

Phụ lục số 16

Mẫu Báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ

(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)

BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ

Bán niên năm 2016

1. Thông tin về quỹ

a) Tên của quỹ, loại hình quỹ : **QUỸ ETF VFMVN30**

b) Mục tiêu đầu tư của quỹ :

Mục tiêu chính của Quỹ ETF VFMVN30 là là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số tổng thu nhập VN30 (VN30-TRI) sau khi trừ đi chi phí của Quỹ. Chỉ số VN30-TRI là chỉ số do Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh xây dựng và quản lý.

Quỹ sử dụng chiến lược đầu tư thụ động để thực hiện mục tiêu đầu tư đã định trước. Khi danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu có sự thay đổi thì Quỹ sẽ thực hiện điều chỉnh danh mục của Quỹ để phù hợp với danh mục của chỉ số tham chiếu về cơ cấu và tỷ trọng tài sản. Quỹ sẽ hướng đến việc có kết quả tương đồng với chỉ số tham chiếu và không thực hiện chiến lược phòng thủ khi thị trường giảm hay hiện thực hóa lợi nhuận khi thị trường được định giá quá cao. Việc đầu tư thụ động nhằm giảm thiểu chi phí và mô phỏng gần hơn chỉ số tham chiếu bằng cách duy trì tỷ lệ vòng quay vốn đầu tư thấp hơn so với các quỹ sử dụng chiến lược đầu tư chủ động.

c) Thời hạn hoạt động của quỹ (nếu có) : được tính từ ngày được UBCKNN cấp giấy thành lập quỹ và không giới hạn về thời hạn hoạt động

d) Danh mục tham chiếu (nếu có) : Danh mục chỉ số tổng thu nhập VN30

Mã cổ phiếu và tỷ trọng trong VN30 tại ngày 30/06/2016 như sau :

Mã cổ phiếu	Tỷ trọng(%)	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng(%)	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng(%)
BVH	1.90	HHS	0.64	PPC	0.54
CII	2.50	HPG	7.57	PVD	2.56
CTG	2.96	HSG	2.31	PVT	0.75
DPM	2.06	HVG	0.62	REE	1.81
EIB	4.69	ITA	0.85	SBT	1.35
FLC	1.19	KBC	1.90	SSI	3.55
FPT	7.28	KDC	1.64	STB	6.01
GMD	1.60	MBB	4.53	VCB	5.97
HAG	1.50	MSN	8.53	VIC	10.64
HCM	0.72	NT2	1.41	VNM	10.43

e) Chính sách phân chia lợi nhuận :

Được quy định theo điều lệ quỹ. Theo đó, Cổ tức Quỹ có thể được phân phối cho nhà đầu tư dựa trên báo cáo đã được kiểm toán, do đề xuất của Công ty quản lý quỹ và trình Đại hội nhà đầu tư gần nhất thông qua. Lợi tức chi trả cho nhà đầu tư được thanh toán bằng tiền hoặc bằng chứng chỉ quỹ phát hành thêm.

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành:

Tổng số chứng chỉ Quỹ tại ngày 01/01/2015	20,200,000	ccq
Tổng số lượng chứng Quỹ phát hành thêm trong kỳ	20,000,000	ccq
Tổng số lượng chứng Quỹ mua lại trong kỳ	2,500,000	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ Quỹ tại ngày 31/12/2015	37,700,000	ccq

g) Nội dung thay đổi tại Điều lệ Quỹ trong kỳ báo cáo (nếu có): được đề cập trong Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên 2015 của Quỹ ETF VFMVN30 ngày 05/04/2016.

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo: Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên 2015 của Quỹ ETF VFMVN30 ngày 05/04/2016 (đính kèm theo Văn bản này) thông qua nội dung kết quả hoạt động của Quỹ năm 2015, ngân sách, kế hoạch hoạt động, những thay đổi về điều lệ quỹ phù hợp với pháp luật...



ETF_AGM 2015_Nghi
quyet dai hoi-05April2

i) Ý kiến nhận xét của Ngân hàng giám sát về các nội dung quy định tại Điều 24 Thông tư hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ ETF : CTQLQ đáp ứng đúng các quy định tại điều 24 Thông tư hướng dẫn thành lập và quản lý Quỹ ETF.

2. Báo cáo về kết quả hoạt động của quỹ

-Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12 của 3 năm gần nhất: Quỹ được Ủy Ban Chứng Khoán nhà nước cấp giấy chứng nhận lập quỹ vào ngày 18/09/2014 theo giấy chứng nhận số 14/GCN-UBCK.

- Danh mục đầu tư của quỹ phân bố theo ngành, lĩnh vực và loại sản phẩm (cổ phiếu, trái phiếu...)
(không nêu chi tiết cả danh mục theo mã chứng khoán);

Danh mục đầu tư được phân bố theo tài sản như sau :

Loại tài sản	31/12/2014	31/12/2015	30/6/2016
Cổ phiếu	99.7%	99.8%	98.8%
Tiền và tương đương tiền	0.3%	0.2%	1.2%
Tổng	100.0%	100.0%	100%

Danh mục đầu tư được phân bổ theo ngành như sau :

Ngành	31/12/2014	31/12/2015	30/6/2016
Thực Phẩm, Nước Giải Khát & Thuốc Lá	24.1%	25.6%	22.2%
Ngân Hàng	22.3%	24.8%	23.9%
Bất Động Sản	12.5%	14.5%	13.8%
Vật Liệu	10.9%	9.2%	11.9%
Dịch Vụ Tài Chính	7.8%	6.2%	5.9%
Thiết Bị và Phần Cứng Công Nghệ	6.4%	6.8%	7.2%
Năng Lượng	4.9%	2.7%	3.3%
Hàng Hóa Công Nghiệp	4.2%	2.9%	4.0%
Vận Tải	2.0%	2.8%	4.1%
Ô-tô & Phụ Tùng Ô-tô	1.8%	0.4%	0%
Tiện ích Công Cộng	1.8%	1.5%	0.5%
Bảo Hiểm	1.1%	1.7%	1.9%
Bán Lẻ	0.0%	0.8%	0%
Tiền và tương đương tiền	0.3%	0.2%	1.2%
Tổng	100.0%	100.0%	100%

Về Giá trị tài sản ròng của quỹ :

Giá trị tài sản ròng	Tại 31/12/2015	Tại 30/06/2016
<i>của quỹ ETF</i>	358 784 823 112	344 103 683 319
<i>của một lô chứng chỉ quỹ ETF</i>	951,683,881	994,519,316
<i>của một chứng chỉ quỹ</i>	9,516.83	9,945.19

- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cao nhất trong kỳ báo cáo : 10,331.17 đồng

- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ thấp nhất trong kỳ báo cáo : 8,601.50 đồng

(Kỳ báo cáo tính từ 1/7/2015 đến 30/06/2016)

- 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) như sau :

STT	Chỉ tiêu	Số tiền
1	Lợi nhuận thu được từ sự tăng trưởng giá chứng khoán (giá trị lãi vốn)	14,901,883,264
2	Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...)	3,293,590,544
3	Lợi nhuận thu được từ bán cổ phiếu, trái phiếu	(985,220,144)
4	Tổng chi phí	(1,798,667,072)
	Tổng cộng	15,411,586,592

- Lợi nhuận đã phân phối trên một đơn vị quỹ (giá trị thuần và giá trị gộp) trong kỳ báo cáo, kể cả trong trường hợp chi trả bằng tiền mặt hoặc chi trả bằng đơn vị quỹ : không có
- Thời điểm phân chia lợi nhuận : không có
- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ trước và sau thời điểm phân chia lợi nhuận : không có
- Tỷ lệ chi phí hoạt động trên GTTSR trung bình trong kỳ (%) : 0.97%
- Tốc độ vòng quay danh mục trong kỳ/NAV trung bình trong kỳ : 47.34 %

a) Chi tiêu về lợi nhuận của quỹ:

Tổng lợi nhuận bình quân năm của quỹ phát sinh trong kỳ báo cáo xác định:

(i) trong thời hạn 12 tháng (1 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 1 năm) : 1,271,711,657.33 đồng

(ii) trong thời hạn 36 tháng (3 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 3 năm) : 338,401,629.14 đồng

(iii) trong thời hạn 60 tháng (5 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 5 năm) 338,401,629.14 đồng

b) Các chỉ tiêu so sánh khác, bảo đảm tuân thủ nguyên tắc:

- Phương thức, nguyên tắc xác định giá trị tài sản, giá trị lợi nhuận là thống nhất, đã được công bố và được thẩm định bởi một tổ chức độc lập khác : nguyên tắc xác định giá trị tài sản của Quỹ được quy định chi tiết trong Điều lệ Quỹ và sổ tay định giá của Quỹ.
- Dữ liệu được cung cấp bởi một tổ chức độc lập : Bảng báo giá chứng khoán được cung cấp bởi 3 Cty Chứng khoán độc lập của Quỹ và được Ban Đại diện phê duyệt hàng năm

c) Báo cáo phải nêu rõ khuyến cáo rằng các thông tin về kết quả hoạt động của quỹ trước đây chỉ mang tính tham khảo và không có nghĩa là việc đầu tư sẽ bảo đảm khả năng sinh lời cho nhà đầu tư.

3. Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ

Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ phải bao gồm các nội dung sau:

- a) Thuyết minh về việc thay đổi Công ty quản lý quỹ (nếu có) : không có
- b) Thuyết minh về việc quỹ có đạt được mục tiêu đầu tư (thuyết minh này chỉ cần thiết tại báo cáo hàng năm của quỹ) :

Mục tiêu của Quỹ là mô phỏng gần nhất kết quả hoạt động và sự biến động của chỉ số tổng thu nhập VN30. Trong sáu tháng đầu năm của năm 2016, Quỹ đã đạt được mục tiêu đề ra khi mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu chỉ ở mức thấp khoảng 0.35%.

CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ
 17/1/2017

c) So sánh kết quả lợi nhuận của quỹ với kết quả lợi nhuận của danh mục tham chiếu, chỉ số cơ sở công bố tại Bản cáo bạch trong cùng kỳ báo cáo (bằng đồ thị) :



d) So sánh kết quả lợi nhuận của quỹ với kết quả lợi nhuận của danh mục tham chiếu, chỉ số cơ sở công bố tại Bản cáo bạch trong khoảng thời gian năm (05) năm gần nhất, tính tới ngày báo cáo (bằng đồ thị) : không có

e) Mô tả chiến lược, chiến thuật đầu tư mà quỹ đã sử dụng trong kỳ báo cáo. Trường hợp có sự khác biệt giữa chiến lược, chiến thuật đầu tư thực hiện trong kỳ so với chiến lược, chiến thuật đầu tư đã công bố tại Bản cáo bạch, thì phải bổ sung thuyết minh và đánh giá ưu, nhược điểm của chiến lược, chiến thuật đầu tư đã thực hiện trong kỳ :

Quỹ ETF VFMVN30 sử dụng chiến lược đầu tư thụ động để thực hiện mục tiêu đầu tư đã định trước. Khi danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu có sự thay đổi thì Quỹ ETF VFMVN30 sẽ thực hiện điều chỉnh danh mục của Quỹ để phù hợp với danh mục của chỉ số tham chiếu về cơ cấu và tỷ trọng tài sản. Quỹ sẽ hướng đến việc có kết quả tương đồng với chỉ số tham chiếu và không thực hiện chiến lược phòng thủ khi thị trường giảm hay hiện thực hóa lợi nhuận khi thị trường được định giá quá cao. Việc đầu tư thụ động nhằm giảm thiểu chi phí và mô phỏng gần hơn chỉ số tham chiếu bằng cách duy trì tỷ lệ vòng quay vốn đầu tư thấp hơn so với các quỹ sử dụng chiến lược đầu tư chủ động.

f) Mô tả sự khác biệt về cơ cấu danh mục đầu tư của quỹ tại thời điểm báo cáo, so với danh mục đầu tư của quỹ năm liền kề năm báo cáo :

Cơ cấu danh mục đầu tư của Quỹ tại ngày 30/06/2016 không thay đổi nhiều so với cơ cấu danh mục đầu tư của quỹ năm liền kề khi tỷ trọng đầu tư cổ phiếu chiếm trên 95%, do Quỹ là loại hình quỹ hoán đổi danh mục mô phỏng theo chỉ số. Sự khác biệt chủ yếu giữa hai kỳ do sự thay đổi cơ cấu tỷ trọng một số ngành trong danh mục đầu tư.

g) Phân tích kết quả hoạt động của quỹ dựa trên việc so sánh giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ (sau khi đã điều chỉnh phần lợi nhuận đã phân phối, nếu có) tại kỳ báo cáo này so với tại kỳ báo cáo gần nhất :

Giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 30/06/2016 của Quỹ ETF VFMVN30 là 9,945.19 đồng tăng 4.5% so với giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 31/12/2015 của Quỹ ETF VFMVN30 là 9,516.8 đồng.

h) Đánh giá biến động của các thị trường trong kỳ báo cáo, kể cả thị trường nước ngoài, mà quỹ đầu tư vào, thông tin về lợi nhuận đầu tư đối với từng loại tài sản: cổ phiếu, cổ phiếu blue-chip, cổ phiếu các công ty có mức vốn hóa thấp (small- cap) :

Sáu tháng đầu năm của năm 2016 thị trường chứng khoán Việt Nam có sự tăng trưởng tốt về điểm số khi tăng trưởng chỉ số VN-Index tăng khoảng 9.2% so với cuối năm 2015. Tuy nhiên sự tăng trưởng sáu tháng đầu năm chủ yếu đến từ các cổ phiếu có vốn hoá vừa và nhỏ, các cổ phiếu vốn hoá lớn không có sự tăng trưởng nhiều. Thể hiện qua giá trị chỉ số VN30 đại diện cho các cổ phiếu có vốn hóa lớn và thanh khoản hàng đầu Việt Nam có mức tăng chỉ 4.4%, chỉ số các cổ phiếu có vốn hóa vừa (VNMid-cap) có mức tăng 16.6% và chỉ số các cổ phiếu có vốn hóa nhỏ (VNSmall-cap) có mức tăng 21.2%.

i) Thông tin về việc chia, tách đơn vị quỹ trong kỳ (nếu có); ảnh hưởng của việc chia tách đơn vị quỹ và giá trị tài sản ròng trên từng đơn vị quỹ (trước và sau khi chia, tách) : không có

j) Các trường hợp có ảnh hưởng tới quyền lợi của nhà đầu tư nắm giữ chứng chỉ quỹ: không có

k) Thông tin về các giao dịch với người có quyền lợi liên quan (nếu có);

- Số lượng chứng chỉ Quỹ bán ra cho những người có liên quan ngày 01/01/2016 đến 30/06/2016 : 3,100,000 CCQ

- Số lượng chứng chỉ Quỹ mua lại từ những người có liên quan từ ngày 01/01/2016 đến ngày 30/06/2016 : 6,200,000 CCQ

(Dữ liệu giao dịch sơ cấp)

m) Các thông tin khác (nếu có).

4. Báo cáo về hoạt động giám sát của Ngân hàng giám sát :

Ngân hàng giám sát phải đưa ra ý kiến về sự tuân thủ quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch của Công ty quản lý quỹ trong quá trình vận hành và quản lý quỹ ETF đối với các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi Ngân hàng giám sát (nếu có) : từ 01 tháng 01 năm 2016 đến ngày 30 tháng 06 năm 2016, Quỹ không thay đổi Ngân hàng giám sát

b) Việc đầu tư tuân thủ các hạn chế về đầu tư, hạn chế về vay theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch : Trong quá trình giám sát hoạt động đầu tư và các giao dịch tài sản của quỹ,

Công ty Cổ Phần Quản Lý Quỹ Đầu Tư Việt Nam đã tuân thủ các giới hạn về hạn mức đầu tư được quy định tại các văn bản pháp luật chứng khoán hiện hành về quỹ ETF VFMVN30, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan

c) Việc xác định giá trị tài sản ròng theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch :
Việc xác định giá trị tài sản ròng của Quỹ tuân thủ theo quy định của pháp luật và điều lệ Quỹ

d) Việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch

Từ ngày 01/01/2016 ngày 30/06/2016, Quỹ đã thực hiện:

- Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: phát hành thêm 3,100,000.00 chứng chỉ Quỹ với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 31,000,000,000 đồng;
- Mua lại chứng chỉ Quỹ: mua lại 6,200,000.00 chứng chỉ Quỹ với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 62,000,000,000 đồng.

e) Việc phân chia lợi nhuận của quỹ là phù hợp với mục tiêu đầu tư của quỹ: từ ngày 01/01/2016 ngày 30/06/2016, Quỹ không thực hiện phân chia lợi nhuận

5. Báo cáo về hoạt động ủy quyền

Công ty quản lý quỹ phải lập báo cáo đánh giá chất lượng dịch vụ cung cấp bởi các tổ chức khác (bên nhận ủy quyền), như dịch vụ đại lý chuyển nhượng, dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ xác định giá trị tài sản ròng... với các nội dung sau:

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

Chỉ tiêu	Tỷ lệ
Tỷ lệ chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng so với chi phí hoạt động	1.83%
Tỷ lệ chi phí dịch vụ Quản trị Quỹ so với chi phí hoạt động	4.77%

b) Các ảnh hưởng (nếu có) của hoạt động ủy quyền tới lợi nhuận, mức độ rủi ro của quỹ : Chỉ làm tăng chi phí nhưng không đáng kể , hạn chế tối thiểu mức độ rủi ro ảnh hưởng đến hoạt động của Quỹ

c) Tổng chi phí các hoạt động ủy quyền phải trả cho bên nhận ủy quyền (trường hợp bên nhận ủy quyền cung cấp nhiều dịch vụ cho công ty quản lý quỹ):

STT	Chỉ tiêu	Số tiền
1	Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng	33,000,000
2	Chi phí dịch vụ Quản trị Quỹ	85,800,000
	Tổng cộng	118,800,000

d) Đánh giá khả năng duy trì hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, tính bảo mật, hạ tầng cơ sở vật chất kỹ thuật, hệ thống dự phòng nóng, hệ thống dự phòng thảm họa... của bên nhận ủy quyền, bảo đảm

hoạt động ủy quyền được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của nhà đầu tư : Tốt

Tổng Giám đốc Công ty quản lý quỹ



TRẦN THANH TÂN 

