

QUỸ ETF SSIAM VNFIN LEAD

CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Số/No. 1574/2023/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 11 tháng 08 năm 2023

CÔNG BỐ THÔNG TIN ĐỊNH KỲ

Kính gửi: - Ủy ban Chứng khoán Nhà nước
- Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM

- Tên Công Ty Quản Lý Quỹ: Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI (SSIAM)
- Tên tổ chức: **Quỹ ETF SSIAM VNFIN LEAD**
- Mã chứng khoán: **FUESSVFL**
- Địa chỉ trụ sở chính: Tầng 5, Tòa nhà số 1C Ngô Quyền, phường Lý Thái Tổ, Quận Hoàn Kiếm, Hà Nội
- Điện thoại: 0243.9366321
- Fax: 0243.9366337
- Người thực hiện công bố thông tin: Bà Tô Thùy Linh
- Chức vụ: Phó Tổng Giám Đốc

Nội dung thông tin công bố (*):

Báo cáo tổng kết hoạt động của Công ty quản lý Quỹ cho Quỹ ETF SSIAM VNFIN LEAD bán niên 2023

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của công ty/quỹ vào ngày 11/08/2023 tại đường dẫn: <https://www.ssi.com.vn/ssiam/san-pham-va-dich-vu-ssiam>.

Chúng 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./

Tài liệu đính kèm
Báo cáo tổng kết hoạt động Quỹ ETF
SSIAM VNFIN LEAD bán niên 2023

Người công bố thông tin ✓



Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Hà Nội, ngày 11 tháng 08 năm 2023

BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ**Bán niên 2023**

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

1. Thông tin về quỹ

a) Tên của Quỹ: QUỸ ETF SSIAM VNFIN LEAD (“Quỹ”)

Loại hình quỹ: Quỹ hoán đổi danh mục

b) Mục tiêu đầu tư của Quỹ:

Mục tiêu đầu tư của Quỹ là hướng tới đạt hiệu quả đầu tư bám sát mức sinh lời thực tế của Chỉ số VNFIN LEAD trong tất cả các giai đoạn.

c) Thời hạn hoạt động của Quỹ: không giới hạn

d) Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio): Danh mục chỉ số VNFIN LEAD

Mã cổ phiếu và tỷ trọng của FUESSVFL tại ngày 30/06/2023 như sau:

STT	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)
1	ACB	6,28%
2	BID	0,41%
3	BVH	0,25%
4	CTG	2,03%
5	EIB	2,62%
6	HCM	0,70%
7	HDB	1,80%
8	LPB	2,16%
9	MBB	9,45%
10	MSB	0,90%
11	OCB	0,27%
12	SHB	4,93%
13	SSB	2,04%
14	SSI	8,29%
15	STB	15,81%
16	TCB	13,86%
17	TPB	2,38%
18	VCB	4,00%
19	VCI	1,58%
20	VIB	1,42%
21	VND	5,01%
22	VPB	13,20%

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 VND;
- 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 tên 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 giữa thời điểm Ngày Chốt Danh Sách và ngày chi trả thì người chuyển nhượng là người được nhận lợi nhuận.

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành:

Tổng số chứng chỉ quỹ tại ngày 01/01/2023	228.700.000	ccq
Tổng số lượng chứng quỹ phát hành thêm trong kỳ	28.600.000	ccq
Tổng số lượng chứng quỹ mua lại trong kỳ	18.400.000	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ quỹ tại ngày 30/06/2023	238.900.000	ccq

g) Nội dung thay đổi tại Điều lệ quỹ trong kỳ báo cáo (nếu có): không có

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo (nếu có): vui lòng xem Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên năm 2023 theo đường link sau:

<https://www.ssi.com.vn/ssiam/cong-bo-thong-tin-vnfin-lead-cbtt-chi-tiet/quy-etf-ssiam-vnfin-lead-cong-bo-thong-tin-nghi-quyet-va-bien-ban-hop-dai-hoi-nha-dau-tu-thuong-nien-nam-2023-cua-quy-etf-ssiam-vnfin-lead>

i) Ý kiến nhận xét của ngân hàng giám sát về các nội dung quy định tại Thông tư hướng dẫn về hoạt động và quản lý các quỹ đầu tư chứng khoán: Xem chi tiết 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 30/06 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...):

Cơ cấu tài sản

Loại tài sản (% Tổng tài sản)	30/06/2023	30/06/2022	30/06/2021
1. Danh mục chứng khoán	99,39%	99,44%	99,55%
2. Tiền và tương đương tiền; Tài sản khác	0,61%	0,56%	0,45%
Tổng cộng	100,00%	100,00%	100,00%

Phân bổ theo ngành:

STT	Ngành (% NAV)	30/06/2023	30/06/2022	30/06/2021
1	Ngân hàng thương mại	77,22%	82,16%	68,37%
2	Ngân hàng thương mại thuộc sở hữu Nhà nước	6,45%	8,20%	22,83%
3	Công ty chứng khoán	15,60%	8,47%	8,17%
4	Công ty bảo hiểm	0,25%	0,33%	0,33%
Tổng cộng		99,52%	99,15%	99,71%

Chỉ tiêu	30/06/2023	30/06/2022	30/06/2021
2.1. Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND)	4.206.556.389.459	2.660.689.216.938	2.941.797.870.517
2.2. Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (CCQ)	238.900.000	167.200.000	129.000.000
2.3. Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (VND/CCQ)	17.608,02	15.913,21	22.804,63
2.4. Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND/CCQ)	17.938,55	23.286,87	22.909,89
2.5. Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND/CCQ)	14.247,87	14.662,71	12.734,53
2.6. Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND/CCQ)	17.540	16.550	23.030
2.7. Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND/CCQ)	17.990	23.900	23.790
2.8. Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND/CCQ)	14.500	15.200	13.150
2.9. Tổng tăng trưởng (%) / 1 đơn vị CCQ	23,58%	-27,24% (*)	68,18% (**)
2.10. Tỷ lệ chi phí hoạt động của Quỹ (%)	0,92%	0,93%	0,93%
2.11. Tốc độ vòng quay danh mục (%)	18,05%	28,59%	28,80%

(*) Trình bày lại số liệu chỉ tiêu này; tính từ ngày 01/01/2022 tới ngày 30/06/2022

1023
CỔ
ÁCH N
QUẢ
DAN I

(**) Trình bày lại số liệu chỉ tiêu này; tính từ ngày 01/01/2021 tới ngày 30/06/2021

- Tỷ lệ chi phí hoạt động bán niên 2023 giảm so với bán niên 2022 chủ yếu do giá trị tài sản ròng trung bình kỳ này tăng so với kỳ trước, cao hơn mức tăng của chi phí hoạt động của Quỹ.

- Tốc độ vòng quay danh mục bán niên 2023 giảm so với bán niên 2022 nguyên nhân do giá trị tài sản ròng trung bình kỳ này tăng so với kỳ trước và tổng giá trị danh mục mua vào bán ra trong kỳ này cũng giảm hơn so với kỳ trước.

- 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 (cả tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...) (giá trị thu nhập):

Chỉ tiêu	Số tiền (VND)
2.12. Lãi/(lỗ) do đánh giá các khoản đầu tư chưa thực hiện	763.960.511.640
2.13. Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...)	52.992.225.017
2.14. Lợi nhuận thu được từ bán cổ phiếu	(6.927.520.240)
2.15. Tổng chi phí	(17.671.650.328)
Tổng cộng	792.353.566.089

- 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; Thời điểm phân chia lợi nhuận; Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ trước và sau thời điểm phân chia lợi nhuận: Quỹ không thực hiện phân chia lợi nhuận trong kỳ.

- Thông tin về các khoản vay nợ, các hạng mục thanh toán trả sau của Quỹ (nếu có), các giao dịch repo/reverse repo: không có

b) Chỉ tiêu về lợi nhuận của Quỹ:

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

Tính tới ngày lập báo cáo	Tổng lợi nhuận bình quân (VND)
i) Trong thời hạn 12 tháng (01 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)	491.555.312.206
ii) Trong thời hạn 36 tháng (03 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):	310.318.547.683
iii) Trong thời hạn 60 tháng (05 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 05 năm)	Không áp dụng

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: Báo giá chứng khoán được cung cấp bởi 2 Công ty Chứng khoán độc lập của Quỹ và được Ban Đại diện phê duyệt hàng năm (nếu có).

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.

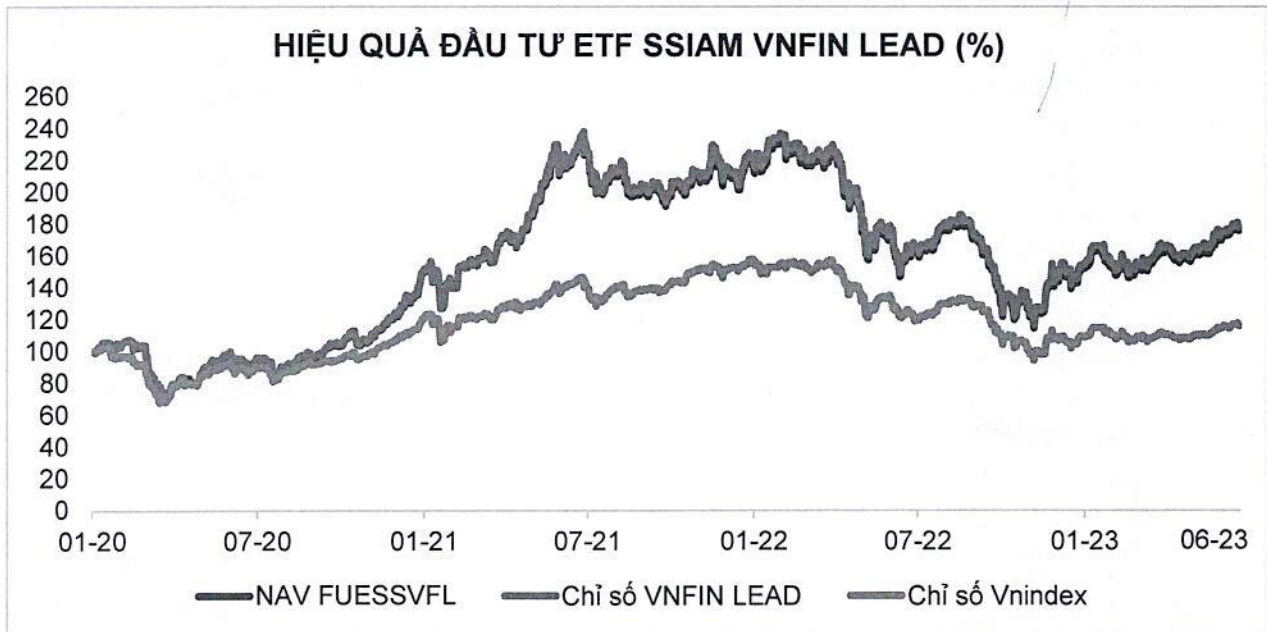
3. Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ

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): Chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking error/TE) trong kỳ báo cáo của chứng chỉ quỹ (CCQ) luôn không vượt mức **0,56%** đạt tiêu chí đầu tư của Quỹ.

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 05 năm gần nhất, tính tới ngày báo cáo (bằng đồ thị): Quỹ được Ủy Ban Chứng Khoán nhà nước cấp giấy chứng nhận lập quỹ số 42/GCN-UBCK ngày 24/02/2020, vì vậy chưa có số liệu trong khoảng 05 năm gần nhất.

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:

Trong kỳ báo cáo, Quỹ theo đuổi chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu bám sát tỷ lệ lợi nhuận của Chỉ số VNFIN LEAD 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 vào cổ phiếu trong danh mục rổ VNFIN LEAD với tỷ trọng tương ứng nhằm bám sát tỷ lệ sinh lời của chỉ số VNFIN LEAD.

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 30/06/2023 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.

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 tại kỳ báo cáo gần nhất:

Giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 30/06/2023 của Quỹ ETF SSIAM VNFIN LEAD là 17.608,02

đồng tăng khoảng 23,58% so với giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tính tại ngày 31/12/2022, cùng thời gian đó chỉ số tham chiếu tăng tương ứng 22,60%.

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-chips, cổ phiếu các công ty có mức vốn hóa thấp (small-cap):

Trong 6 tháng đầu năm, có những biến động ngược chiều tại các thị trường lớn trên thế giới. Trong khi NHTW các quốc gia phát triển như Mỹ, Canada hay Anh kiên định hoặc đưa ra các thông điệp mạnh mẽ về việc thắt chặt chính sách tiền tệ, thì tại Nhật Bản NHTW nước này vẫn tiếp tục chính sách tiền tệ nới lỏng trước đó, và NHTW Trung Quốc thì có động thái giảm lãi suất điều hành để hỗ trợ nền kinh tế đang có dấu hiệu giảm tốc.

Đối với thị trường chứng khoán, dòng tiền tiếp tục đổ vào thị trường Mỹ do tính an toàn của thị trường này, đồng thời các nhà đầu tư kỳ vọng rằng các động thái thắt chặt sẽ khó có thể duy trì. Chỉ số Dow Jones tăng 2,2% trong tháng 6, trong khi S&P 500 tăng 2,7% và NASDAQ tăng 3,3%. Trong khi đó tại thị trường Nhật Bản, chỉ số Nikkei 225 chỉ tăng 0,26% và Hang Seng của Trung Quốc giảm 5,28% do những lo ngại về khó khăn trong nước và cạnh tranh với Mỹ.

Tại Việt Nam, GDP tăng trưởng ở mức thấp, chỉ đạt mức tăng 4,14% so với cùng kỳ năm trước. Mức tăng trưởng thấp này do khu vực Công nghiệp và Xây dựng chỉ đạt mức tăng 2,5% so với cùng kỳ 2022, mặc dù đã có sự cải thiện so với mức sụt giảm 0,4% trong quý 1/2023. Nhìn chung cả ba khu vực Nông nghiệp, Công nghiệp và Dịch vụ đều giảm tốc hoặc tăng chậm trong Q2, đặt ra lo ngại cho việc hoàn thành chỉ tiêu tăng trưởng 2023 của Chính phủ. Với việc PMI vẫn cho thấy xu hướng co hẹp sản xuất những tháng tới, xuất nhập khẩu gặp khó do cầu thế giới yếu trong khi bán lẻ trong nước cũng đang giảm tốc và giải ngân đầu tư công chậm so với kế hoạch, có thể thấy tăng trưởng 9% cho nửa sau 2023 (để đảm bảo mức tăng 6,5% năm nay) là một thách thức lớn.

Để hỗ trợ nền kinh tế đang gặp khó khăn, NHNN đã tiến hành cắt giảm lãi suất trong tháng 6 và cũng là lần cắt giảm thứ 4 trong năm nay. Việc cắt giảm lãi suất được hỗ trợ bởi chính sách tương tự từ NHTW Trung Quốc, cũng như việc lạm phát trong nước giảm tốc và xuống mức 2,0% trong tháng 6.

Thị trường chứng khoán trong nước phản ứng tích cực với các chính sách hỗ trợ của NHTW, với chỉ số VNIndex tiếp tục đà tăng trong tháng 6 đạt 4,4% và đưa chỉ số này tăng trưởng tổng cộng 11,2% từ đầu năm đến nay, là mức tăng cao nhất trong các thị trường khu vực. Giao dịch trên thị trường cũng được cải thiện với doanh số giao dịch trung trong ngày tăng 38,4% so với tháng trước và 15,8% so với cùng kỳ năm ngoái với giao dịch trên cả 3 sàn chứng khoán.

Trong tháng 6, quỹ FUESSVFL tăng trưởng 6,97%, cao hơn so với chỉ số tham chiếu VNFIN LEAD khi chỉ số này tăng 6,18%. Tính từ đầu năm, mức tăng của quỹ là 23,58%, trong khi chỉ số tham chiếu là 22,6%. Việc các nhà hoạch định chính sách Việt Nam đang cố gắng giảm lãi suất, các công ty tài chính được hưởng lợi kép từ NIM cải thiện và tỷ lệ nợ xấu giảm khiến cho chỉ số VNFIN LEAD có sự tăng trưởng, dẫn tới quỹ FUESSVFL là quỹ có kết quả tốt nhất trong các ETF đầu tư vào thị trường Việt Nam trong nửa đầu 2023.

Lợi nhuận đầu tư đối với các loại tài sản:

Lãi/(Lỗ) theo tài sản	Lãi/(Lỗ) đã thực hiện (VND)	Lãi/(Lỗ) chưa thực hiện (VND)
Cổ phiếu	(6.927.520.240)	763.960.511.640
Trong đó:		
Vốn hóa lớn	(3.690.239.601)	675.210.102.801
Vốn hóa vừa	(3.237.280.639)	88.750.408.839
Vốn hóa nhỏ	-	-
Tổng cộng	(6.927.520.240)	763.960.511.640

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

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

l) Thông tin về các giao dịch với người có quyền lợi liên quan (nếu có): không có

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 đối với các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi ngân hàng giám sát (nếu có): Trong kỳ kế toán sáu tháng kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, 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 cho kỳ kế toán sáu tháng kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, Quỹ đã tuân thủ các giới hạn về hạn mức đầu tư được quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan tới quỹ hoán đổi danh mục. Tính đến ngày 30 tháng 06 năm 2023, danh mục cổ phiếu niêm yết của Quỹ là 4.186.378.494.200 đồng, chiếm 99,39% tổng giá trị tài sản của Quỹ. Tiền gửi của Quỹ tại Ngân hàng Lưu ký là 1.053.861.877 đồng, cổ tức được nhận là 23.325.403.000 đồng, phải thu bán chứng khoán là 1.140.160.000 đồng và 15.123.274 đồng là các tài sản khác.

c) Việc xác định giá trị tài sản ròng theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch:

Việc định giá, đánh giá tài sản của Quỹ ETF SSIAM VNFIN LEAD đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.

- Theo Báo cáo tài chính của Quỹ tính cho năm tài chính kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là tăng 29,09% so với số liệu tại ngày 31 tháng 12 năm 2022, thay đổi giá trị tài sản ròng trên chứng chỉ quỹ (NAV/CCQ) của Quỹ là tăng 23,58%. Tại ngày 30 tháng 06 năm 2023, giá trị tài sản ròng của Quỹ là 4.206.556.389.459 đồng. Giá trị tài sản ròng trên chứng chỉ quỹ trong kỳ cao nhất vào ngày 28/06/2023 (17.938,55) và thấp nhất vào ngày 02/01/2023 (14.247,87).

- Tính đến ngày 30 tháng 06 năm 2023, giá trị tài sản ròng của 01 lô chứng chỉ Quỹ là 1.760.802.172 đồng, giá trị tài sản ròng của 01 chứng chỉ Quỹ là 17.608,02 đồng.

- Quỹ không có hoạt động repo.

- Trong kỳ Quỹ có hoạt động tái cấu trúc danh mục với tổng giá trị mua vào là 358.466.627.600 đồng và tổng giá trị bán ra là 338.683.045.000 đồng.

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: Trong kỳ kế toán sáu tháng kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, Quỹ đã thực hiện các giao dịch hoán đổi Chứng chỉ Quỹ phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản

Y/C
 QUẢN LÝ
 QUỸ
 TP. HCM

(Handwritten signature)

pháp luật liên quan.

Trong kỳ kế toán sáu tháng kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, Quỹ đã thực hiện:

- Phát hành thêm 28.600.000 chứng chỉ Quỹ, tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 286.000.000.000 đồng.

- Mua lại 18.400.000 chứng chỉ Quỹ, tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 184.000.000.000 đồng.

- Số lượng Nhà đầu tư bao gồm cả Công ty Quản lý Quỹ và Người có liên quan tính đến ngày 30/06/2023 là 1.628 Nhà Đầu tư trong đó công ty Quản lý Quỹ và người có liên quan của Công ty Quản lý Quỹ là 1 Nhà đầu tư, 57 Nhà đầu tư tổ chức và 1.571 Nhà đầu tư cá nhân.

e) Việc phân chia lợi nhuận của Quỹ là phù hợp với mục tiêu đầu tư của Quỹ: Trong kỳ kế toán sáu tháng kết thúc ngày 30 tháng 06 năm 2023, 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	Tỷ lệ so với lợi nhuận	Tỷ lệ so với chi phí hoạt động	Tỷ lệ so với thu nhập
Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng	0,00% (*)	0,19%	0,00% (**)
Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	0,08%	3,58%	0,08%
Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	0,12%	5,42%	0,12%

(*) Tỷ lệ so với lợi nhuận – Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng: 0,004%

(**) Tỷ lệ so với thu nhập – Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng: 0,004%

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	632.021.332
3	Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	957.120.811
	Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền	1.622.142.143

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.

Trong kỳ báo cáo, 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), TE 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 kỳ báo cáo đã được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của Nhà Đầu Tư của Quý.

Đánh giá dịch vụ Quản trị quỹ

Ngân hàng TMCP Ngoại Thương Việt Nam (“Ngân hàng”) 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. 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 (“VSD”)

VSD đang là nhà cung cấp dịch vụ Đại lý chuyển nhượng cho Quý.

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

Quy trình lưu trữ dữ liệu và kế hoạch dự phòng dữ liệu đảm bảo quy trình được diễn ra thông suốt. Hệ thống máy chủ của dịch vụ được đặt tại Trụ sở chính Hà Nội. Hệ thống dự phòng được đặt tại chi nhánh của VSD tại TP. 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 TE

Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP. Hồ Chí Minh hiện đang là tổ chức cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu và TE.

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 số 98/2020/TT-BTC ngày 16 tháng 11 năm 2020 của Bộ trưởng Bộ Tài chính).



Đánh giá dịch vụ Đại Lý Phân Phối

Các Thành viên lập quỹ (TVLQ) kiêm Đại lý phân phối đều đáp ứng được yêu cầu về việc kết nối với Ngân hàng TMCP Ngoại Thương Việt Nam và nhà cung cấp dịch vụ đại lý chuyển nhượng, đảm bảo quy trình nghiệp vụ của TVLQ diễn ra thông suốt không bị gián đoạn. TVLQ đã đáp ứng được yêu cầu về quy trình ngăn giao dịch muộn, các quy trình về lưu trữ thông tin và bảo mật thông tin khách hàng.

TỔNG GIÁM ĐỐC (GIÁM ĐỐC)
CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ
(Ký, ghi rõ họ tên và đóng dấu)



Lê Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC