* | | - | - |
| | *Đầu tư khác*<br>*Other Investments* | *121.6* | | - | - |
| ***2.2*** | *Dự phòng giảm giá tài sản nhận thế chấp*<br>*Impairment of devaluation of assets as pledge* | ***122*** | | - | - |
| **3.** | **Các khoản phải thu**<br>**Receivables** | **130** | | **126,225,016** | **20,081,993** |
| ***3.1*** | ***Phải thu về bán các khoản đầu tư***<br>***Receivables from investments sold but not yet settled*** | ***131*** | | - | - |
| | *Trong đó: Phải thu khó đòi về bán các khoản đầu tư*<br>*In which: Overdue receivables from selling investments* | *132* | | - | - |
| ***3.2*** | ***Phải thu và dự thu cổ tức, tiền lãi các khoản đầu tư***<br>***Dividend and interest receivables*** | ***133*** | | ***108,684,000*** | - |
| *3.2.1* | Phải thu cổ tức, tiền lãi đến ngày nhận<br>Dividend and interest receivables | 134 | | - | - |
| | *Trong đó: Phải thu khó đòi về cổ tức, tiền lãi đến ngày nhận nhưng chưa nhận được*<br>*In which: Overdue receivables from dividend, interest income* | *135* | | - | - |
| *3.2.2* | Dự thu cổ tức, tiền lãi chưa đến ngày nhận<br>Accrual dividend, interest income | *136* | | 108,684,000 | - |
| | *Dự thu cổ tức*<br>*Dividend receivables* | *136.1* | | *108,684,000* | - |

| STT/ NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | Mã số | Thuyết minh | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC/ LAST PERIOD |
|---|---|---|---|---|---|
| | *Dự thu trái tức*<br>*Receivables from bond coupon* | | | - | - |
| ***3.3*** | Các khoản phải thu khác<br>Other receivables | ***137*** | | 17,541,016 | 20,081,993 |
| | *Dự thu lãi tiền gửi - tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng*<br>*Interest receivables from term-deposit less than 3 months* | *137.1* | | - | - |
| | *Trả trước phí tổ chức đại hội thường niên*<br>*Prepaid expense for AGM organization* | *137.2* | | - | - |
| | *Các khoản đặt cọc và ứng trước*<br>*Deposit suspense* | *137.3* | | *17,541,016* | *20,081,993* |
| | *Phải thu khác*<br>*Other receivables* | *137.4* | | - | - |
| ***3.4*** | ***Dự phòng nợ phải thu khó đòi (*)***<br>***Provision for doubtful debt*** | ***138*** | | - | - |
| | **TỔNG TÀI SẢN**<br>**TOTAL ASSETS** | **200** | | **166,764,171,237** | **149,125,421,301** |
| **II.** | **NỢ PHẢI TRẢ**<br>**TOTAL LIABILITIES** | **II** | | - | - |
| **1.** | **Vay ngắn hạn**<br>**Shorterm loans** | *311* | | - | - |
| **2.** | **Phải trả về mua các khoản đầu tư**<br>**Payables for securities bought but not yet settled** | *312* | | - | - |
| **3.** | **Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối và công ty quản lý quỹ**<br>**Subscription and Redemption fee payable to distributors and fund management company** | *313* | | - | - |
| **4.** | **Thuế và các khoản phải nộp Nhà nước**<br>**Tax payables and obligations to the State Budget** | *314* | | - | - |
| **5.** | **Phải trả thu nhập cho Nhà đầu tư**<br>**Profit distribution payables** | *315* | | - | - |
| | Phải trả nhà đầu tư trên tài sản giữ hộ<br>Payables to investors for investment bought on behalf | *315.1* | | - | - |
| | Phải trả nhà đầu tư trên cổ tức đã thu<br>Payables to investors for collected dividend | *315.2* | | - | - |
| **6.** | **Chi phí phải trả**<br>**Expense Accuals** | **316** | | **74,021,936** | **116,043,778** |
| | *Phải trả phí môi giới*<br>*Brokerage fee payable* | *316.1* | | - | - |
| | *Trích trước phí kiểm toán*<br>*Expense accruals- Audit fee* | *316.2* | | *27,409,856* | *87,819,688* |
| | *Trích trước phí họp đại hội*<br>*Expense accruals - General meeting* | *316.3* | | - | - |
| | *Trích trước thù lao ban đại diện quỹ*<br>*Expense accruals - Remuneration Payable to Fund's Board of Representatives* | *316.4* | | *30,000,000* | *15,000,000* |
| | *Trích trước chi phí họp và chi phí công tác của ban đại diện*<br>*Accrual for Board of Representatives meeting expense & travelling expense* | *316.5* | | *16,612,080* | *13,224,090* |
| | *Trích trước phí báo cáo thường niên*<br>*Expense accruals for Annual report* | *316.6* | | - | - |
| **7** | **Phải trả cho Nhà đầu tư về bán Chứng chỉ quỹ**<br>**Subscription Suspense Payable** | **317** | | - | - |
| **8** | **Phải trả cho Nhà đầu tư về mua lại Chứng chỉ quỹ**<br>**Redemption payable** | **318** | | - | - |
| **9** | **Phải trả dịch vụ quản lý Quỹ ETF**<br>**Fund management related service expense payable** | **319** | | **132,900,505** | **125,518,566** |
| ***9.1*** | ***Trích trước phải trả phí quản lý***<br>***Expense accruals for Management fee*** | ***319.1*** | | ***88,300,505*** | ***78,018,566*** |
| ***9.2*** | ***Phải trả phí lưu ký***<br>***Custodian fee payables*** | ***319.2*** | | ***16,000,000*** | ***20,000,000*** |
| | *Trích trước phải trả phí dịch vụ lưu ký*<br>*Expense accruals for Custodian service* | *319.2.1* | | *16,000,000* | *20,000,000* |

| STT/ NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | Mã số | Thuyết minh | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC/ LAST PERIOD |
|---|---|---|---|---|---|
| | *Trích trước phí dịch vụ lưu ký - giao dịch chứng khoán*<br>*Expense accruals for Custodian service - Transaction fee* | *319.2.2* | | - | - |
| ***9.3*** | ***Trích trước phí giám sát***<br>***Expense accruals for Supervising fee*** | ***319.3*** | | ***4,400,000*** | ***5,500,000*** |
| ***9.4*** | ***Trích trước phí quản trị quỹ***<br>***Expense accruals for Fund administration fee*** | ***319.4*** | | ***13,200,000*** | ***16,500,000*** |
| ***9.5*** | ***Trích trước phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng***<br>***Expense accruals for Tranfer agency fee*** | ***319.5*** | | ***11,000,000*** | ***5,500,000*** |
| **10** | **Phải trả, phải nộp khác**<br>**Other payables** | **320** | | **50,461,591** | **41,486,190** |
| | *Phải trả phí thiết lập quỹ ban đầu*<br>*Fund initial set-up fee payables* | *320.1* | | - | - |
| | *Phải trả phí giao dịch chứng khoán hộ nhà đầu tư*<br>*Transaction fee Payables on behalf of investors* | *320.2* | | - | - |
| | *Dự chi phí cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV) cho HOSE*<br>*Accrual expenses payable to HOSE for iNAV calculation* | *320.3* | | 23,325,086 | 19,090,114 |
| | *Dự chi phí cấp quyền sử dụng chỉ số cho HOSE*<br>*Accrual expenses payable to HOSE for Index usage* | *320.4* | | 23,325,086 | 19,090,114 |
| | *Phải trả phí quản lý thường niên cho UBCKNN*<br>*Annual management fee paid to SSC* | *320.5* | | 3,811,419 | 3,305,962 |
| | *Phải trả khác*<br>*Other payable* | *320.6* | | - | - |
| | **TỔNG NỢ PHẢI TRẢ**<br>**TOTAL LIABILITIES** | **300** | | **257,384,032** | **283,048,534** |
| **III.** | **GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG CÓ THỂ PHÂN PHỐI CHO NHÀ ĐẦU TƯ NẮM GIỮ CHỨNG CHỈ QUỸ MỞ**<br>**DISTRIBUTABLE NET ASSET VALUE (I-II)** | **400** | | **166,506,787,205** | **148,842,372,767** |
| **1.** | **Vốn góp của các nhà đầu tư**<br>**Paid up capital** | 411 | | **142,000,000,000** | **142,000,000,000** |
| ***1.1.*** | ***Vốn góp phát hành***<br>***Capital from subscription*** | ***412*** | | ***157,000,000,000*** | ***157,000,000,000*** |
| ***1.2.*** | ***Vốn góp mua lại***<br>***Capital from redeemption*** | ***413*** | | ***(15,000,000,000)*** | ***(15,000,000,000)*** |
| **2.** | **Thặng dư vốn góp của Nhà đầu tư**<br>**Share premium** | 414 | | *12,690,064,795.00* | **12,690,064,795** |
| **3.** | **Lợi nhuận chưa phân phối**<br>**Undistributed earnings** | 420 | | **11,816,722,410** | **(5,847,692,028)** |
| ***3.1*** | ***Lợi nhuận chưa phân phối đầu kỳ***<br>***Retained earning at the beginning of the period*** | ***420.1*** | | ***(5,847,692,028)*** | ***(27,151,231,578)*** |
| ***3.2*** | ***Lợi nhuận chưa phân phối trong kỳ***<br>***Retained earning during the period*** | ***420.2*** | | ***17,664,414,438*** | ***21,303,539,550*** |
| **IV.** | **GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG CỦA QUỸ MỞ TRÊN 1 ĐƠN VỊ CHỨNG CHỈ QUỸ**<br>**NET ASSET VALUE PER FUND CERTIFICATE**<br>**(IV=(I-II)/III)** | 430 | | **11,725.83** | **10,481.85** |
| **V.** | **LỢI NHUẬN ĐÃ PHÂN PHỐI CHO NHÀ ĐẦU TƯ**<br>**DISTRIBUTED EARNINGS** | 440 | | - | - |
| **1.** | **Lợi nhuận/tài sản đã phân phối cho Nhà đầu tư trong kỳ**<br>**Distributed earnings assets in the period** | 441 | | - | - |
| **2.** | **Lợi nhuận đã phân phối cho Nhà đầu tư lũy kế từ khi thành lập Quỹ mở đến kỳ lập báo cáo này**<br>**Accumulated distributed profit/ assets** | 442 | | - | - |

**CÁC CHỈ TIÊU NGOÀI BẢNG CÂN ĐỐI KẾ TOÁN**

*Đơn vị tính: VND/CCQ*

| STT/ NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | Mã số | Thuyết minh | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC/ LAST PERIOD |
|---|---|---|---|---|---|
| **1.** | **Tài sản nhận thế chấp**<br>**Assets received as pledge** | 001 | | - | - |

| STT/ NO | CHỈ TIÊU/ INDICATORS | Mã số | Thuyết minh | KỲ BÁO CÁO/ THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC/ LAST PERIOD |
|---|---|---|---|---|---|
| 2. | Nợ khó đòi đã xử lý<br>Written off bad debts | 002 | | - | - |
| 3. | Ngoại tệ các loại<br>Foreign currencies | 003 | | - | - |
| 4. | Số lượng Chứng chỉ quỹ đang lưu hành<br>Number of outstanding fund certificates | 004 | | 14,200,000.00 | 14,200,000.00 |

| Người lập biểu<br>(Ký, họ tên) | Kế toán trưởng<br>(Ký, họ tên) | Tổng giám đốc<br>(Ký, họ tên, đóng dấu) |
|---|---|---|
| Nguyễn Thị Duyên | KẾ TOÁN TRƯỞNG<br>Mai Huyền Ngọc | Tô Thùy Linh<br>PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC |

S.G.P: 19 - C.T.T.N.H.H
CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI
Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

**Mẫu số B03 - ETF: Mẫu báo cáo thay đổi giá trị tài sản ròng, giao dịch chứng chỉ quỹ**
**Template B03 - ETF: Report on change of Net Asset Value, trading of Fund Certificate**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 181/2015/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)*
*(Issued in association with Circular 181/2015/TT-BTC guiding establishment and management of Exchange Traded Fund)*

# BÁO CÁO THAY ĐỔI GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG, GIAO DỊCH CHỨNG CHỈ QUỸ
# STATEMENT OF CHANGE IN NET ASSET VALUE AND REDEMPTION, SUBSCRIPTION OF FUND CERTIFICATE

*Tháng 05 năm 2020 /May 2020*

| | | |
|---|---|---|
| 1 | **Tên Công ty quản lý quỹ:**<br>Management Fund Company | **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**<br>SSI Asset Management Company Limited |
| 2 | **Tên ngân hàng giám sát:**<br>Supervising bank: | **Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**<br>Bank of Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch |
| 3 | **Tên Quỹ:**<br>Fund name: | **Quỹ ETF SSIAM VNX50**<br>SSIAM VNX50 ETF |
| 4 | **Ngày lập báo cáo:**<br>Reporting Date: | Ngày 01 tháng 06 năm 2020<br>01 Jun 2020 |

Đơn vị tính/Currency: VND

| STT<br>No | | Nội dung<br>Item | Tháng 05 năm 2020<br>May 2020 | Tháng 04 năm 2020<br>Apr 2020 |
|---|---|---|---|---|
| **Quỹ ETF SSIAM VNX50**<br>**SSIAM VNX50 ETF** | | | | |
| I | | Giá trị tài sản ròng của Quỹ ETF (NAV) đầu kỳ<br>Net Asset Value (NAV) at the beginning of period | **148,842,372,767** | **127,538,833,217** |
| II | | Thay đổi NAV so với kỳ trước (= II.1 + II.2), trong đó:<br>Change of NAV during the period (= II.1 + II.2), of which: | **17,664,414,438** | **21,303,539,550** |
| | II.1 | Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của Quỹ ETF trong kỳ<br>Changes of NAV due to market fluctuation and the fund's investment during the period | 17,664,414,438 | 21,303,539,550 |
| | II.2 | Thay đổi NAV do phân chia Lợi nhuận/Tài sản của Quỹ ETF cho Nhà đầu tư trong kỳ<br>Change of NAV due to profit distribution to investors during the period | | |
| III | | Thay đổi NAV do hoán đổi lại, phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ ETF (= III.1 - III.2)<br>Change of NAV due to redemption, subscription of Fund Certificate | | |
| | III.1 | Khoản thu từ việc phát hành bổ sung Chứng chỉ Quỹ ETF<br>Increase from Subscription of Fund Certificate | | |
| | III.2 | Khoản thanh toán từ việc hoán đổi lại Chứng chỉ Quỹ ETF<br>Decrease from Redemption of Fund Certificate | | |
| IV | | Giá trị tài sản ròng của Quỹ ETF cuối kỳ ( = I + II + III)<br>NAV at the end of period (= I + II + III) | **166,506,787,205** | **148,842,372,767** |

**Người lập biểu**
(Ký, họ tên)

Nguyễn Thị Quỳ

**Kế toán trưởng**
(Ký, họ tên)

KẾ TOÁN TRƯỞNG
Mai Huyền Ngọc

**Tổng giám đốc**
(Ký, họ tên, đóng dấu)

S.G.P: 19 - C.T.T.N.H.H - CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI - Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF**
**Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:** **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
Management Fund Company name: SSI Asset Management Company Limited
**Tên ngân hàng giám sát:** **Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Supervising bank: Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch
**Tên Quỹ:** **Quỹ ETF SSIAM VNX50**
Fund name: SSIAM VNX50 ETF
**Ngày lập báo cáo:** Ngày 01 tháng 06 năm 2020
Reporting Date: 01 Jun 2020

## I. BÁO CÁO VỀ TÀI SẢN/ ASSET REPORT

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| TT NO | Chỉ tiêu Indicators | Mã chỉ tiêu Code | Kỳ báo cáo This period | Kỳ trước Previous period | %/cùng kỳ năm trước %/same period of last year |
|---|---|---|---|---|---|
| **I** | **Tài sản Assets** | **2200** | - | - | |
| I.1 | Tiền gửi ngân hàng và các khoản tương đương tiền Cash at bank and cash equivalent | 2201 | 242,701,301 | 3,530,057,538 | 55.42% |
| | Tiền Cash in bank | 2202 | - | - | |
| | Tiền gửi ngân hàng Cash at bank | 2203 | 242,701,301 | 3,530,057,538 | 55.42% |
| | Các khoản tương đương tiền Cash equivalent | 2204 | - | - | |
| I.2 | Các khoản đầu tư (kê chi tiết) Investments | 2205 | 166,395,244,920 | 145,575,281,770 | 109.05% |
| | Cổ phiếu niêm yết Listed shares | 2205.1 | 166,395,244,920 | 145,575,281,770 | 109.05% |
| | Quyền mua Rights | 2205.2 | - | - | |
| I.3 | Cổ tức, trái tức được nhận Dividend and coupon receivables | 2206 | 108,684,000 | - | 26.84% |
| | Phải thu cổ tức, tiền lãi đến ngày nhận Dividend and interest receivables | 2206.1 | - | - | |
| | Dự thu cổ tức, tiền lãi chưa đến ngày nhận Accrual dividend, interest income | 2206.2 | 108,684,000 | - | 26.84% |
| I.4 | Lãi được nhận Interest receivables | 2207 | - | - | |
| I.5 | Tiền bán chứng khoán chờ thu (kê chi tiết) Receivables from investments sold but not yet settled (in details) | 2208 | - | - | |
| I.6 | Các khoản phải thu khác Other receivables | 2210 | - | - | |
| I.7 | Các tài sản khác Other assets | 2211 | 17,541,016 | 20,081,993 | 99.73% |
| | Trả trước phí quản lý niêm yết hàng năm tại SGDCK HCM Prepaid expense for listing fee at HSX | 2211.1 | 17,541,016 | 20,081,993 | 99.73% |
| I.8 | **Tổng tài sản Total Assets** | 2212 | **166,764,171,237** | **149,125,421,301** | **108.68%** |
| **II** | **Nợ Liabilities** | **2213** | - | - | |
| II.1 | Tiền phải thanh toán mua chứng khoán (kê chi tiết) Paybles for securities bought but not yet settled (in details) | 2214 | - | - | |
| | Phải trả mua cổ phiếu Outstanding Settlement of buying securities | 2214.1 | - | - | |
| II.2 | Các khoản phải trả khác Other payables | 2215 | 257,384,032 | 283,048,534 | 79.85% |
| | Phải trả nhà đầu tư Payables to investors | 2215.1 | - | - | |
| | *Phải trả nhà đầu tư trên tài sản giữ hộ Payables to investors for investment bought on behalf* | 2215.1.1 | - | - | |
| | *Phải trả nhà đầu tư trên cổ tức đã thu Payables to investors for collected dividend* | 2215.1.2 | - | - | |
| | *Phải trả cho Nhà đầu tư về mua lại Chứng chỉ quỹ Redemption payable to investors* | 2215.1.3 | - | - | |
| | *Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ Subcription payable to investors* | 2215.1.4 | - | - | |
| | Thuế và các khoản phải nộp Nhà nước Taxes Payables and obligations to the State Budget | 2215.2 | - | - | |
| | Phải trả phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng Transfer Agency fee payable | 2215.3 | 11,000,000 | 5,500,000 | 100.00% |
| | Phải trả phí môi giới Broker fee payable | 2215.4 | - | - | |
| | Phải trả phí quản lý cho công ty quản lý quỹ Payables management fee for FMC | 2215.5 | 88,300,505 | 78,018,566 | 124.66% |
| | Phải trả phí quản trị quỹ Fund Administration fee payable | 2215.6 | 13,200,000 | 16,500,000 | 80.00% |
| | Phải trả phí lưu ký, giám sát, phí giao dịch cho Ngân hàng giám sát Custodian, supervisory fee and transaction fee payable | 2215.7 | 20,400,000 | 25,500,000 | 80.00% |
| | *Phải trả phí dịch vụ lưu ký Custody service fee payables* | 2215.7.1 | 16,000,000 | 20,000,000 | 80.00% |

| TT NO | Chỉ tiêu Indicators | Mã chỉ tiêu Code | Kỳ báo cáo This period | Kỳ trước Previous period | %/cùng kỳ năm trước %/same period of last year |
|---|---|---|---|---|---|
| | *Phải trả phí giám sát*<br>*Supervisory service fee payable* | 2215.7.2 | 4,400,000 | 5,500,000 | 80.00% |
| | *Phải trả phí giao dịch chứng khoán của Quỹ*<br>*Transaction fee Payables of the Fund* | 2215.7.3 | - | - | |
| | Phải trả thù lao ban đại diện quỹ<br>Remuneration Payable to Fund's Board of Representatives | 2215.8 | 30,000,000 | 15,000,000 | 100.00% |
| | Phải trả phí kiểm toán<br>Audit fee payable | 2215.9 | 27,409,856 | 87,819,688 | 29.38% |
| | Phải trả phí họp đại hội<br>General meeting expense payable | 2215.10 | - | - | |
| | Phải trả phí báo cáo thường niên<br>Annual report expense payable | 2215.11 | - | - | |
| | Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối và Công ty quản lý quỹ<br>Subscription and Redemption fee payable to distributors and Fund Management Company | 2215.12 | - | - | |
| | Phải trả khác<br>Other payables | 2215.13 | 67,073,671 | 54,710,280 | 121.26% |
| | *Phải trả phí thiết lập quỹ ban đầu*<br>*Fund initial set-up fee payables* | 2215.13.1 | - | - | |
| | *Phải trả phí quản lý thường niên cho UBCKNN*<br>*Annual management fee paid to SSC* | 2215.13.2 | 3,811,419 | 3,305,962 | 92.13% |
| | *Dự chi phí cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV) cho HOSE*<br>*Accrual expenses payable to HOSE for iNAV calculation* | 2215.13.3 | 23,325,086 | 19,090,114 | 91.16% |
| | *Dự chi phí cấp quyền sử dụng chỉ số cho HOSE*<br>*Accrual expenses payable to HOSE for Index usage* | 2215.13.4 | 23,325,086 | 19,090,114 | 91.16% |
| | *Dự chi chi phí công tác của Ban đại diện*<br>*Fund's Board of Representatives business expense* | 2215.13.5 | 16,612,080 | 13,224,090 | 100.39% |
| | *Phải trả khác*<br>*Other payable* | 2215.13.6 | - | - | |
| **II.3** | **Tổng nợ**<br>**Total liabilities** | **2216** | **257,384,032** | **283,048,534** | **79.85%** |
| **III** | **Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)**<br>**Net asset value of Fund (I.8-II.3)** | **2217** | **166,506,787,205** | **148,842,372,767** | **108.74%** |
| **IV** | **Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành**<br>**Number of total outstanding fund certificates** | **2218** | **14,200,000.00** | **14,200,000.00** | **117.36%** |
| **V** | **Giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ quỹ (III/V)**<br>**Net asset value per unit certificate (III/V)** | **2219** | **11,725.83** | **10,481.85** | **92.66%** |
| | | | | | |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
Authorised Representative of Supervisory Bank

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF
Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO VỀ TÌNH HÌNH TỰ DOANH ĐẦU TƯ GIÁN TIẾP RA NƯỚC NGOÀI CỦA QUỸ
# REPORT ON FUND'S FOREIGN PORFOLIO INVESTMENT

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:**
Management Fund Company name:

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:**
Supervising bank:

**Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:**
Fund name:

**Quỹ ETF SSIAM VNX50**
SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:**
Reporting Date:

Ngày 01 tháng 06 năm 2020
01 Jun 2020

## I. Tình hình thực hiện hạn mức tự doanh đầu tư gián tiếp ra nước ngoài

| STT No. | Chỉ tiêu | Giá trị | |
|---|---|---|---|
| | | Ngoại tệ | Tỷ VND (quy đổi) |
| I | Hạn mức tự doanh được Ngân hàng nhà nước xác nhận | | |
| 1 | Đô la Mỹ | | |
| 2 | ... | | |
| II | Giá trị đã đầu tư tại thời điểm cuối tháng | | |
| 1 | Đô la Mỹ | | |
| 2 | ... | | |
| III | Giá trị đã đầu tư trong tháng | | |
| 1 | Đô la Mỹ | | |
| 2 | ... | | |
| IV | Giá trị còn được đầu tư (IV=I-II) | | |
| 1 | Đô la Mỹ | | |
| 2 | ... | | |

*(Tỷ giá được quy đổi theo tỷ giá giao dịch thực tế tại thời điểm phát sinh giao dịch)*

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
*Authorised Representative of Supervisory Bank*

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - CN Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
*Authorised Representative of Fund Management Company*

**Công ty TNHH Quản lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF**
**Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities**
*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tháng 05 năm 2020 /May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:**
Management Fund Company name:
**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:**
Supervising bank:
**Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:**
Fund name:
**Quỹ ETF SSIAM VNX50**
SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:**
Reporting Date:
Ngày 01 tháng 06 năm 2020
01 Jun 2020

**II. BÁO CÁO KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG/ PROFIT AND LOSS REPORT**

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| TT NO | Chỉ tiêu Indicators | Mã chỉ tiêu Code | Kỳ báo cáo This period | Kỳ trước Previous period | Lũy kế từ đầu năm Accumulated figure from the beginning of the year |
|---|---|---|---|---|---|
| **I** | **Thu nhập từ hoạt động đầu tư Investment income** | **2220** | **108,873,157** | **37,055,480** | **325,437,879** |
| 1 | Cổ tức, trái tức được nhận Dividend, Bond coupon income | 2221 | 108,684,000 | 36,936,000 | 324,703,000 |
| 2 | Lãi được nhận Interest income | 2222 | 189,157 | 119,480 | 734,879 |
| 3 | Các khoản thu nhập khác Other income | 2223 | - | - | - |
| **II** | **Chi phí Expense** | **2224** | **175,154,269** | **171,600,960** | **883,313,123** |
| 1 | Phí quản lý trả cho công ty quản lý quỹ Management fee for FMC | 2225 | 88,300,505 | 78,018,566 | 439,971,100 |
| 2 | Phí lưu ký, giám sát trả cho NHGS Custodian, Supervisory fee for Supervisory Bank | 2226 | 22,224,886 | 27,342,424 | 131,410,774 |
| | *Phí dịch vụ lưu ký tài sản Custodian service fee* | 2226.1 | 16,000,000 | 20,000,000 | 96,000,000 |
| | *Phí giao dịch chứng khoán Transaction fee* | 2226.2 | 369,181 | 286,867 | 1,221,787 |
| | *Phí giao dịch hoán đổi Transaction fee for exchange traded transaction* | 2226.2.1 | - | - | - |
| | *Phí giám sát Supervisory fee* | 2226.3 | 4,400,000 | 5,500,000 | 26,400,000 |
| | *Phí dịch vụ lưu ký tại VSD Custodian service - VSD fee* | 2226.4 | 1,455,705 | 1,555,557 | 7,788,987 |
| 3 | Chi phí dịch vụ quản trị quỹ, chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng và các chi phí khác mà công ty quản lý quỹ trả cho tổ chức cung cấp dịch vụ có liên quan (nếu có); Fund Administration Fee, Transfer Agency Fee, and other fee paid to relevant Fund's service providers (if any) | 2227 | 28,269,944 | 31,296,720 | 150,430,048 |
| | *Chi phí dịch vụ quản trị Quỹ Fund Administration Fee* | 2227.1 | 13,200,000 | 16,500,000 | 79,200,000 |
| | *Chi phí dịch vụ Đại lý Chuyển nhượng Transfer Agency Fee* | 2227.2 | 5,500,000 | 5,500,000 | 27,500,000 |
| | *Phí cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV) trả cho HOSE Expenses payable to HOSE for iNAV calculation* | 2227.3 | 4,234,972 | 4,098,360 | 20,765,024 |
| | *Phí cấp quyền sử dụng chỉ số trả cho HOSE Expenses payable to HOSE for Index usage* | 2227.4 | 4,234,972 | 4,098,360 | 20,765,024 |
| | Phí dịch vụ khác của Nhà cung cấp dịch vụ cho Quỹ Other service fees | 2227.5 | 1,100,000 | 1,100,000 | 2,200,000 |
| 4 | Chi phí kiểm toán trả cho tổ chức kiểm toán; Audit fee | 2228 | 5,590,168 | 5,409,840 | 27,409,856 |
| 5 | Chi phí dịch vụ tư vấn pháp lý, dịch vụ báo giá và các dịch vụ hợp lý khác, thù lao trả cho ban đại diện quỹ; Legal consultancy expenses, price quotation fee, other valid expenses, remuneration payable to fund representative board | 2229 | 15,000,000 | 15,000,000 | 75,000,000 |
| | *Thù lao trả cho ban đại diện quỹ Remuneration for Fund's Board of Representatives* | 2229.1 | 15,000,000 | 15,000,000 | 75,000,000 |

| TT NO | Chỉ tiêu Indicators | Mã chỉ tiêu Code | Kỳ báo cáo This period | Kỳ trước Previous period | Lũy kế từ đầu năm Accumulated figure from the beginning of the year |
|---|---|---|---|---|---|
| 6 | Chi phí dự thảo, in ấn, gửi bản cáo bạch, bản cáo bạch tóm tắt, báo cáo tài chính, xác nhận giao dịch, sao kê tài khoản và các tài liệu khác cho nhà đầu tư; chi phí công bố thông tin của quỹ; chi phí tổ chức họp đại hội nhà đầu tư, ban đại diện quỹ; Fee for drafting, printing, distribution of prospectus, summarised propectus, financial statements, transaction confirmations, account statements and other documents to investors; information disclosure fee; fee for organising annual general meeting, board of representatives meeting | 2230 | 7,427,490 | 3,763,107 | 21,135,987 |
| | *Phí thiết kế, in ấn, gửi thư... Designing, prining, posting... Expense* | *2230.1* | - | - | - |
| | *Phí báo cáo thường niên Annual report expense* | *2230.2* | - | - | - |
| | *Chi phí họp Đại hội Quỹ Meeting expense* | *2230.3* | 4,039,500 | 484,407 | 4,523,907 |
| | *Chi phí họp và chi phí công tác của ban đại diện Fund's Board of Representatives meeting expense & travelling expense* | *2230.4* | 3,387,990 | 3,278,700 | 16,612,080 |
| 7 | Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản của quỹ. Expenses related to execution of fund's asset transactions | 2231 | 5,258,758 | 3,968,040 | 16,918,217 |
| | *Chi phí môi giới Brokerage fee expense* | *2231.1* | 5,258,758 | 3,968,040 | 16,918,217 |
| | *Chi phí thanh toán bù trừ Clearing settlement fee* | *2231.2* | - | - | - |
| 8 | Các loại phí khác (nêu chi tiết) Other fees (in details) | 2232 | 3,082,518 | 6,802,263 | 21,037,141 |
| | *Chi phí thiết lập ban đầu Fund initial set-up fee* | 2232.1 | - | - | - |
| | *Phí niêm yết, phí đăng ký chứng khoán Listing fee, registration fee* | 2232.2 | - | - | 1,000,000 |
| | *Phí ngân hàng Bank charges* | 2232.3 | 36,084 | 23,593 | 266,738 |
| | *Phí quản lý thường niên phải trả cho UBCKNN,HOSE Annual management fee paid to SSC, HOSE* | 2232.4 | 3,046,434 | 3,278,670 | 16,270,403 |
| | *Phí thực hiện quyền trả cho VSD Expenses for getting the list of investors from VSD* | 2232.5 | - | 3,500,000 | 3,500,000 |
| | *Phí đăng ký niêm yết bổ sung trả VSD Additional registration fee pay for VSD* | 2232.6 | - | - | - |
| **III** | **Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II) Net Income from Investment Activities ( = I - II)** | **2233** | (66,281,112) | (134,545,480) | (557,875,244) |
| **IV** | **Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư Gain / (Loss) from Investment Activities** | **2234** | 17,730,695,550 | 21,438,085,030 | (12,844,851,480) |
| 1 | Lãi (lỗ) thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư Realised Gain / (Loss) from disposal of investment | 2235 | (21,985,323) | (575,912,302) | (436,314,111) |
| | *Lãi (lỗ) bán các khoản đầu tư Realised Gain / (Loss) from sales of investments* | 2235.1 | (21,985,323) | (575,912,302) | (436,314,111) |
| | *Lãi (lỗ) trong giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ Realised Gain / (Loss) from exchange trade fund certificate* | 2235.2 | - | - | - |
| | *Lãi (lỗ) giao dịch chứng khoán hạn chế trong giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ* | 2235.3 | - | - | - |
| 2 | Thay đổi về giá trị của các khoản đầu tư trong kỳ Unrealised Gain / (Loss) due to market price | 2236 | 17,752,680,873 | 22,013,997,332 | (12,408,537,369) |
| **V** | **Thay đổi của giá trị tài sản ròng do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV) Change of Net Asset Value of the Fund due to investment activities during the period ( = III + IV)** | **2237** | 17,664,414,438 | 21,303,539,550 | (13,402,726,724) |
| **VI** | **Giá trị tài sản ròng đầu kỳ Net Asset Value at the beginning of period** | **2238** | 148,842,372,767 | 127,538,833,217 | 179,909,513,929 |
| **VII** | **Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ trong kỳ Change of Net Asset Value of the Fund during the period** | **2239** | 17,664,414,438 | 21,303,539,550 | (13,402,726,724) |
| | Trong đó: In which: | 2240 | - | - | - |
| 1 | Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do các hoạt động liên quan đến đầu tư của Quỹ trong kỳ Change of Net Asset Value due to investment related activities during the period | 2241 | 17,664,414,438 | 21,303,539,550 | (13,402,726,724) |
| 2 | Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ liên quan tới nhà đầu tư trong kỳ Change of Net Asset Value related to investors during the period | 2242 | - | - | - |
| 3 | Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do việc phân phối thu nhập của Quỹ cho các nhà đầu tư trong kỳ Change of Net Asset Value due to profit distribution to investors during the period | 2242.1 | - | - | - |
| 4 | Thay đổi GTTSR do mua lại, phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ Change of Net Asset Value due to subscription, redemption during the period | 2242.2 | - | - | - |
| **VIII** | **Giá trị tài sản ròng cuối kỳ Net Asset Value at the end of period** | **2243** | **166,506,787,205** | **148,842,372,767** | **166,506,787,205** |

| TT<br>NO | Chỉ tiêu<br>Indicators | Mã chỉ tiêu<br>Code | Kỳ báo cáo<br>This period | Kỳ trước<br>Previous period | Lũy kế từ đầu năm<br>Accumulated figure from the beginning of the year |
|---|---|---|---|---|---|
| IX | Lợi nhuận bình quân năm (chỉ áp dụng đối với báo cáo năm)<br>Average income (applicable for annual report) | 2244 | | | |
| | Tỷ suất lợi nhuận bình quân năm (chỉ áp dụng đối với báo cáo năm)<br>Profit margin (applicable for annual report) | 2245 | | | - |
| | | | | | |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
Authorised Representative of Supervisory Bank

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám Đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF**
**Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:**
Management Fund Company name:
**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:**
Supervising bank:
**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Bank of Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:**
Fund name:
**Quỹ ETF SSIAM VNX50**
SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:**
Reporting Date:
Ngày 01 tháng 06 năm 2020
01 Jun 2020

## III. BÁO CÁO DANH MỤC ĐẦU TƯ/ INVESTMENT PORFOLIO REPORT

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Mã chỉ tiêu<br>Code | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price or fair value at reporting date | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **I** | **Cổ phiếu niêm yết<br>Listed equity** | **2246** | | | | |
| 1 | ACB | 0.1 | 316,442 | 22,900.0 | 7,246,521,800 | 4.35% |
| 2 | BVH | 0.2 | 13,390 | 49,950.0 | 668,830,500 | 0.40% |
| 3 | CII | 0.3 | 39,710 | 19,300.0 | 766,403,000 | 0.46% |
| 4 | CTD | 0.4 | 6,880 | 76,000.0 | 522,880,000 | 0.31% |
| 5 | CTG | 0.5 | 128,710 | 22,500.0 | 2,895,975,000 | 1.74% |
| 6 | DXG | 0.6 | 88,278 | 11,300.0 | 997,541,400 | 0.60% |
| 7 | EIB | 0.7 | 209,300 | 17,300.0 | 3,620,890,000 | 2.17% |
| 8 | FLC | 0.8 | 113,760 | 2,890.0 | 328,766,400 | 0.20% |
| 9 | FPT | 0.9 | 124,986 | 47,950.0 | 5,993,078,700 | 3.59% |
| 10 | GAS | 0.1 | 19,170 | 74,400.0 | 1,426,248,000 | 0.86% |
| 11 | GEX | 0.11 | 78,232 | 17,450.0 | 1,365,148,400 | 0.82% |
| 12 | GMD | 0.12 | 50,550 | 19,600.0 | 990,780,000 | 0.59% |
| 13 | HBC | 0.13 | 32,377 | 8,870.0 | 287,183,990 | 0.17% |
| 14 | HCM | 0.14 | 24,456 | 18,800.0 | 459,772,800 | 0.28% |
| 15 | HDB | 0.15 | 135,420 | 24,200.0 | 3,277,164,000 | 1.97% |
| 16 | HPG | 0.16 | 331,800 | 27,400.0 | 9,091,320,000 | 5.45% |
| 17 | HSG | 0.17 | 50,864 | 9,970.0 | 507,114,080 | 0.30% |
| 18 | KBC | 0.18 | 70,570 | 14,050.0 | 991,508,500 | 0.59% |
| 19 | MBB | 0.19 | 287,568 | 17,200.0 | 4,946,169,600 | 2.97% |
| 20 | MSN | 0.2 | 93,650 | 62,700.0 | 5,871,855,000 | 3.52% |
| 21 | MWG | 0.21 | 58,956 | 84,600.0 | 4,987,677,600 | 2.99% |
| 22 | NLG | 0.22 | 30,016 | 23,200.0 | 696,371,200 | 0.42% |
| 23 | NVL | 0.23 | 67,965 | 53,700.0 | 3,649,720,500 | 2.19% |
| 24 | PDR | 0.24 | 29,664 | 27,500.0 | 815,760,000 | 0.49% |
| 25 | PLX | 0.25 | 21,470 | 46,150.0 | 990,840,500 | 0.59% |
| 26 | PNJ | 0.26 | 36,086 | 63,100.0 | 2,277,026,600 | 1.37% |
| 27 | POW | 0.27 | 93,810 | 10,250.0 | 961,552,500 | 0.58% |
| 28 | PPC | 0.28 | 16,040 | 24,100.0 | 386,564,000 | 0.23% |
| 29 | PVD | 0.29 | 42,178 | 10,600.0 | 447,086,800 | 0.27% |
| 30 | PVS | 0.3 | 47,937 | 12,600.0 | 604,006,200 | 0.36% |
| 31 | REE | 0.31 | 31,050 | 31,250.0 | 970,312,500 | 0.58% |
| 32 | ROS | 0.32 | 56,810 | 3,500.0 | 198,835,000 | 0.12% |
| 33 | SAB | 0.33 | 14,130 | 176,400.0 | 2,492,532,000 | 1.49% |
| 34 | SBT | 0.34 | 52,889 | 14,900.0 | 788,046,100 | 0.47% |
| 35 | SHB | 0.35 | 247,727 | 14,000.0 | 3,468,178,000 | 2.08% |
| 36 | SSI | 0.36 | 72,476 | 14,800.0 | 1,072,644,800 | 0.64% |
| 37 | STB | 0.37 | 361,240 | 10,300.0 | 3,720,772,000 | 2.23% |
| 38 | TCB | 0.38 | 455,660 | 20,700.0 | 9,432,162,000 | 5.66% |
| 39 | TCH | 0.39 | 38,920 | 21,200.0 | 825,104,000 | 0.49% |
| 40 | TPB | 0.4 | 98,130 | 20,650.0 | 2,026,384,500 | 1.22% |
| 41 | VCB | 0.41 | 81,080 | 85,200.0 | 6,908,016,000 | 4.14% |
| 42 | VCG | 0.42 | 14,200 | 25,100.0 | 356,420,000 | 0.21% |
| 43 | VCS | 0.43 | 14,281 | 67,000.0 | 956,827,000 | 0.57% |
| 44 | VGC | 0.44 | 31,430 | 18,800.0 | 590,884,000 | 0.35% |
| 45 | VHM | 0.45 | 164,710 | 76,600.0 | 12,616,786,000 | 7.57% |
| 46 | VIC | 0.46 | 158,437 | 97,000.0 | 15,368,389,000 | 9.22% |
| 47 | VJC | 0.47 | 52,466 | 113,000.0 | 5,928,658,000 | 3.56% |
| 48 | VNM | 0.48 | 153,182 | 115,000.0 | 17,615,930,000 | 10.56% |
| 49 | VPB | 0.49 | 341,767 | 23,350.0 | 7,980,259,450 | 4.79% |
| 50 | VRE | 0.5 | 182,049 | 27,500.0 | 5,006,347,500 | 3.00% |

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Mã chỉ tiêu<br>Code | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price or fair value at reporting date | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | **Tổng<br>Total** | **2247** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **II** | **Cổ phiếu không niêm yết<br>Unlisted shares** | **2248** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **2249** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại cổ phiếu<br>Total shares** | **2250** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **III** | **Trái phiếu<br>Bonds** | **2251** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **2252** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| **IV** | **Các loại chứng khoán khác<br>Other sercurities** | **2253** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Quyền mua<br>Rights | 2253.1 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2254** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại chứng khoán<br>Total investment** | **2255** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **V** | **Các tài sản khác<br>Other assets** | **2256** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Dự thu cổ tức, tiền lãi chưa đến ngày nhận<br>Accrual dividend, interest income | 2256.1 | - | - | 108,684,000 | 0.07% |
| 2 | Trả trước phí quản lý niêm yết của Sở giao dịch chứng khoán<br>Prepaid expense for listing management of Stock Exchange | 2256.2 | - | - | 17,541,016 | 0.01% |
| 3 | Tiền bán chứng khoán phải thu<br>Receivables from investments sold but not yet settled | 2256.3 | - | - | - | 0.00% |
| 4 | Phải thu khác<br>Other receivables | 2256.4 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2257** | **-** | **-** | **126,225,016** | **0.08%** |
| **VI** | **Tiền<br>Cash** | **2258** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | Tiền mặt<br>Cash | 2259 | - | - | 242,701,301 | 0.15% |
| | Chứng chỉ tiền gửi<br>Certificate of deposit | 2260 | - | - | - | 0.00% |
| | Công cụ chuyển nhượng...<br>Registered certificate of deposit | 2261 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2262** | **-** | **-** | **242,701,301** | **0.15%** |
| **VII** | **Tổng giá trị danh mục<br>Total value of portfolio** | **2263** | **5,282,869** | **-** | **166,764,171,237** | **100.00%** |
| | | | | | | |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
Authorised Representative of Supervisory Bank

M.S.C.N: 0100150019-073 - C.T.C.P
NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM CHI NHÁNH HÀ THÀNH
Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

S.G.P: TP - C.T.T.N.H.H
CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI
Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF**
**Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:** **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
Management Fund Company name: SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:** **Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Supervising bank: Bank of Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:** **Quỹ ETF SSIAM VNX50**
Fund name: SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:** Ngày 01 tháng 06 năm 2020
Reporting Date: 01 Jun 2020

## III. BÁO CÁO DANH MỤC ĐẦU TƯ/ INVESTMENT PORFOLIO REPORT

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Mã chỉ tiêu<br>Code | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price or fair value at reporting date | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **I** | **Cổ phiếu niêm yết<br>Listed equity** | **2246** | | | | |
| 1 | ACB | 0.1 | 316,442 | 22,900.0 | 7,246,521,800 | 4.35% |
| 2 | BVH | 0.2 | 13,390 | 49,950.0 | 668,830,500 | 0.40% |
| 3 | CII | 0.3 | 39,710 | 19,300.0 | 766,403,000 | 0.46% |
| 4 | CTD | 0.4 | 6,880 | 76,000.0 | 522,880,000 | 0.31% |
| 5 | CTG | 0.5 | 128,710 | 22,500.0 | 2,895,975,000 | 1.74% |
| 6 | DXG | 0.6 | 88,278 | 11,300.0 | 997,541,400 | 0.60% |
| 7 | EIB | 0.7 | 209,300 | 17,300.0 | 3,620,890,000 | 2.17% |
| 8 | FLC | 0.8 | 113,760 | 2,890.0 | 328,766,400 | 0.20% |
| 9 | FPT | 0.9 | 124,986 | 47,950.0 | 5,993,078,700 | 3.59% |
| 10 | GAS | 0.1 | 19,170 | 74,400.0 | 1,426,248,000 | 0.86% |
| 11 | GEX | 0.11 | 78,232 | 17,450.0 | 1,365,148,400 | 0.82% |
| 12 | GMD | 0.12 | 50,550 | 19,600.0 | 990,780,000 | 0.59% |
| 13 | HBC | 0.13 | 32,377 | 8,870.0 | 287,183,990 | 0.17% |
| 14 | HCM | 0.14 | 24,456 | 18,800.0 | 459,772,800 | 0.28% |
| 15 | HDB | 0.15 | 135,420 | 24,200.0 | 3,277,164,000 | 1.97% |
| 16 | HPG | 0.16 | 331,800 | 27,400.0 | 9,091,320,000 | 5.45% |
| 17 | HSG | 0.17 | 50,864 | 9,970.0 | 507,114,080 | 0.30% |
| 18 | KBC | 0.18 | 70,570 | 14,050.0 | 991,508,500 | 0.59% |
| 19 | MBB | 0.19 | 287,568 | 17,200.0 | 4,946,169,600 | 2.97% |
| 20 | MSN | 0.2 | 93,650 | 62,700.0 | 5,871,855,000 | 3.52% |
| 21 | MWG | 0.21 | 58,956 | 84,600.0 | 4,987,677,600 | 2.99% |
| 22 | NLG | 0.22 | 30,016 | 23,200.0 | 696,371,200 | 0.42% |
| 23 | NVL | 0.23 | 67,965 | 53,700.0 | 3,649,720,500 | 2.19% |
| 24 | PDR | 0.24 | 29,664 | 27,500.0 | 815,760,000 | 0.49% |
| 25 | PLX | 0.25 | 21,470 | 46,150.0 | 990,840,500 | 0.59% |
| 26 | PNJ | 0.26 | 36,086 | 63,100.0 | 2,277,026,600 | 1.37% |
| 27 | POW | 0.27 | 93,810 | 10,250.0 | 961,552,500 | 0.58% |
| 28 | PPC | 0.28 | 16,040 | 24,100.0 | 386,564,000 | 0.23% |
| 29 | PVD | 0.29 | 42,178 | 10,600.0 | 447,086,800 | 0.27% |
| 30 | PVS | 0.3 | 47,937 | 12,600.0 | 604,006,200 | 0.36% |
| 31 | REE | 0.31 | 31,050 | 31,250.0 | 970,312,500 | 0.58% |
| 32 | ROS | 0.32 | 56,810 | 3,500.0 | 198,835,000 | 0.12% |
| 33 | SAB | 0.33 | 14,130 | 176,400.0 | 2,492,532,000 | 1.49% |
| 34 | SBT | 0.34 | 52,889 | 14,900.0 | 788,046,100 | 0.47% |
| 35 | SHB | 0.35 | 247,727 | 14,000.0 | 3,468,178,000 | 2.08% |
| 36 | SSI | 0.36 | 72,476 | 14,800.0 | 1,072,644,800 | 0.64% |
| 37 | STB | 0.37 | 361,240 | 10,300.0 | 3,720,772,000 | 2.23% |
| 38 | TCB | 0.38 | 455,660 | 20,700.0 | 9,432,162,000 | 5.66% |
| 39 | TCH | 0.39 | 38,920 | 21,200.0 | 825,104,000 | 0.49% |
| 40 | TPB | 0.4 | 98,130 | 20,650.0 | 2,026,384,500 | 1.22% |
| 41 | VCB | 0.41 | 81,080 | 85,200.0 | 6,908,016,000 | 4.14% |
| 42 | VCG | 0.42 | 14,200 | 25,100.0 | 356,420,000 | 0.21% |
| 43 | VCS | 0.43 | 14,281 | 67,000.0 | 956,827,000 | 0.57% |
| 44 | VGC | 0.44 | 31,430 | 18,800.0 | 590,884,000 | 0.35% |
| 45 | VHM | 0.45 | 164,710 | 76,600.0 | 12,616,786,000 | 7.57% |
| 46 | VIC | 0.46 | 158,437 | 97,000.0 | 15,368,389,000 | 9.22% |
| 47 | VJC | 0.47 | 52,466 | 113,000.0 | 5,928,658,000 | 3.56% |
| 48 | VNM | 0.48 | 153,182 | 115,000.0 | 17,615,930,000 | 10.56% |
| 49 | VPB | 0.49 | 341,767 | 23,350.0 | 7,980,259,450 | 4.79% |
| 50 | VRE | 0.5 | 182,049 | 27,500.0 | 5,006,347,500 | 3.00% |

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Mã chỉ tiêu<br>Code | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price or fair value at reporting date | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | **Tổng<br>Total** | **2247** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **II** | **Cổ phiếu không niêm yết<br>Unlisted shares** | **2248** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **2249** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại cổ phiếu<br>Total shares** | **2250** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **III** | **Trái phiếu<br>Bonds** | **2251** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **2252** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| **IV** | **Các loại chứng khoán khác<br>Other sercurities** | **2253** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Quyền mua<br>Rights | 2253.1 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2254** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại chứng khoán<br>Total investment** | **2255** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **V** | **Các tài sản khác<br>Other assets** | **2256** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Dự thu cổ tức, tiền lãi chưa đến ngày nhận<br>Accrual dividend, interest income | 2256.1 | - | - | 108,684,000 | 0.07% |
| 2 | Trả trước phí quản lý niêm yết của Sở giao dịch chứng khoán<br>Prepaid expense for listing management of Stock Exchange | 2256.2 | - | - | 17,541,016 | 0.01% |
| 3 | Tiền bán chứng khoán phải thu<br>Receivables from investments sold but not yet settled | 2256.3 | - | - | - | 0.00% |
| 4 | Phải thu khác<br>Other receivables | 2256.4 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2257** | **-** | **-** | **126,225,016** | **0.08%** |
| **VI** | **Tiền<br>Cash** | **2258** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | Tiền mặt<br>Cash | 2259 | - | - | 242,701,301 | 0.15% |
| | Chứng chỉ tiền gửi<br>Certificate of deposit | 2260 | - | - | - | 0.00% |
| | Công cụ chuyển nhượng...<br>Registered certificate of deposit | 2261 | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **2262** | **-** | **-** | **242,701,301** | **0.15%** |
| **VII** | **Tổng giá trị danh mục<br>Total value of portfolio** | **2263** | **5,282,869** | **-** | **166,764,171,237** | **100.00%** |
| | | | | | | |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
Authorised Representative of Supervisory Bank

NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM CHI NHÁNH HÀ THÀNH

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF
Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)*
*(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)*

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:**
Management Fund Company name:
**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:**
Supervising bank:
**Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:**
Fund name:
**Quỹ ETF SSIAM VNX50**
SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:**
Reporting Date:
Ngày 01 tháng 06 năm 2020
01 Jun 2020

**IV. BÁO CÁO VỀ GIAO DỊCH TÀI SẢN/ REPORT ON ASSET TRANSACTIONS**

| STT No. | Nội dung hoạt động (nêu chi tiết theo mục tiêu và đối tác) Description | Mã chỉ tiêu Code | Đối tác Counterparty | Mục tiêu/Tài sản đảm bảo Collateral | Kỳ hạn Term | Giá trị khoản vay hoặc khoản cho vay Amount | Thời điểm giao dịch As at transaction date | | Thời điểm báo cáo As at reporting date | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | | Ngày tháng năm Date | Tỷ lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ Balance/NAV | Ngày tháng năm Date | Tỷ lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ Balance/NAV |
| 1.1 | Vay tiền *(nêu chi tiết từng hợp đồng)* *Borrowings (detail by each contract)* | 2287 | | | | | | | | |
| I | Tỷ lệ tiền vay từ các hợp đồng/giá trị tài sản ròng Borowings/NAV | 2288 | | | | | | | | |
| 1.2 | Hợp đồng Repo *(nêu chi tiết từng hợp đồng)* *Repo (detail by each contract)* | 2289 | | | | | | | | |
| II | Tổng giá trị các hợp đồng Repo/giá trị tài sản ròng Repo/NAV | 2290 | | | | | | | | |
| A | Tổng giá trị các khoản vay/giá trị tài sản ròng (=I+II) Total Borrowings, Repo/NAV | 2291 | | | | | | | | |
| 2.1 | Cho vay chứng khoán *(nêu chi tiết từng hợp đồng)* *Margin (detail by each contract)* | 2292 | | | | | | | | |
| I | Tổng giá trị các hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ Total Margin/NAV | 2294 | | | | | | | | |
| 2.2 | Hợp đồng Reverse Repo *(nêu chi tiết từng hợp đồng)* *Reverse Repo (Detail by each contract)* | 2295 | | | | | | | | |
| II | Tổng giá trị các hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ Reverse Repo/NAV | 2296 | | | | | | | | |
| B | Tổng giá trị các khoản cho vay/giá trị tài sản ròng (=III + IV) Total Loans/NAV | 2297 | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
*Authorised Representative of Supervisory Bank*

NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM CHI NHÁNH HÀ THÀNH

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - CN Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
*Authorised Representative of Fund Management Company*

CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI

**Công ty TNHH Quản lý Quỹ SSI**
Trần Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Phụ lục 07. Mẫu báo cáo hoạt động đầu tư của quỹ ETF**
**Appendix 07. Report on ETF Fund's Investment Activities**

(Ban hành kèm theo Thông tư số 91/2019/TT-BTC ngày 31 tháng 12 năm 2019 của Bộ Tài chính)
(Issued in association with Circular 91/2019/TT-BTC)

# BÁO CÁO CHUNG VỀ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ ETF
# REPORT ON ETF FUND'S INVESTMENT ACTIVITIES

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

**Tên công ty quản lý quỹ:**
Management Fund Company name:
**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**
SSI Asset Management Company Limited

**Tên ngân hàng giám sát:**
Supervising bank:
**Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**
Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch

**Tên Quỹ:**
Fund name:
**Quỹ ETF SSIAM VNX50**
SSIAM VNX50 ETF

**Ngày lập báo cáo:**
Ngày 01 tháng 06 năm 2020

## V. MỘT SỐ CHỈ TIÊU KHÁC/ OTHER INDICATORS

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| TT<br>NO | Chỉ tiêu<br>Indicators | Mã chỉ tiêu<br>Code | Kỳ báo cáo<br>This period | Kỳ trước<br>Previous period |
|---|---|---|---|---|
| **I** | **Các chỉ tiêu về hiệu quả hoạt động**<br>**Investment performance indicators** | **2264** | | |
| 1 | Tỷ lệ phí quản lý trả cho công ty quản lý quỹ/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)<br>Management expense over average NAV ratio (%) | 2265 | 0.66% | 0.64% |
| 2 | Tỷ lệ phí lưu ký, giám sát trả cho NHGS/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)<br>Custodian and supervising fee expense over average NAV ratio (%) | 2266 | 0.17% | 0.22% |
| 3 | Tỷ lệ chi phí dịch vụ quản trị quỹ,chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng và các chi phí khác mà công ty quản lý quỹ trả cho tổ chức cung cấp dịch vụ có liên quan/Giá trị tài sản ròng của quỹ trung bình trong kỳ (%)Outsourcing service expenses over average NAV ratio (%) | 22661 | 0.21% | 0.26% |
| 4 | Chi phí kiểm toán trả cho tổ chức kiểm toán (nếu phát sinh)/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)<br>Audit fee expense over average NAV ratio (%) | 2267 | 0.04% | 0.04% |
| 5 | Chi phí dịch vụ tư vấn pháp lý, dịch vụ báo giá và các dịch vụ hợp lý khác, thù lao trả cho ban đại diện quỹ/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)<br>Legal consultancy, OTC price quotation and other valid service fees; Board of Representatives' remuneration expense over average NAV ratio (%) | 2268 | 0.11% | 0.12% |
| 6 | Tỷ lệ chi phí hoạt động/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)<br>Operating expense over average NAV ratio (%) | 2269 | 1.31% | 1.41% |
| 7 | Tốc độ vòng quay danh mục trong kỳ (%) = (Tổng giá trị danh mục mua vào + tổng giá trị danh mục bán ra)/Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ<br>Portfolio turnover rate (%) = (total value of buy-in portfolio + total proceeds of sale-out portfolio) / 2 / Average NAV | 2270 | 13.81% | 11.75% |
| **II** | **Các chỉ tiêu khác**<br>**Other indicators** | **2272** | | |
| 1 | Quy mô quỹ đầu kỳ<br>Fund scale at the beginning of the period | 2273 | 142,000,000,000.00 | 142,000,000,000.00 |
| | Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ<br>Total value of outstanding Fund Certificate at the beginning of period | 2274 | 142,000,000,000.00 | 142,000,000,000.00 |
| | Tổng số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ<br>Total number of outstanding Fund Certificate at the beginning of period | 2275 | 14,200,000.00 | 14,200,000.00 |
| 2 | Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ<br>Change of Fund scale during the period | 2276 | 0.00 | 0.00 |
| | Số lượng chứng chỉ quỹ phát hành thêm trong kỳ<br>Number of Fund Certificates subscribed during the period | 2277 | 0.00 | 0.00 |
| | Giá trị vốn thực huy động thêm trong kỳ<br>Net subscription amount in period | 2277.1 | 0.00 | 0.00 |
| | Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ<br>Number of Fund Certificates redeemed during the period | 2278 | 0.00 | 0.00 |
| | Giá trị vốn phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư (theo mệnh giá)<br>Net redemption amount in period (based on par value) | 2278.1 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | Quy mô quỹ cuối kỳ<br>Fund scale at the end of the period | 2279 | 142,000,000,000.00 | 142,000,000,000.00 |
| | Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành cuối kỳ<br>Total value of outstanding Fund Certificate at the end of the period | 2280 | 142,000,000,000.00 | 142,000,000,000.00 |

| TT<br>NO | Chỉ tiêu<br>Indicators | Mã chỉ tiêu<br>Code | Kỳ báo cáo<br>This period | Kỳ trước<br>Previous period |
|---|---|---|---|---|
| | Tổng số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành cuối kỳ<br>Total number of outstanding Fund Certificate at the end of the period | 2281 | 14,200,000.00 | 14,200,000.00 |
| 4 | Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người có liên quan cuối kỳ<br>Fund Management Company and related parties' ownership ratio at the end of the period | 2282 | 9.87% | 9.87% |
| 5 | Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ<br>Top 10 investors' ownership ratio at the end of the period | 2283 | 86.48% | 87.20% |
| 6 | Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ<br>Foreign investors' ownership ratio at the end of the period | 2284 | 69.18% | 68.5884% |
| | Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh<br>Number of investors of the Fund at the end of the period | | 216 | 215 |
| 7 | Giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ quỹ cuối kỳ<br>Net asset value per Fund Certificate at the end of period | 2285 | 11,725.83 | 10,481.85 |
| 8 | Giá trị thị trường trên một chứng chỉ quỹ cuối kỳ<br>Market value per Fund Certificate at the end of period | 2286 | 11,800.00 | 10,520.00 |

Ghi chú / Notes:

Các chỉ tiêu từ 1 đến 7 của "Chỉ tiêu về hiệu quả hoạt động" đã được điều chỉnh để phản ánh số liệu trên cơ sở hoạt động tròn năm bằng cách nhân các chỉ tiêu này với 12 (đối với báo cáo tháng), 4 (đối với báo cáo quý), 2 (đối với báo cáo bán niên), 1 (đối với báo cáo năm).

*All Indicator starting from number 1 to 7 of "Investment performance indicators" are annualized to reflect a rate that is based on a full year operation by multiplying these indicators with 12 (monthly report) or 4 (quarterly report) or 2 (semi-annual report) or 1 (annual report).*

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
Authorised Representative of Supervisory Bank

M.S.C.N: 0100150619-073 NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM CHI NHÁNH HÀ THÀNH Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý Quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

S.G.P: 19 - C.T.T.N.H.H CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI Q. HOÀN KIẾM - TP. HÀ NỘI

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

*Phụ lục số 15: Báo cáo về thay đổi giá trị tài sản ròng*
***Apppendix 15: Report on change of Net Asset Value***

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 229/2012/TT-BTC ngày 27 tháng 12 năm 2012 của Bộ Tài chính hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)*
*(Issued in association with Circular 229/2012/TT-BTC on 27 December 2012 guiding establishment and management of the Exchange Traded Fund)*

## GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG CỦA QUỸ
## NET ASSET VALUE OF FUND

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

1. **Tên Công ty quản lý quỹ:** / Management Fund Company name: — **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI** / SSI Asset Management Company Limited
2. **Tên Ngân hàng giám sát:** / Supervising bank: — **Ngân Hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành** / Bank for Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch
3. **Tên Quỹ:** / Fund name: — **Quỹ ETF SSIAM VNX50** / SSIAM VNX50 ETF
4. **Ngày lập báo cáo:** / Reporting Date: — Ngày 01 tháng 06 năm 2020 / 01 Jun 2020

*Đơn vị tính/Currency: VND*

| STT NO | CHỈ TIÊU CRITERIA | KỲ BÁO CÁO THIS PERIOD | KỲ TRƯỚC LAST PERIOD |
|---|---|---|---|
| A | **Giá trị tài sản ròng** Net Assest Value | | |
| A.1 | **Giá trị tài sản ròng (NAV) đầu kỳ** Net Asset Value (NAV) at the beginning of period | | |
| | *của quỹ/ per Fund* | 148,842,372,767 | 127,538,833,217 |
| | *của một lô chứng chỉ quỹ/ per lot of Fund Certificate* | 1,048,185,723 | 898,160,797 |
| | *của một chứng chỉ quỹ/ per Fund Certificate* | 10,481.85 | 8,981.60 |
| A.2 | **Giá trị tài sản ròng (NAV) cuối kỳ** Net Asset Value (NAV) at the end of period | | |
| | *của quỹ/ per Fund* | 166,506,787,205 | 148,842,372,767 |
| | *của một lô chứng chỉ quỹ/ per lot of Fund Certificate* | 1,172,583,008 | 1,048,185,723 |
| | *của một chứng chỉ quỹ/ per Fund Certificate* | 11,725.83 | 10,481.85 |
| A.3 | **Thay đổi giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ Quỹ trong kỳ, trong đó:** Change of NAV per Fund Certificate during perdiod, in Which: | 1,243.98 | 1,500.25 |
| | *Thay đổi do biến động thị trường và các hoạt động giao dịch của Quỹ trong kỳ* *Changes of NAV due to market fluctuation and the fund's investment during the period* | 1,243.98 | 1,500.25 |
| | ***Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ liên quan tới nhà đầu tư trong kỳ*** ***Change of net asset value related to investors during the period*** | - | - |
| | *Thay đổi NAV do phân chia lợi nhuận cho nhà đầu tư trong kỳ* *Change of NAV due to profit distribution to investors during the period* | | |
| | *Thay đổi GTTSR do mua lại, phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ* *Change of NAV due to subcription, redemption during the period* | - | - |
| A.4 | **Giá trị tài sản ròng cao nhất/thấp nhất trong vòng 52 tuần gần nhất** Highest/Lowest NAV within latest 52 weeks | | |
| | *Giá trị cao nhất (VND)/ Highest Value (VND)* | 188,316,485,945 | 188,316,485,945 |
| | *Giá trị thấp nhất (VND)/ Lowest Value (VND)* | 127,538,833,217 | 122,079,150,333 |
| B | **Giá trị thị trường (giá đóng cửa cuối phiên giao dịch trong ngày báo cáo) của một chứng chỉ Quỹ** Market value of a Fund Certificate (closing price of the last trading session of the reporting date) | | |
| B.1 | **Giá trị đầu kỳ** Beginning perriod Value | 10,520 | 8,800 |
| B.2 | **Giá trị cuối kỳ** Ending period Value | 11,800 | 10,520 |
| B.3 | **Thay đổi giá trị thị trường trong kỳ so với kỳ trước** Change of market value in the period in comparision to the last period | 1,280 | 1,720 |
| B.4 | **Chênh lệch giữa giá thị trường của chứng chỉ Quỹ và giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ Quỹ** Difference between Market Value per Fund Certificate and NAV per Fund Certificate | | |
| | *Chênh lệch tuyệt đối (VND)/ Absolute difference (VND)* | 74.17 | 38.15 |
| | *Chênh lệch tương đối (mức độ chiết khấu (-)/thặng dư (+))/ Relative differnce (discount(-)/ premium(+))* | 0.63% | 0.36% |
| B.5 | **Giá trị thị tường cao nhất/thấp nhất trong vòng 52 tuần gần nhất** Highest/lowest Market Value within latest 52 weeks | | |
| | *Giá trị cao nhất (VND)/ Highest Value (VND)* | 13,650 | 13,650 |
| | *Giá trị thấp nhất (VND)/ Lowest Value (VND)* | 8,800 | 8,800 |

**Đại diện có thẩm quyền của Ngân hàng giám sát**
*Authorised Representative of Supervisory Bank*

NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI CỔ PHẦN ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM CHI NHÁNH HÀ THÀNH

**Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - CN Hà Thành**
**Ngô Thị Thu Cúc**
Phó Giám đốc

**Đại diện có thẩm quyền của Công ty quản lý quỹ**
Authorised Representative of Fund Management Company

CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI

**Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**

Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

**Mẫu số B04 - ETF: Báo cáo danh mục đầu tư**
**Template B04 - ETF: Investment portfolio report**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 181/2015/TT-BTC ngày 13 tháng 11 năm 2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)*
*(Issued in association with Circular 181/2015/TT-BTC guiding establishment and management of Exchange Traded Fund)*

## BÁO CÁO DANH MỤC ĐẦU TƯ
## INVESTMENT PORTFOLIO REPORT

*Tại ngày 31 tháng 05 năm 2020 - As at 31 May 2020*

| | | |
|---|---|---|
| 1 | **Tên Công ty quản lý quỹ:**<br>Management Fund Company | **Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI**<br>SSI Asset Management Company Limited |
| 2 | **Tên ngân hàng giám sát:**<br>Supervising bank: | **Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành**<br>Bank of Investment and Development of Vietnam Jsc - Hathanh Branch |
| 3 | **Tên Quỹ:**<br>Fund name: | **Quỹ ETF SSIAM VNX50**<br>SSIAM VNX50 ETF |
| 4 | **Ngày lập báo cáo:**<br>Reporting Date: | Ngày 01 tháng 06 năm 2020<br>01 Jun 2020 |

Đơn vị tính/Currency: VND

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|
| **I** | **Cổ phiếu niêm yết**<br>**Listed equity** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| 1 | ACB | 316,442 | 22,900.0 | 7,246,521,800 | 4.35% |
| 2 | BVH | 13,390 | 49,950.0 | 668,830,500 | 0.40% |
| 3 | CII | 39,710 | 19,300.0 | 766,403,000 | 0.46% |
| 4 | CTD | 6,880 | 76,000.0 | 522,880,000 | 0.31% |
| 5 | CTG | 128,710 | 22,500.0 | 2,895,975,000 | 1.74% |
| 6 | DXG | 88,278 | 11,300.0 | 997,541,400 | 0.60% |
| 7 | EIB | 209,300 | 17,300.0 | 3,620,890,000 | 2.17% |
| 8 | FLC | 113,760 | 2,890.0 | 328,766,400 | 0.20% |
| 9 | FPT | 124,986 | 47,950.0 | 5,993,078,700 | 3.59% |
| 10 | GAS | 19,170 | 74,400.0 | 1,426,248,000 | 0.86% |
| 11 | GEX | 78,232 | 17,450.0 | 1,365,148,400 | 0.82% |
| 12 | GMD | 50,550 | 19,600.0 | 990,780,000 | 0.59% |
| 13 | HBC | 32,377 | 8,870.0 | 287,183,990 | 0.17% |
| 14 | HCM | 24,456 | 18,800.0 | 459,772,800 | 0.28% |
| 15 | HDB | 135,420 | 24,200.0 | 3,277,164,000 | 1.97% |
| 16 | HPG | 331,800 | 27,400.0 | 9,091,320,000 | 5.45% |
| 17 | HSG | 50,864 | 9,970.0 | 507,114,080 | 0.30% |
| 18 | KBC | 70,570 | 14,050.0 | 991,508,500 | 0.59% |
| 19 | MBB | 287,568 | 17,200.0 | 4,946,169,600 | 2.97% |
| 20 | MSN | 93,650 | 62,700.0 | 5,871,855,000 | 3.52% |
| 21 | MWG | 58,956 | 84,600.0 | 4,987,677,600 | 2.99% |
| 22 | NLG | 30,016 | 23,200.0 | 696,371,200 | 0.42% |
| 23 | NVL | 67,965 | 53,700.0 | 3,649,720,500 | 2.19% |
| 24 | PDR | 29,664 | 27,500.0 | 815,760,000 | 0.49% |
| 25 | PLX | 21,470 | 46,150.0 | 990,840,500 | 0.59% |
| 26 | PNJ | 36,086 | 63,100.0 | 2,277,026,600 | 1.37% |
| 27 | POW | 93,810 | 10,250.0 | 961,552,500 | 0.58% |
| 28 | PPC | 16,040 | 24,100.0 | 386,564,000 | 0.23% |
| 29 | PVD | 42,178 | 10,600.0 | 447,086,800 | 0.27% |
| 30 | PVS | 47,937 | 12,600.0 | 604,006,200 | 0.36% |
| 31 | REE | 31,050 | 31,250.0 | 970,312,500 | 0.58% |
| 32 | ROS | 56,810 | 3,500.0 | 198,835,000 | 0.12% |
| 33 | SAB | 14,130 | 176,400.0 | 2,492,532,000 | 1.49% |
| 34 | SBT | 52,889 | 14,900.0 | 788,046,100 | 0.47% |
| 35 | SHB | 247,727 | 14,000.0 | 3,468,178,000 | 2.08% |
| 36 | SSI | 72,476 | 14,800.0 | 1,072,644,800 | 0.64% |
| 37 | STB | 361,240 | 10,300.0 | 3,720,772,000 | 2.23% |
| 38 | TCB | 455,660 | 20,700.0 | 9,432,162,000 | 5.66% |
| 39 | TCH | 38,920 | 21,200.0 | 825,104,000 | 0.49% |
| 40 | TPB | 98,130 | 20,650.0 | 2,026,384,500 | 1.22% |

| STT | Loại tài sản<br>Asset types | Số lượng<br>Quantity | Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo<br>Market price | Tổng giá trị<br>Total value | Tỷ lệ %/Tổng giá trị tài sản của quỹ<br>%/Total asset value of the Fund |
|---|---|---|---|---|---|
| 41 | VCB | 81,080 | 85,200.0 | 6,908,016,000 | 4.14% |
| 42 | VCG | 14,200 | 25,100.0 | 356,420,000 | 0.21% |
| 43 | VCS | 14,281 | 67,000.0 | 956,827,000 | 0.57% |
| 44 | VGC | 31,430 | 18,800.0 | 590,884,000 | 0.35% |
| 45 | VHM | 164,710 | 76,600.0 | 12,616,786,000 | 7.57% |
| 46 | VIC | 158,437 | 97,000.0 | 15,368,389,000 | 9.22% |
| 47 | VJC | 52,466 | 113,000.0 | 5,928,658,000 | 3.56% |
| 48 | VNM | 153,182 | 115,000.0 | 17,615,930,000 | 10.56% |
| 49 | VPB | 341,767 | 23,350.0 | 7,980,259,450 | 4.79% |
| 50 | VRE | 182,049 | 27,500.0 | 5,006,347,500 | 3.00% |
| **II** | **Cổ phiếu không niêm yết<br>Unlisted shares** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại cổ phiếu<br>Total shares** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **III** | **Trái phiếu<br>Bonds** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng<br>Total** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| **IV** | **Các loại chứng khoán khác<br>Other sercurities** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Quyền mua<br>Rights | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | **Tổng các loại chứng khoán<br>Total investment** | **5,282,869** | **-** | **166,395,244,920** | **99.78%** |
| **V** | **Các tài sản khác<br>Other assets** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| 1 | Dự thu cổ tức, tiền lãi chưa đến ngày nhận<br>Accrual dividend, interest income | - | - | 108,684,000 | 0.07% |
| 2 | Trả trước phí quản lý niêm yết của Sở giao dịch chứng khoán<br>Prepaid expense for listing management of Stock Exchange | - | - | 17,541,016 | 0.01% |
| 3 | Tiền bán chứng khoán phải thu<br>Receivables from investments sold but not yet settled | - | - | - | 0.00% |
| 4 | Phải thu khác<br>Other receivables | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **-** | **-** | **126,225,016** | **0.08%** |
| **VI** | **Tiền<br>Cash** | **-** | **-** | **-** | **0.00%** |
| | Tiền mặt<br>Cash | - | - | 242,701,301 | 0.15% |
| | Chứng chỉ tiền gửi<br>Certificate of deposit | - | - | - | 0.00% |
| | Công cụ chuyển nhượng...<br>Registered certificate of deposit | - | - | - | 0.00% |
| | **Tổng<br>Total** | **-** | **-** | **242,701,301** | **0.15%** |
| **VII** | **Tổng giá trị danh mục<br>Total value of portfolio** | **5,282,869** | **-** | **166,764,171,237** | **100.00%** |
| | | | | | |

**Người lập biểu**
(Ký, họ tên)

Nguyễn Thị Quyên

**Kế toán trưởng**
(Ký, họ tên)

**Tổng giám đốc**
(Ký, họ tên, đóng dấu)

S.G.P: 19 - C.T.T.N.H.H
CÔNG TY TRÁCH NHIỆM HỮU HẠN QUẢN LÝ QUỸ SSI
Q. HOÀN KIẾM - T.P HÀ NỘI

Đỗ Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC