

QUỸ ETF SSIAM VNX50

Số/No.: 451/2024/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 20 tháng 03 năm 2024

CÔNG BỐ THÔNG TIN ĐỊNH KỲ

Kính gửi/ To: - 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
- Tên tổ chức: **Quỹ ETF SSIAM VNX50**
- Mã chứng khoán: **FUESSV50**
- Địa chỉ trụ sở chính: Tầng 5, Tòa nhà số 1C Ngô Quyền, 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 năm 2023 của Quỹ ETF SSIAM VNX50.

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của Công ty/Quỹ vào ngày 20/03/2024 tại đường dẫn: <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.

Tài liệu đính kèm:

Báo cáo tổng kết hoạt động của Công ty
quản lý quỹ năm 2023 của Quỹ ETF
SSIAM VNX50

Người công bố thông tin



Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Hà Nội, ngày 20 tháng 03 năm 2024

BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ
Năm 2023Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước
Sở Giao Dịch Chứng Khoán TP.Hồ Chí Minh**1. Thông tin về quỹ**

a) Tên của Quỹ: QUỸ ETF SSIAM VNX50 ("Quỹ") ("FUESSV50")

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 VNX50 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 VNX50

Mã cổ phiếu và tỷ trọng của FUESSV50 tại ngày 31/12/2023 như sau:

Số thứ tự	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)
1	ACB	5,62%
2	CTG	1,47%
3	DCM	0,28%
4	DGC	1,44%
5	DIG	0,88%
6	DPM	0,39%
7	EIB	1,93%
8	FPT	6,97%
9	GEX	0,94%
10	GMD	1,30%
11	HCM	0,52%
12	HDB	2,77%
13	HPG	6,01%
14	HSG	0,80%
15	IDC	0,75%
16	KBC	1,23%
17	KDC	0,59%
18	KDH	1,10%
19	LPB	2,44%
20	MBB	3,60%
21	MSB	1,49%
22	MSN	2,90%
23	MWG	3,37%
24	NLG	0,61%

Số thứ tự	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)
25	NVL	0,00% (*)
26	PDR	0,69%
27	PLX	0,00%
28	PNJ	1,61%
29	POW	0,36%
30	PVD	0,47%
31	PVS	0,61%
32	SBT	0,29%
33	SHB	2,10%
34	SHS	0,98%
35	SSI	2,25%
36	STB	3,54%
37	TCB	4,89%
38	TPB	1,55%
39	VCB	3,33%
40	VCG	0,49%
41	VCI	0,88%
42	VGC	0,32%
43	VHC	0,46%
44	VHM	3,79%
45	VIB	1,84%
46	VIC	3,44%
47	VJC	2,15%
48	VND	1,36%
49	VNM	3,79%
50	VPB	7,18%
51	VPI	0,40%
52	VRE	1,42%
Tổng cộng		99,61%

(*) Tỷ trọng của mã cổ phiếu NVL tại ngày 31/12/2023 là 0,003%.

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	9.800.000	ccq
Tổng số lượng chứng quỹ phát hành thêm trong kỳ	1.000.000	ccq
Tổng số lượng chứng quỹ mua lại trong kỳ	(1.200.000)	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ quỹ tại ngày 31/12/2023	9.600.000	ccq

g) Nội dung thay đổi tại Điều lệ Quỹ trong kỳ báo cáo (nếu có): Trong kỳ báo cáo, Quỹ không thay đổi Điều lệ.

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://ssi.com.vn/ssiam/cong-bo-thong-tin-vnx50-cbtt-chi-tiet/etf-ssiam-vnx50-cong-bo-thong-tin-nghi-quyet-va-bien-ban-hop-dai-hoi-nha-dau-tu-thuong-nien-nam-2023-cua-quy-etf-ssiam-vnx50>

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:

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...) trên tổng tài sản của Quỹ:

Cơ cấu tài sản:

Loại tài sản	31/12/2023	31/12/2022	31/12/2021
1. Danh mục chứng khoán	99,61%	99,80%	99,70%
2. Tài sản khác	0,39%	0,20%	0,30%
Tổng	100,00%	100,00%	100,00%

Phân bổ theo ngành:

STT	Ngành	31/12/2023 %	31/12/2022 %	31/12/2021 %
1	Tài chính	48,76	48,43	43,75
2	Bất động sản	12,28	15,22	20,75
3	Công nghiệp	8,89	4,91	8,86
4	Vật liệu	8,25	6,23	7,30
5	Tiêu dùng thiết yếu	8,04	11,70	9,74
6	Công nghệ thông tin	6,97	5,85	3,75
7	Tiêu dùng không thiết yếu	4,98	5,89	4,21
8	Năng lượng	1,08	1,16	1,03
9	Dịch vụ tiện ích	0,36	0,41	0,43
10	Tiền và tương đương tiền	0,39	0,20	0,18
	Tổng cộng	100,00	100,00	100,00

