

Số: 107 /2023-CBTT

Ngày 14 tháng 03 năm 2023

CÔNG BỐ THÔNG TIN ĐỊNH KỲ

**Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước
Sở Giao dịch Chứng khoán TP HCM**

1. Tên CTQLQ: CTY CP QUẢN LÝ QUỸ ĐẦU TƯ DRAGON CAPITAL VIỆT NAM

- Tên Quỹ ETF niêm yết: **Quỹ ETF DCVFMVN30**
- Mã chứng khoán: **E1VFN30**
- Địa chỉ trụ sở chính: **Lầu 15, Tòa nhà Mê Linh Point, 02 Ngô Đức Kế, Quận 1, TP. HCM**
- Điện thoại: **08-3825 1488**
- Email: eskh@dragoncapital.com
- Fax: **08-3825 1477**
- website: <http://dragoncapital.com.vn>

2. Nội dung thông tin công bố: Báo cáo Tổng kết hoạt động quản lý quỹ năm 2022

3. Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của quỹ ETF/công ty quản lý quỹ vào ngày 14/03/2023 tại đường dẫn <https://dragoncapital.com.vn/> của quỹ ETF/công ty quản lý quỹ.


Chúng tôi xin 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.

Tài liệu đính kèm/Attached documents

Báo cáo Tổng kết hoạt động quản lý quỹ năm 2022

ĐẠI DIỆN CÔNG TY QLQ DRAGON CAPITAL VIỆT NAM

Người được ủy quyền công bố thông tin

(Ký tên, ghi rõ họ tên, chức vụ, đóng dấu) / 



NGUYỄN MINH ĐĂNG KHÁNH

Giám đốc điều hành Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư

Số:

TP.HCM, ngày 14 tháng 03 năm 2023

BÁO CÁO

Tổng kết hoạt động quản lý quỹ năm 2022

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM

1. Thông tin về quỹ

a) Tên của quỹ, loại hình quỹ : **QUỸ ETF DCVFMVN30**

b) Mục tiêu đầu tư của quỹ :

Mục tiêu chính của Quỹ ETF DCVFMVN30 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 31/12/2022 như sau:

Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)
VPB	8.1	MBB	4.4	KDH	1.3
FPT	7.5	STB	4.4	SAB	1.2
VNM	6.6	VCB	4.3	NVL	1.1
ACB	6.5	VJC	3.1	GAS	1.0
MSN	6.2	HDB	2.9	BID	0.8
TCB	6.2	VRE	2.5	POW	0.5
HPG	6.0	VIB	2.3	PLX	0.4
VHM	5.4	CTG	2.0	PDR	0.4

VIC	5.3	SSI	1.9	BVH	0.4
MWG	4.9	TPB	1.9	GVR	0.2

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 31/12/2021	423,500,000	ccq
Tổng số lượng chứng Quỹ phát hành thêm trong kỳ	204,800,000	ccq
Tổng số lượng chứng Quỹ mua lại trong kỳ	(196,400,000)	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ Quỹ tại ngày 31/12/2022	431,900,000	ccq

g) Nội dung thay đổi tại Điều lệ Quỹ trong kỳ báo cáo: được đề cập trong Điều lệ đính kèm được Đại hội Nhà đầu tư thường niên Năm tài chính 2021 của Quỹ ETF DCVFMVN30 (tên cũ: Quỹ ETF VFMVN30) thông qua bằng hình thức lấy ý kiến bằng văn bản ngày 08/04/2022. Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của quỹ/công ty quản lý quỹ tại đường dẫn Quỹ ETF DCVFMVN30 (E1VFMVN30)- Điều lệ quỹ AGM năm 2022 (dragoncapital.com.vn)

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư/Đại hội đồng cổ đông trong kỳ báo cáo (nếu có): Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên Năm tài chính 2021 của Quỹ ETF DCVFMVN30 (tên cũ: Quỹ ETF VFMVN30) thông qua bằng hình thức lấy ý kiến bằng văn bản ngày 08/04/2022 đã thông qua nội dung kết quả hoạt động của Quỹ năm 2021, ngân sách, kế hoạch hoạt động năm 2022, thay đổi Điều lệ quỹ phù hợp với pháp luật... Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của quỹ/công ty quản lý quỹ tại đường dẫn Quỹ ETF DCVFMVN30- Nghị quyết Đại hội thường niên năm tài chính 2021 (dragoncapital.com.vn).

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 : Xin xem chi tiết tại Mục 4. Báo cáo về hoạt động giám sát của ngân hàng giám sát.

2. Báo cáo về kết quả hoạt động của quỹ

a) Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12 của 3 năm gần nhất:

- 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 bổ theo tài sản như sau :

Cơ cấu tài sản quỹ	31/12/2022	31/12/2021	31/12/2020
Danh mục chứng khoán	99.08%	99.73%	98.39%
Tài sản khác	0.92%	0.27%	1.61%
Cộng	100.00%	100.00%	100.00%

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

Ngành	31/12/2020	31/12/2021	31/12/2022
Ngân Hàng	36.6%	40.0%	43.7%
Bất Động Sản	18.2%	22.3%	16.1%
Thực Phẩm, Nước Giải Khát & Thuốc Lá	15.1%	11.6%	7.8%
Vật Liệu	9.0%	8.3%	5.9%
Phần Mềm & Dịch Vụ Phần Mềm	4.4%	5.1%	7.4%
Bán Lẻ	4.2%	4.5%	4.9%
Vận Tải	3.9%	2.5%	3.1%
Dệt May & Thiết Bị Tiêu Dùng	1.7%	1.2%	0.0%
Tiện ích Công Cộng	1.7%	1.2%	0.5%
Hàng Hóa Công Nghiệp	1.4%	0.0%	0.0%
Dịch Vụ Tài Chính	1.4%	2.3%	8.0%
Năng Lượng	0.9%	0.5%	1.5%
Bảo Hiểm	0.0%	0.3%	0.3%
Tiền mặt & Khác	1.5%	0.2%	0.8%
Tổng	100%	100%	100%

Về Giá trị tài sản ròng, tỷ lệ chi phí hoạt động và tốc độ vòng quay danh mục của quỹ :

Chỉ tiêu	31/12/2022	31/12/2021	31/12/2020
Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND)	7,398,576,174,016	10,927,736,491,829	7,512,156,013,771
Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND)	431,900,000.00	423,500,000.00	418,300,000.00
Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND)	17,130.29	25,803.39	17,958.77
Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND)	26,190.78	26,417.16	17,958.77
Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND)	15,350.05	16,973.42	10,160.42
Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%)	1.10%	0.99%	0.92%
Tốc độ vòng quay danh mục (%)	106.48%	72.74%	37.46%

- 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 liệu
1	Lợi nhuận thu được từ sự tăng trưởng giá chứng khoán (giá trị lãi vốn)	(2,870,160,903,167)
2	Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, chứng chi tiền gửi, lãi suất tiền gửi)	86,473,307,376
3	Lợi nhuận/(lỗ) thu được từ bán cổ phiếu	(216,218,369,075)

4	Tổng chi phí	90,328,933,591
	Tổng lợi nhuận của quỹ	(3,090,234,898,457)

- 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
- Thông tin về các khoản vay nợ, các hạng mục thanh toán trả sau của công ty đầu tư chứng khoán (nếu có), các giao dịch repo/ reverse repo : Không có

b) Chi tiêu về lợi nhuận của quỹ :

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

(i) trong thời hạn 12 tháng (1 năm)	(3,090,234,898,457.00)
(ii) trong thời hạn 36 tháng (3 năm)	434,993,250,379.33
(iii) trong thời hạn 60 tháng (5 năm)	168,066,946,336.40

c) 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

d) 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.

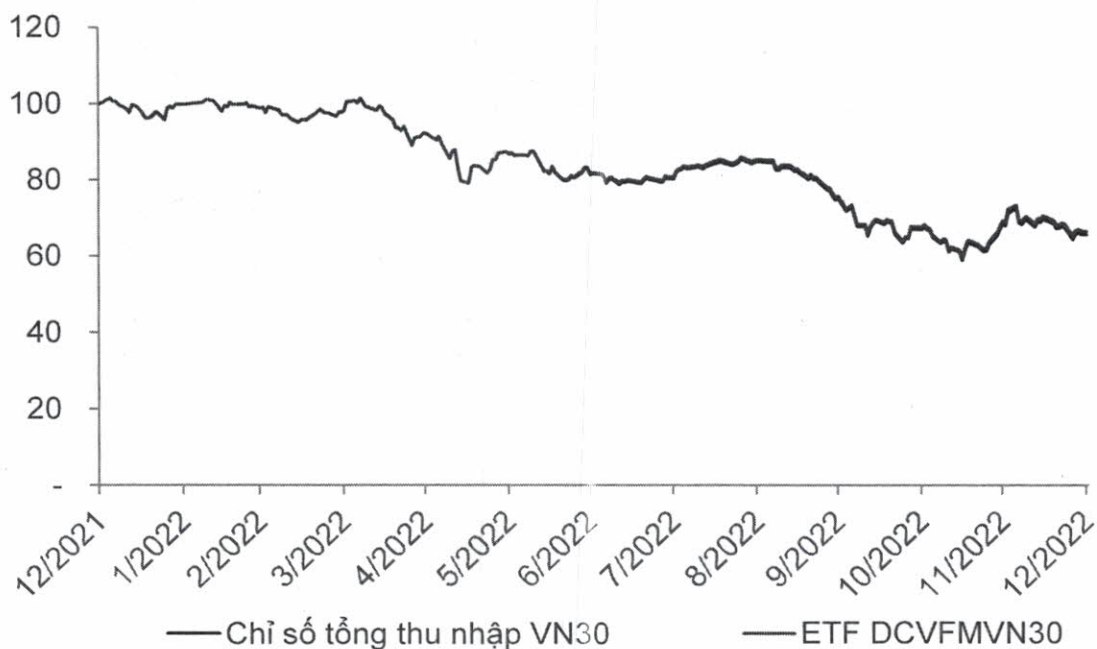
3. Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ

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

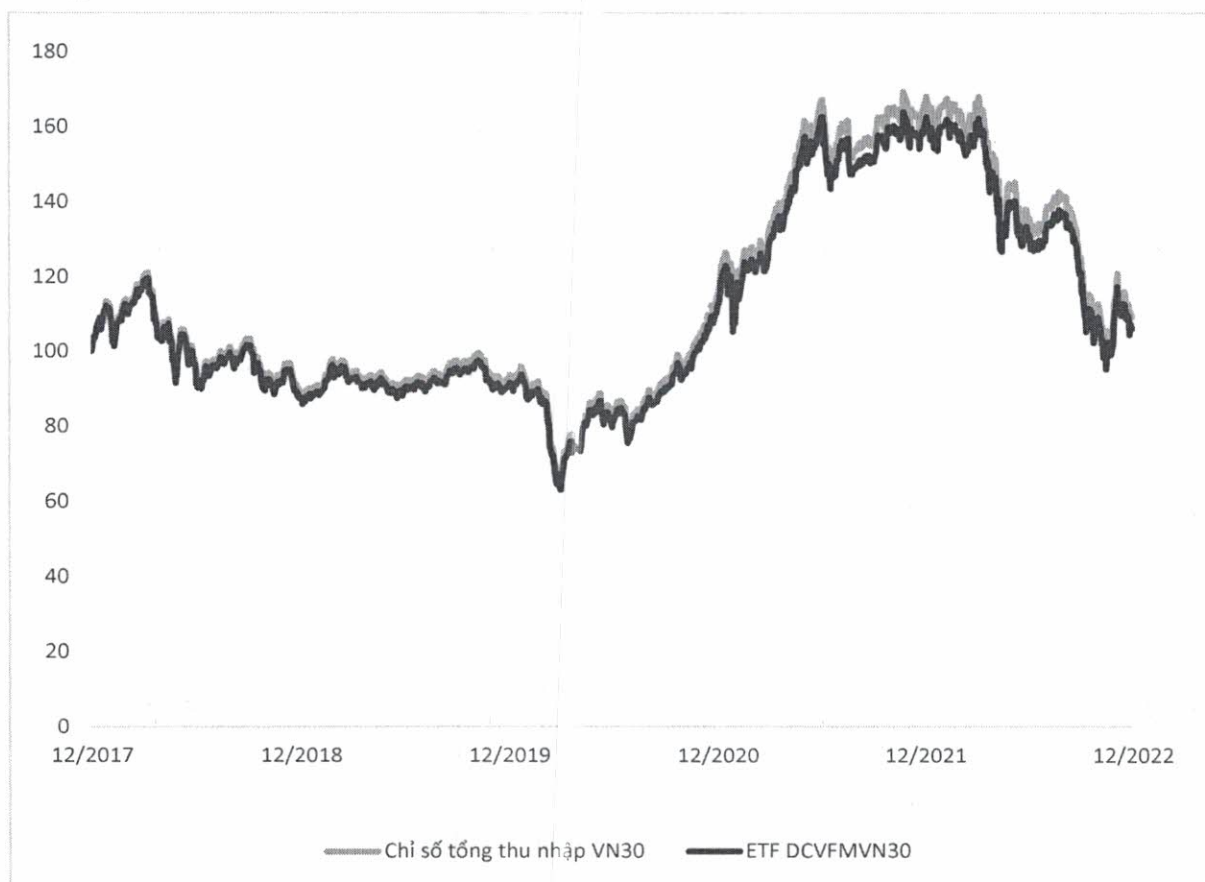
- a) Thuyết minh về việc thay đổi Công ty quản lý quỹ (nếu có) : không có
- b) Thuyết minh về việc quỹ có đạt được mục tiêu đầu tư (thuyết minh này chỉ cần thiết tại báo cáo hàng năm của quỹ) :

Mục tiêu của Quỹ là mô phỏng gần nhất kết quả hoạt động và sự biến động của chỉ số tổng thu nhập VN30-TRI. Kết thúc năm 2022, Quỹ đã đạt được mục tiêu đề ra khi mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu chỉ ở mức khoảng 0.73%.

- 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 (bảng đồ thị) :



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 DCVFMVN30 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 DCVFMVN30 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 31/12/2022 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 31/12/2022 của Quỹ ETF DCVFMVN30 là 17,130.3 đồng giảm 33.6% so với giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 31/12/2021 của Quỹ là 25,803.39 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) :

Trong năm 2022 thị trường chứng khoán Việt Nam có nhiều biến động khi chỉ số VN-Index giảm khoảng 32.8% so với cuối năm 2021. Giá trị chỉ số VN30 đại diện cho các cổ phiếu có vốn hóa lớn và thanh khoản hàng đầu Việt Nam có mức giảm 34.5%, chỉ số các cổ phiếu có vốn hóa vừa (VNMid-cap) có mức giảm 41.4% và chỉ số các cổ phiếu có vốn hóa nhỏ (VNSmall-cap) có mức giảm 51.0%.

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) ;

Không có dữ liệu do quỹ giao dịch vừa sơ cấp vừa thứ 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 Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam trong quá trình vận hành và quản lý Quỹ ETF DCVFMVN30 (tiền thân là “Quỹ ETF VFMVN30”) (“ETF DCVFMVN30” hoặc “Quỹ”) đối với các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi ngân hàng giám sát (nếu có): từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ không thay đổi Ngân hàng giám sát.

b) Việc lưu ký tài sản của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ đã thực hiện lưu ký tài sản theo các quy định pháp luật hiện hành.

c) 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 cho giai đoạn từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ 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 mở, Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ không có bất kỳ hợp đồng vay và cho vay.

d) 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 đã tuân thủ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch và các văn bản pháp luật có liên quan.

e) 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: việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ được tuân thủ theo quy định pháp luật liên quan hiện hành, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ đã thực hiện:

- Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: phát hành thêm 252.800.000 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 2.528.000.000.000 đồng.

- Mua lại chứng chỉ Quỹ: mua lại 247.600.000 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 2.476.000.000.000 đồng.

f) Việc phân chia lợi nhuận của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận cho nhà đầu tư.

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	Chi phí/lợi nhuận	Chi phí/Tổng CP hoạt động	Chi phí /Thu nhập
Chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng	0.00%	0.10%	0.00%
Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	-0.07%	3.27%	-0.08%


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	66,000,000
2	Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	2,265,296,241
	Tổng cộng	2,331,296,241

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

KT **Tổng Giám đốc (Giám đốc) Công ty quản lý quỹ**



NGUYỄN MINH ĐĂNG KHÁNH
 GIÁM ĐỐC ĐIỀU HÀNH NGHIỆP VỤ
 HỖ TRỢ ĐẦU TƯ