

QUỸ ETF SSIAM VNX50

CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc
THE SOCIALIST REPUBLIC OF VIETNAM
Independence - Freedom - Happiness

Số/No.: 352/2018/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 30 tháng 07 năm 2018
Ha Noi, 30 July 2018

**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
COMMISSION'S PORTAL AND
HOCHIMINH STOCK EXCHANGE'S
PORTAL**

Kính gửi/ To:

- Ủy ban Chứng khoán Nhà nước/ *The State Securities
Commission*
- Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM/ *Hochiminh Stock
Exchange*

- Tên CTQLQ: Công ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI
- Tên tổ chức / *Organization name*: Quỹ ETF SSIAM VNX50
- Mã chứng khoán/ *Security Symbol*: FUESSV50
- Địa chỉ trụ sở chính/ *Address*: Tầng 5, 1C Ngô Quyền, Quận Hoàn Kiếm, Hà Nội
- Điện thoại/ *Telephone*: 0243.9366321
- Fax: 02439.366337
- Người thực hiện công bố thông tin/ *Submitted 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 (*):

Phụ lục 16 - Báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ của Công Ty Quản Lý Quỹ cho Quỹ ETF SSIAM VNX50 bán niên năm 2018.

Appendix 16 - Semi annual operation report 2018 of SSIAM VNX50 ETF

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của công ty/quỹ vào ngày 30/07/2018 tại đường dẫn : <https://www.ssi.com.vn>

*This information was disclosed on Company/Fund's Portal on date 30/07/2018
Available at: https://www.ssi.com.vn*




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

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

Tài liệu đính kèm/

Attachment:

- Phụ lục 16 - Báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ của Công Ty Quản Lý Quỹ cho Quỹ ETF SSLAM VNX50 bán niên năm 2018

Người công bố thông tin 



Trần Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC





BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ CHO GIAI ĐOẠN BÁN NIÊN NĂM 2018 QUỸ ETF SSIAM VNX50

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

1. THÔNG TIN VỀ QUỸ

a) Tên của quỹ: Quỹ ETF SSIAM VNX50

Loại hình quỹ: Quỹ hoán đổi danh mục

b) Mục tiêu đầu tư của quỹ

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

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

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

e) Chính sách phân chia lợi nhuận

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

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành (tại thời điểm 30/6/2018): 9.700.000 CCQ

g) Nội dung thay đổi tại Điều Lệ Quỹ trong kỳ báo cáo:

Vui lòng xem Tờ trình Sửa Điều Lệ Quỹ Đại hội nhà đầu tư bất thường tháng 1 năm 2018 theo đường link sau:

<https://www.ssi.com.vn/layouts/~//media/PDFs/SSIAM/Announcement/1%20CBTT%20thay%20doi%20dieu%20le.ashx>

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo:

Vui lòng xem Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư thường niên năm 2018 theo đường link sau:

<https://www.ssi.com.vn/layouts/NewsDetail.aspx?SiteCoreNewsId={DECC6D8F-FF3B-40A0-B3D1-E2DCCA9F2B9D}>

và Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư bất thường tháng 1 năm 2018 theo đường link sau:

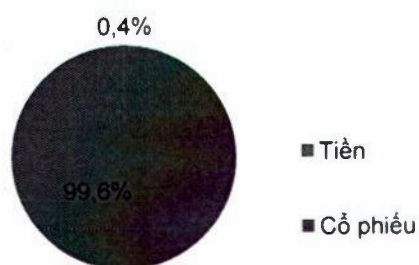
<https://www.ssi.com.vn/layouts/~//media/PDFs/SSIAM/Announcement/1%20CBTT%20ngh%20quyet%20ETF.ashx>

2. BÁO CÁO VỀ KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ

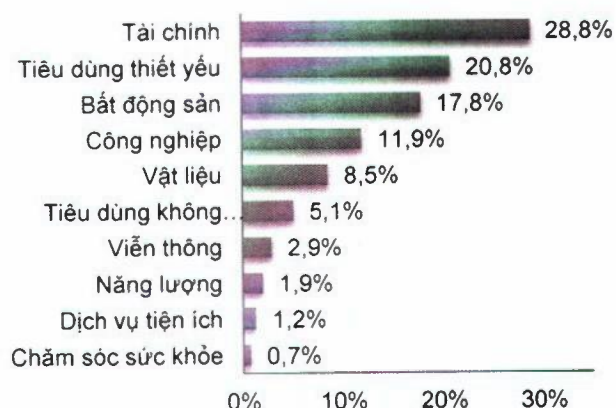
a) Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 30/06/2018

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

Phân bổ tài sản tại ngày 30/06/2018



Cơ cấu danh mục theo ngành (%NAV)



Chỉ tiêu	30/06/2018	30/06/2017	30/06/2016
2.1. Giá trị tài sản ròng của Quỹ	125.050.988.218	100.042.245.415	83.721.748.595
2.2. Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành	9.700.000	9.800.000	10.100.000
2.3. Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ)	12.891,85	10.208,39	8.289,28
2.4. Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	15.888,60	10.208,39	8.375,57
2.5. Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	12.212,59	8.161,63	6.840,38

2.6. Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ	26,3%	23,2%	-6,6%
2.7. Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%)	1,33%	1,94%	1,95%
2.8. Tốc độ vòng quay danh mục (%)	141,41%	25,60%	22,58%

- Tổng lợi nhuận của Quỹ:
 - Lãi (lỗ) bán các khoản đầu tư: 17.295.361.996 VND
 - Chênh lệch tăng, giảm đánh giá lại các khoản đầu tư chưa thực hiện: (16.942.747.756) VND
 - Thu nhập từ thu cổ tức: 1.154.526.200 VND
- Chi phí hoạt động của Quỹ trong giai đoạn bán niên 2018: 1.207.855.011 VND
- Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận trong nửa năm đầu 2018.

b) Chỉ tiêu về lợi nhuận của quỹ

- Tổng lợi nhuận bình quân năm của Quỹ tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo: 7.921.266.583,40 đồng

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

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

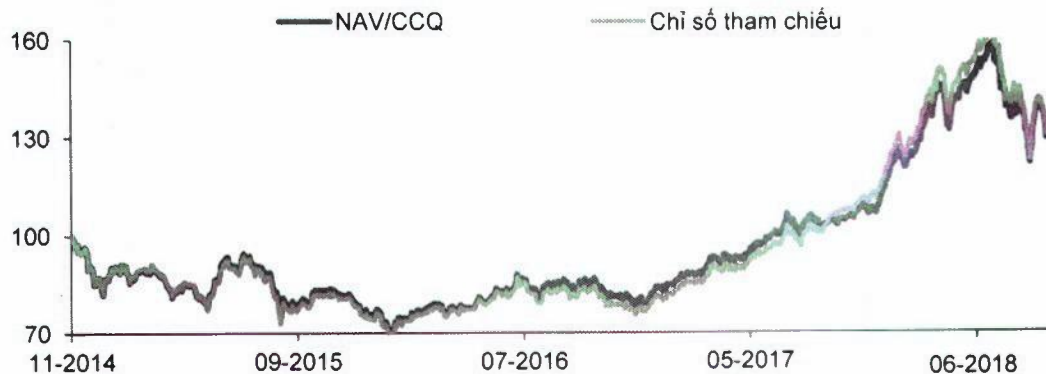
- a) Trong kỳ, Quỹ theo đuổi chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu bám sát tỷ lệ lợi nhuận của chỉ số VNX50 và không chủ động lựa chọn cổ phiếu dựa trên các nhận định về tình hình kinh tế vĩ mô, phân tích ngành và phân tích công ty. Quỹ đầu tư 50/50 cổ phiếu trong danh mục rõ VNX30 với tỷ trọng tương ứng nhằm bám sát tỷ lệ sinh lời của chỉ số VNX50.
- b) Chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking error) trong kỳ của chứng chỉ quỹ (CCQ) luôn dưới mức 3,33% đạt tiêu chí đầu tư của quỹ.
- c) Trong giai đoạn bán niên 2018, danh mục đầu tư của quỹ có thay đổi cơ cấu 2 lần vào tháng 1 và tháng 4 do Sở giao dịch chứng khoán TP Hồ Chí Minh tái cơ cấu lại danh mục và thay đổi tỷ lệ tự do chuyển nhượng (freefloat) của chỉ số VNX50 định kỳ.
- d) Trong 6 tháng đầu năm 2018, chỉ số tham chiếu VNX50 có mức tăng trưởng -2,3% và NAV của quỹ tăng trưởng +0,3%, cao hơn với mức tăng của chỉ số tham chiếu VNX50.
- e) Trong giai đoạn bán niên 2018, Quỹ không có giao dịch hoán đổi.

Chỉ tiêu tài chính ngày 30/6/2018

NAV/CCQ	12.891,85
Giá đóng cửa của CCQ trên sàn HNX	13.000
Sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu	1,59%
Tổng số lượng CCQ lưu hành	9.700.000

Tăng trưởng (Từ ngày kết thúc đăng ký góp vốn 17/11/2014)	
VNX50 Index	26,84%
NAV/CCQ	28,92%

Biến động NAV và chỉ số tham chiếu VNX50



Lợi nhuận đầu tư đối với các loại tài sản

Lãi/lỗ theo tài sản	Lãi/lỗ đã thực hiện	Lãi/lỗ chưa thực hiện
Cổ phiếu	17.295.361.996	(16.942.747.756)
Trong đó:		
Vốn hóa lớn	14.954.134.607	(11.227.342.607)
Vốn hóa vừa	2.538.181.999	(5.401.573.199)
Vốn hóa nhỏ	(196.954.610)	(313.831.950)

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

Vui lòng xem ý kiến từ Ngân hàng giám sát 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 trong kỳ



BC NHGS ban rien
2018.pdf

đính kèm :

5. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG ỦY QUYỀN

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

- Ngân hàng Đầu tư và phát triển Việt Nam- CN Hà Thành (BIDV- Hà Thành) cung cấp dịch vụ quản trị quỹ;
- Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam cung cấp dịch vụ đại lý chuyển nhượng;
- Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP Hồ Chí Minh cung cấp dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu.
- Thành viên lập quỹ kiêm đại lý phân phối
 - Công ty cổ phần chứng khoán Sài gòn (SSI)
 - Công ty cổ phần chứng khoán Bảo Việt (BVSC)

- o Công ty TNHH chứng khoán Ngân Hàng Ngoại Thương Việt Nam (VCBS)
- o Công ty cổ phần chứng khoán VNDirect (VNDS)

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

	Tổng chi phí Tại 30/6/2018 (VNĐ)	Tỉ lệ so với Lợi nhuận	Tỉ lệ so với Thu nhập	Tỉ lệ so với Tổng chi phí hoạt động Quỹ
Phí dịch vụ quản trị quỹ	99.000.000	32,49%	6,55%	8,20%
Phí đại lý chuyển nhượng	33.000.000	10,83%	2,18%	2,73%
Phí dịch vụ quản lý và vận hành chỉ số tham chiếu	0	0	0	0
Phí dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu	0	0	0	0
Phí dịch vụ Đại lý phân phối	0	0	0	0
Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền	132.000.000	43,33%	8,73%	10,93%

b) Để quản lý và phòng ngừa rủi ro liên quan đến các hoạt động ủy quyền bao gồm dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu, Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI đã thực hiện các biện pháp cụ thể như sau:

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

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

Trong giai đoạn bán niên năm 2018, các đơn vị nhận ủy quyền cung cấp dịch vụ quản trị quỹ, đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu cho Quỹ đã duy trì đủ trang thiết bị cơ sở vật chất, giải pháp kỹ thuật, an ninh hệ thống, hệ thống dự phòng thảm họa, hệ thống dự phòng nóng, quy trình nghiệp vụ, hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, nhân sự có kinh nghiệm và trình độ chuyên môn phù hợp để thực hiện các hoạt động ủy quyền. Các hoạt động ủy quyền trong năm đã được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của Nhà Đầu Tư của Quỹ.

Đánh giá dịch vụ Quản trị Quỹ

Ngân hàng BIDV- chi nhánh Hà Thành hiện đang là đơn vị được ủy quyền hoạt động dịch vụ Quản trị Quỹ. Các hệ thống hiện có để cung cấp dịch vụ Quản trị Quỹ có nhiều ưu điểm, được áp dụng rộng rãi trên toàn cầu và được thiết lập cơ chế bảo mật do mỗi hệ thống khi thiết lập quyền truy cập đều có các nguyên tắc thiết lập mang tính bảo mật cao. Hệ thống kế toán và định giá chứng chỉ quỹ của

Ngân hàng đã đáp ứng được yêu cầu của Công ty Quản Lý Quỹ. Hệ thống này được cập nhật hai năm một lần bao gồm phát triển các tính năng mới và phát triển theo nhu cầu riêng của từng thị trường nên đã đáp ứng được các yêu cầu về hạch toán tại Việt Nam. Các hệ thống đều được lưu trữ dữ liệu hàng kỳ và có chương trình dự phòng thảm họa. Quy trình dự phòng thảm họa của Ngân hàng được thiết lập chi tiết, bài bản để khắc phục các thảm họa trong khoảng thời gian phù hợp nhất để đảm bảo hoạt động ít bị ảnh hưởng và các tổn thất là tối thiểu.

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

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

Đánh giá dịch vụ Đại Lý Chuyển Nhượng

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

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

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

Đánh giá dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu

Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp Hồ Chí Minh hiện đang là tổ chức cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu và dịch vụ Quản lý và Vận hành chỉ số tham chiếu cho Quỹ.

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

Đánh giá dịch vụ Đại Lý Phân Phối

Các Đại lý phân phối đều đáp ứng được yêu cầu về việc kết nối với Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam, đảm bảo quy trình nghiệp vụ của Đại lý phân phối diễn ra thông suốt không bị gián

đoạn. Đại lý phân phối đã đáp ứng được yêu cầu về Quy trình ngân giao dịch mượn, các quy trình về lưu trữ thông tin và bảo mật thông tin khách hàng.

Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI



Đỗ Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

BÁO CÁO CỦA NGÂN HÀNG GIÁM SÁT

Chúng tôi là Ngân hàng giám sát Quỹ ETF SSIAM VNX50 cho kỳ tài chính bán niên năm 2018 kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2018, với sự hiểu biết của chúng tôi thì trong kỳ tài chính Quỹ ETF SSIAM VNX50 đã hoạt động và được quản lý với các nội dung dưới đây:

a) Công ty TNHH quản lý quỹ SSI về cơ bản 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, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan. Tuy nhiên:

- Theo ghi nhận của chúng tôi, tại ngày 23/4/2018 Sở giao dịch chứng khoán thành phố Hồ Chí Minh có thay đổi định kỳ danh mục chỉ số tham chiếu VNX50, nên quỹ đã tiến hành cơ cấu lại danh mục đầu tư. Do đó, từ ngày 20/4/2018 đến ngày 30/4/2018 giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu của quỹ chưa đảm bảo 95% giá trị danh mục chứng khoán tương ứng của chỉ số tham chiếu. Đến ngày 03/05/2018, giá trị chứng khoán cơ cấu của Quỹ là 98,31% danh mục tài sản của Quỹ, đảm bảo tỷ lệ theo quy định.

- Từ ngày 21/5/2018 đến ngày 25/5/2018 giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu của quỹ chưa đảm bảo 95% giá trị danh mục chứng khoán tương ứng của chỉ số tham chiếu. Đến ngày 28/5/2018, giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu của Quỹ là 96,86% danh mục tài sản của Quỹ, đảm bảo tỷ lệ theo quy định.

b) Việc định giá, đánh giá tài sản của Quỹ ETF SSIAM VNX50 về cơ bản đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan. Tuy nhiên:

Khi xác định giá trị tài sản ròng của quỹ tại ngày 28 & 29/6/2018, mã chứng khoán VPB thuộc danh mục chứng khoán của quỹ đã được ghi nhận cổ tức bằng tiền mặt 20% ; tuy nhiên, lần chốt danh sách cổ đông để trả cổ tức này chỉ dành riêng cho cổ đông sở hữu cổ phần ưu đãi cổ tức năm 2017, do đó giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm này đã bị sai lệch. Sau khi phát hiện sự việc trên, Ngân hàng đã phối hợp với SSIAM điều chỉnh lại NAV của quỹ ETF, đồng thời thực hiện công bố thông tin việc điều chỉnh NAV theo quy định của pháp luật và điều lệ quỹ.

c) Phát hành và hoán đổi Chứng chỉ quỹ đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.

Các nội dung liên quan đến phân phối lợi nhuận của Quỹ ETF phát sinh trong kỳ báo cáo: Trong kỳ quỹ không phát sinh hoạt động phân phối lợi nhuận

Hà Nội, ngày 27 tháng 7 năm 2018.

ĐẠI DIỆN NGÂN HÀNG GIÁM SÁT

(Chức danh)

(Ký, ghi rõ họ tên và đóng dấu)

NHÂN VIÊN GIÁM SÁT

(Ký, ghi rõ họ tên)



PHÓ GIÁM ĐỐC

Lê Mỹ Linh