Chỉ tiêu	31/12/2023	31/12/2022	31/12/2021
2.1. Giá trị tài sản ròng của Quỹ	162.764.538.263	140.789.386.539	312.381.678.744
2.2. Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành	9.600.000	9.800.000	13.500.000
2.3. Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ)	16,954.63	14.366,26	23.139,38
2.4. Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	18.576,65	23,416.32	23.486,23
2.5. Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	14.265,96	12.574,53	14.736,04
2.6. Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo	16.700	14.050	22.900
2.7. Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	19.980	23.690	23.500
2.8. Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	14.110	11.010	15.250
2.9. Tổng tăng trưởng (%) / 1 đơn vị CCQ	18,02%	-37,91%	48,5%
2.10. Tỷ lệ chi phí hoạt động của Quỹ (%)	1,49%	1,08%	1,10%
2.11. Tốc độ vòng quay danh mục (%)	15,69%	8,61%	23,56%

- Tỷ lệ chi phí hoạt động năm 2023 tăng so với năm 2022 chủ yếu do giá trị tài sản ròng trung bình năm nay giảm so với năm trước, cao hơn mức giảm của chi phí hoạt động của quỹ.

- Tốc độ vòng quay danh mục trong năm 2023 tăng so với năm 2022 nguyên nhân do giá trị tài sản ròng trung bình năm nay giảm so với năm trước nhưng vẫn cao hơn mức giảm của tổng giá trị giao dịch trong năm nay.

- 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)
2.11. Lãi do đánh giá các khoản đầu tư chưa thực hiện	30.286.868.817
2.12. Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...)	2.495.878.510
2.13. Doanh thu khác	20.000.000
2.14. Lỗ thu được từ bán cổ phiếu	(6.889.355.117)
2.15. Tổng chi phí	(2.156.758.543)
Tổng cộng	23.756.633.667

- 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) 1 năm	23.756.633.667
ii) 3 năm	(3.428.378.580)
iii) 5 năm	7.063.915.012

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: Không 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

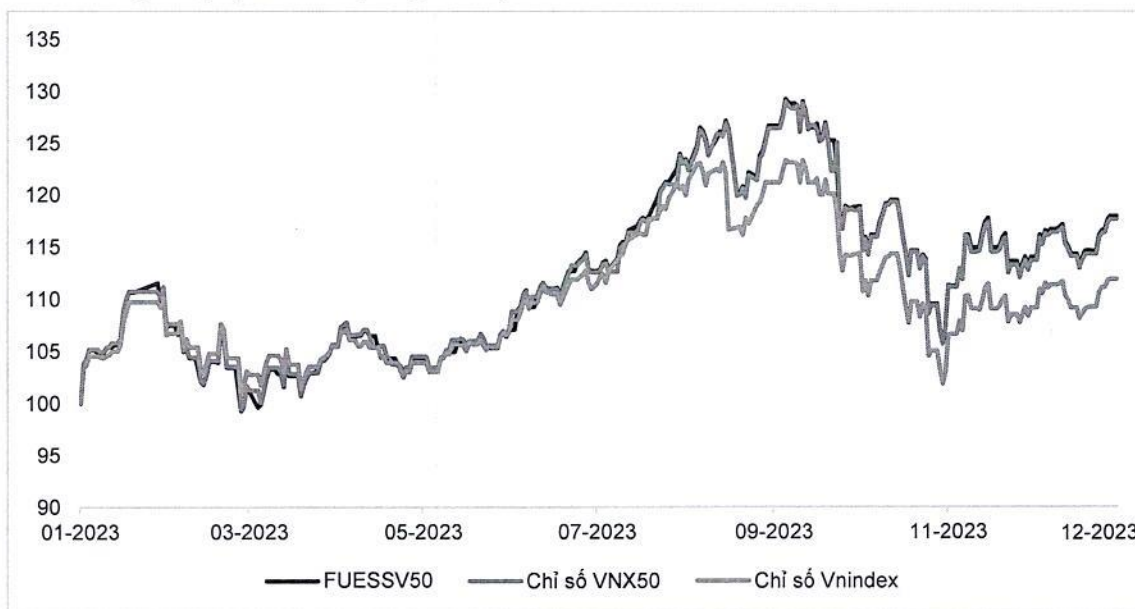
Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ phải bao gồm các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi Công ty quản lý quỹ (nếu có): Không có

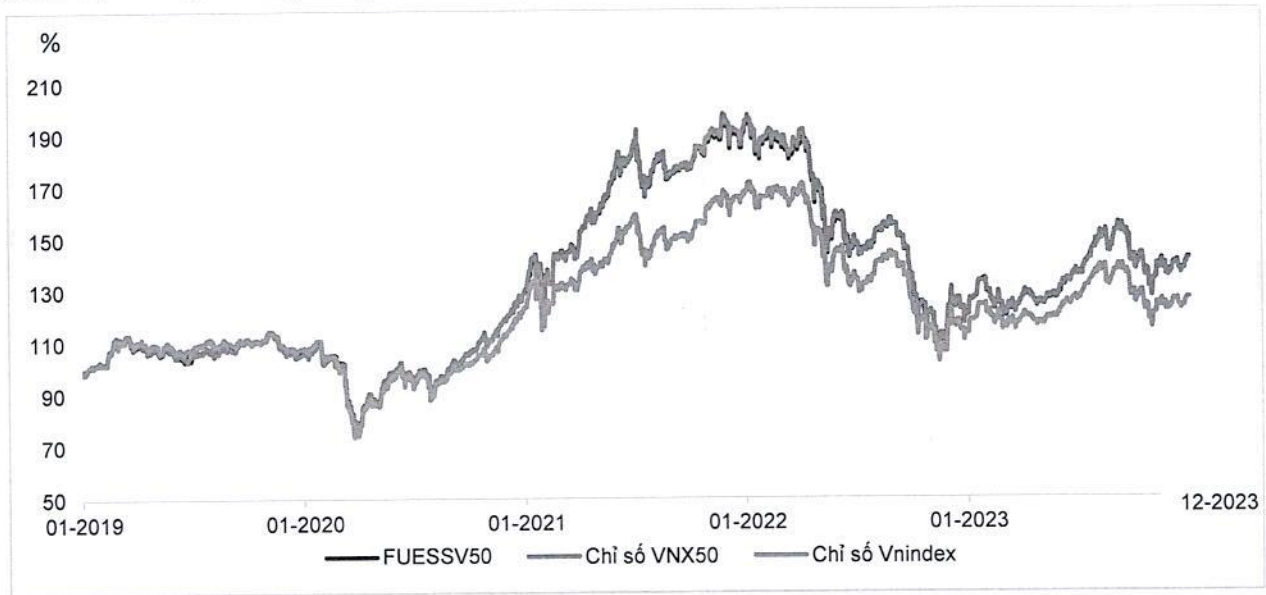
b) Thuyết minh về việc quỹ có đạt được mục tiêu đầu tư (thuyết minh này chỉ cần thiết tại báo cáo hàng năm của Quỹ):

Chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking error/TE) trong kỳ báo cáo không vượt mức **0,45%**, 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):



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 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 VNX50 với tỷ trọng tương ứng nhằm bám sát tỷ lệ sinh lời của chỉ số VNX50.

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 31/12/2023 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 99,61%, 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 tại kỳ báo cáo gần nhất:

Giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 31/12/2023 của Quỹ ETF SSIAM VNX50 là 16.954,63 đồng tăng 18,02% so với giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 31/12/2022 là 14.366,26 đồng, cùng thời gian đó chỉ số tham chiếu tăng tương ứng 17,72%.

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):

Chỉ số VN-Index tăng 12,2% trong năm 2023 và vượt qua các chỉ số trong khu vực bao gồm chỉ số SET của Thái Lan (-15,2%), chỉ số PCOMP của Philippines (-1,8%), và chỉ số JCI của Indonesia (+6,2%). Sau một năm 2022 đầy khó khăn với sự sụt giảm mạnh 32,8%, VN-Index đã phục hồi trong nửa đầu 2023 nhờ dòng tiền từ các nhà đầu tư nước ngoài. Sự phục hồi của VN-Index được củng cố bởi các nhà đầu tư cá nhân khi họ trở lại thị trường chứng khoán và đẩy giá trị giao dịch trung bình mỗi ngày lên mức cao khoảng 900 triệu USD vào tháng Tám năm 2023. Môi trường lãi suất thấp ở Việt Nam và lợi nhuận cao từ thị trường chứng khoán đã thu hút các nhà đầu tư cá nhân, do đó, tăng mạnh số tài khoản giao dịch mới lên mức cao nhất là 190.000 vào tháng Tám năm 2023. Tuy nhiên, thị trường chứng khoán không thể duy trì đà tăng của mình và mất đi đà tăng do áp lực bán ra từ các nhà đầu tư nước ngoài tăng lên. Việc tăng lãi suất của Fed và định giá tương đối cao của VN-Index đã kích thích áp lực bán ra từ các nhà đầu tư nước ngoài và đẩy chỉ số này giảm gần 20% trước khi hồi phục khoảng 11% để kết thúc năm 2023 ở mức 1.129,93 điểm.

tư cá nhân, do đó, tăng mạnh số tài khoản giao dịch mới lên mức cao nhất là 190.000 vào tháng Tám năm 2023. Tuy nhiên, thị trường chứng khoán không thể duy trì đà tăng của mình và mất đi đà tăng do áp lực bán ra từ các nhà đầu tư nước ngoài tăng lên. Việc tăng lãi suất của Fed và định giá tương đối cao của VN-Index đã kích thích áp lực bán ra từ các nhà đầu tư nước ngoài và đẩy chỉ số này giảm gần 20% trước khi hồi phục khoảng 11% để kết thúc năm 2023 ở mức 1.129,93 điểm.

Năm 2023 chứng kiến sự chênh lệch về hiệu suất của các ngành. Công nghệ thông tin, nguyên vật liệu, công nghiệp và tài chính là những ngành có hiệu suất tốt nhất trong năm 2023 sau khi ghi nhận sự suy giảm mạnh từ 25 đến 50% trong năm 2022. Nhu cầu mạnh mẽ về chuyển đổi số, đầu tư hạ tầng tăng và dòng vốn FDI bền vững là các động lực chính cho sự phát triển của các ngành này. Ngược lại, hàng tiêu dùng thiết yếu, bất động sản và tiện ích là những ngành có hiệu suất kém hơn. Vấn đề pháp lý, nhu cầu suy yếu và quá trình giảm nợ của các nhà phát triển bất động sản tiếp tục làm suy yếu ngành bất động sản. Sự tham gia mạnh mẽ của các nhà đầu tư cá nhân là điểm sáng của thị trường, giúp cân bằng áp lực bán từ các nhà đầu tư nước ngoài với giá trị bán ròng đạt 1 tỷ USD. Các nhà đầu tư cá nhân tập trung vào các cổ phiếu vừa và nhỏ, giúp nhóm cổ phiếu vừa và nhỏ tăng trưởng 30 - 32%, vượt trội so với cổ phiếu vốn hóa lớn (+12,6%). Do đó, định giá của cổ phiếu vừa và nhỏ trở nên cao hơn, lần lượt là 32,4 và 18,4 lần lợi nhuận so với cổ phiếu vốn hóa lớn (với P/E ở mức 11,7 lần).

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	(6.889.355.117)	30.286.868.817
<i>Trong đó:</i>		
<i>Vốn hóa lớn</i>	(1.995.909.947)	19.622.493.598
<i>Vốn hóa vừa</i>	(4.893.445.170)	10.664.375.219
<i>Vốn hóa nhỏ</i>	-	-

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: từ ngày 01 tháng 01 năm 2023 đến ngày 31 tháng 12 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: Công ty TNHH Quản lý quỹ SSI 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 hoán đổi danh mục, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan. Trong kỳ, quỹ không thực hiện hoạt động vay.

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 ETF SSIAM VNX50 đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.

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: 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 2023 đến ngày 31 tháng 12 năm 2023, Quỹ đã thực hiện:

Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: Trong kỳ Quỹ phát hành thêm 1.000.000 chứng chỉ quỹ tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 10.000.000.000 đồng

Mua lại chứng chỉ Quỹ: Trong kỳ Quỹ mua lại 1.200.000 chứng chỉ quỹ tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 12.000.000.000 đồng.

e) Việc phân chia lợi nhuận của Quỹ là phù hợp với mục tiêu đầu tư của Quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2023 đến ngày 31 tháng 12 năm 2023, Quỹ không chia cổ tức.

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 thu nhập	Tỷ lệ so với tổng chi phí hoạt động
Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng	0,28%	0,25%	3,06%
Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	0,83%	0,76%	9,18%
Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	0,21%	0,19%	2,32%

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 (VND)
1	Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng	66.000.000
2	Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	198.000.000
3	Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	50.000.000
	Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền	314.000.000

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.

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 Quỹ.

Đánh giá dịch vụ Quản trị quỹ

Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam – chi nhánh Hà Thành (“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. Hệ thống này được cập nhật định kỳ 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 (“VSDC”)

Tổng Công Ty Lưu Ký Và Bù Trừ Chứng Khoán Việt Nam (“VSDC”) 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 VSDC 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 VSDC tại TP. Hồ Chí Minh, đồng thời dữ liệu được sao lưu hàng ngày ra băng từ và được lưu trữ tại VSDC 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.

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 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 Đầu tư và Phát triển Việt Nam – chi nhánh Hà Thành 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)



Tổ Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC