

QUỸ ETF SSIAM VN30

Số/No. *1223*/2024/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 13 tháng 08 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 VN30**
- Mã chứng khoán: **FUESSV30**
- 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 Nguyễn Ngọc Anh
- Chức vụ: Tổng Giám Đốc

Nội dung thông tin công bố:

Báo cáo tổng kết hoạt động của Công ty quản lý quỹ của Quỹ ETF SSIAM VN30 bán niên 2024.

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của Công ty/Quỹ vào ngày 13/08/2024 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 của Quỹ ETF SSIAM VN30 bán niên 2024

Thao
Người công bố thông tin



TỔNG GIÁM ĐỐC
Nguyễn Ngọc Anh

Hà Nội, ngày 13 tháng 08 năm 2024

BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ**Bán niên 2024**

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

1. Thông tin về quỹ

a) Tên của Quỹ: QUỸ ETF SSIAM VN30 ("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 VN30 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 VN30

Mã cổ phiếu và tỷ trọng của FUESSV30 tại ngày 30/06/2024 như sau:

Số thứ tự	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (% Tổng tài sản)
1	ACB	7,21%
2	BCM	0,40%
3	BID	0,74%
4	BVH	0,29%
5	CTG	1,88%
6	FPT	12,21%
7	GAS	0,66%
8	GVR	0,41%
9	HDB	3,76%
10	HPG	7,51%
11	MBB	4,87%
12	MSN	4,03%
13	MWG	5,50%
14	PLX	0,39%
15	POW	0,53%
16	SAB	0,64%
17	SHB	2,64%
18	SSB	2,15%
19	SSI	2,70%

Số thứ tự	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (% Tổng tài sản)
20	STB	4,09%
21	TCB	8,06%
22	TPB	1,43%
23	VCB	3,95%
24	VHM	3,71%
25	VIB	1,81%
26	VIC	3,56%
27	VJC	2,28%
28	VNM	4,13%
29	VPB	6,69%
30	VRE	1,40%
Tổng cộng		99,63%

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 lượng chứng chỉ quỹ tại ngày 31/12/2023	10.200.000	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ quỹ phát hành thêm trong kỳ	100.000	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ quỹ mua lại trong kỳ	(1.000.000)	ccq
Tổng số lượng chứng chỉ quỹ tại ngày 30/06/2024	9.300.000	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 2024 theo đường link sau:

<https://www.ssi.com.vn/ssiam/cong-bo-thong-tin-vn30-cbtt-chi-tiet/etf-ssiam-vn30-cong-bo-thong-tin-nghi-quyet-va-bien-ban-hop-dai-hoi-nha-dau-tu-thuong-nien-nam-2024-1>

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 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 30/06 của 3 năm gần nhất:

Quỹ được Ủy Ban Chứng Khoán nhà nước cấp giấy chứng nhận lập quỹ số 45/GCN-UBCK ngày 22/07/2020.

- Danh mục đầu tư của Quỹ phân bố theo ngành, lĩnh vực và loại sản phẩm (cổ phiếu, trái phiếu...) (%NAV) tại ngày 30/06/2024:

Cơ cấu tài sản

Loại tài sản (% Tổng tài sản)	30/06/2024	30/06/2023	30/06/2022
1. Danh mục chứng khoán	99,63%	99,64%	99,23%
2. Tiền và tương đương tiền	0,27%	0,13%	0,58%
3. Tài sản khác	0,10%	0,23%	0,19%
Tổng cộng	100,00%	100,00%	100,00%

Phân bố theo ngành

STT	Ngành (% NAV)	30/06/2024	30/06/2023	30/06/2022
1	Bất động sản	9,09%	15,52%	22,37%
2	Công nghệ thông tin	12,23%	7,38%	6,71%
3	Công nghiệp	2,28%	2,33%	5,15%
4	Năng lượng	0,39%	0,43%	0,43%
5	Tài chính	52,38%	49,48%	39,30%
6	Tiện ích	1,19%	1,52%	1,60%
7	Tiêu dùng không thiết yếu	5,51%	4,34%	6,08%
8	Tiêu dùng thiết yếu	8,81%	10,94%	11,41%
9	Vật liệu	7,93%	7,94%	6,29%
Tổng cộng		99,81%	99,88%	99,34%

Chỉ tiêu	30/06/2024	30/06/2023	30/06/2022
2.1. Giá trị tài sản ròng của Quỹ	147.574.610.666	105.300.870.758	83.336.765.557
2.2. Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành	9.300.000	7.600.000	5.400.000
2.3. Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ)	15.868,23	13.855,37	15.432,73
2.4. Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	16.551,11	14.078,04	19.296,10
2.5. Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	13.959,85	12.386,50	14.965,94
2.6. Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo	15.800	13.910	15.330
2.7. Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	16.590	13.970	19.260
2.8. Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	13.860	12.350	15.000
2.9. Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ	13,67%	11,85%	-18,83%
2.10. Tỷ lệ chi phí hoạt động của Quỹ (%)	1,42%	1,83%	1,49%
2.11. Tốc độ vòng quay danh mục (%)	7,85%	8,23%	7,29%

- Tổng chi phí hoạt động 6 tháng năm 2024 tăng so với cùng kỳ năm trước, nhưng mức tăng nhỏ hơn mức tăng của giá trị tài sản ròng trung bình trong 6 tháng đầu năm do đó tỷ lệ chi phí hoạt động trên giá trị tài sản ròng ("GTTSR") trung bình kỳ này thấp hơn so với cùng kỳ năm trước.

- Tổng giá trị danh mục giao dịch mua vào bán ra tăng nhưng mức tăng nhỏ hơn mức tăng của giá trị tài sản ròng trung bình trong 6 tháng đầu năm do đó tốc độ vòng quay danh mục 6 tháng đầu năm 2024 kỳ này thấp hơn so với cùng kỳ năm 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 do đánh giá các khoản đầu tư chưa thực hiện	16.591.900.862
2.13. Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...)	2.024.954.108
2.14. Lợi nhuận thu từ bán cổ phiếu	1.744.014.438
2.15. Tổng chi phí	(1.056.649.477)

Chỉ tiêu	Số tiền (VND)
Tổng cộng	19.304.219.931

- 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	20.829.991.810
ii) 3 năm	(1.385.731.255)
iii) 5 năm	N/A (*)

(*) Quỹ thành lập ngày 22/06/2020 nên không có đủ dữ liệu của 5 năm gần nhất.

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 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.

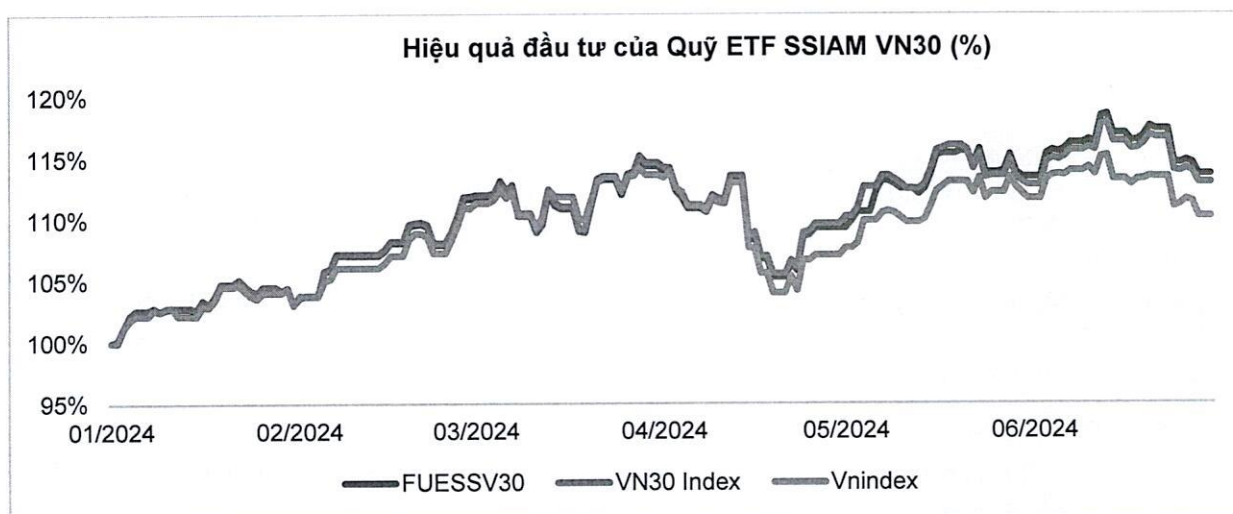
3. Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ

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): Chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking error/TE) trong kỳ báo cáo không vượt mức **0,77%** 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 (bảng đồ thị): Quỹ thành lập ngày 22/06/2020 nên không có đủ dữ liệu của 5 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 VN30 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 30/30 cổ phiếu trong danh mục rổ VN30 với tỷ trọng tương ứng nhằm bám sát tỷ lệ sinh lời của chỉ số VN30.

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 30/06/2024 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 99%, do Quỹ là loại hình quỹ hoán đổi danh mục mô phỏng theo chỉ số. Sự khác biệt chủ yếu giữa 2 kỳ do sự thay đổi cơ cấu tỷ trọng danh mục đầu tư khi chỉ số tái cơ cấu.

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 30/06/2024 của Quỹ ETF SSIAM VN30 là 15.868,23 đồng, tăng khoảng 13,67% so với giá trị tài sản ròng trên 1 đơn vị quỹ tại ngày 31/12/2023 là 13.960,36 đồng, cùng thời gian đó chỉ số tham chiếu tăng tương ứng 12,98%.

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):

Bước sang quý II/2024, thị trường chứng khoán Việt Nam gặp phải một số trở ngại nhỏ, chứng kiến các nhịp điều chỉnh sâu trong tháng 4 và tháng 6, trước tác động của nhiều yếu tố trong và ngoài nước.

Trên thế giới, tăng trưởng kinh tế tiếp tục duy trì ở mức thấp, đặc biệt là khu vực châu Âu; căng thẳng chính trị, xung đột quân sự leo thang tại Trung Đông. Trong nước, chênh lệch lãi suất USD/VND vẫn ở mức cao, áp lực tỷ giá gia tăng trong thời gian qua, làm gia tăng lo ngại về khả năng đổi chiều chính sách tiền tệ. Dưới góc độ kỹ thuật, vùng 1.280 – 1.300 điểm vẫn đang là rào cản tâm lý đối với các nhà đầu tư trên thị trường.

Sau những phiên giảm điểm điều chỉnh ngắn hạn theo chu kỳ kinh tế của thị trường chứng khoán, dưới

các áp lực kinh tế - chính trị trên thế giới đầu quý II/2024, thị trường chứng khoán Việt Nam đã hồi phục tích cực trở lại trước sự khởi sắc của các thị trường chứng khoán thế giới. Cùng với đó, kết quả kinh doanh quý I tăng trưởng tích cực của các doanh nghiệp niêm yết trong nước được công bố (tăng trưởng 20% so với cùng kỳ năm 2023) và kỳ vọng khả quan vào kết quả kinh doanh bán niên của các doanh nghiệp niêm yết. Kết thúc phiên ngày 28/6/2024, chỉ số VN-Index đạt 1.245,32 điểm, tăng 10,2% so với cuối năm 2023; chỉ số HNX-Index đạt 237,59 điểm, tăng 2,8% so với cuối năm 2023.

Song song với diễn biến của điểm chỉ số, thanh khoản thị trường liên tục tăng trưởng trong quý I/2024 với giá trị giao dịch bình quân đạt 23.895 tỷ đồng/phiên, tăng 35,5% so với năm 2023. Thanh khoản thị trường tháng 4 giảm nhẹ so quý I/2023 và hồi phục trở lại từ tháng 5.

Tính chung 6 tháng đầu năm, giá trị giao dịch bình quân đạt 24.598 tỷ đồng/phiên, tăng 39,9% so với bình quân năm 2023.

Tính đến hết tháng 6/2024, thị trường có 729 cổ phiếu, chứng chỉ quỹ niêm yết trên 2 Sở giao dịch chứng khoán và 878 cổ phiếu đăng ký giao dịch trên UPCoM với tổng giá trị niêm yết, đăng ký giao dịch đạt gần 2,2 triệu tỷ đồng, tăng 2,3% so với cuối năm 2023 (tương đương 21,3% GDP ước tính năm 2023).

Mức vốn hóa thị trường cổ phiếu 3 sàn HOSE, HNX và UPCoM ngày 28/6/2024 đạt hơn 7 triệu tỷ đồng, tăng 19,0% so với cuối năm 2023; tương đương 69,1% GDP ước tính năm 2023.

Thị trường đã có đợt điều chỉnh nhỏ và chỉ số VN-Index đang được giao dịch ở mức định giá tương đối hấp dẫn. Chỉ số P/E giảm xuống 15,4 lần, thấp hơn mức trung bình ba năm là 16,3 lần. Với tăng trưởng kinh tế cao hơn kỳ vọng, thị trường được dự báo có thể hồi phục và duy trì mức tăng trong những tháng tới. Thị trường có thể tập trung ở các cổ phiếu có kết quả kinh doanh quý 2 tốt cùng triển vọng tăng trưởng cao trong nửa cuối năm nay. Nhìn chung, chúng tôi duy trì quan điểm tích cực đối với triển vọng của thị trường chứng khoán về cuối năm, hỗ trợ bởi tăng trưởng kinh tế mạnh mẽ và tăng trưởng lợi nhuận của các công ty niêm yết.

Lợi nhuận đầu tư đối với các loại tài sản:

Lãi theo tài sản	Lãi/(lỗ) đã thực hiện	Lãi/(lỗ) chưa thực hiện
Cổ phiếu	1.744.014.438	16.591.900.862
<i>Trong đó:</i>		
<i>Vốn hóa lớn</i>	1.744.014.438	16.591.900.862
<i>Vốn hóa vừa</i>	-	-
<i>Vốn hóa nhỏ</i>	-	-
Tổng	1.744.014.438	16.591.900.862

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 từ ngày 01 tháng 01 năm 2024 đến ngày 30 tháng 06 năm 2024, 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 2024, 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 2024, danh mục cổ phiếu niêm yết của Quỹ là 147.286.996.900 đồng, chiếm 99,63% tổng giá trị tài sản của Quỹ. Tiền gửi của Quỹ tại Ngân hàng giám sát là 393.599.433 đồng và 141.563.982 đồng là các tài sản khác (bao gồm các khoản phải thu và cổ tức được nhận).

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 VN30 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 đến ngày 30 tháng 06 năm 2024, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là +3,64% so với số liệu tại ngày 31/12/2023, thay đổi giá trị tài sản ròng trên chứng chỉ quỹ (NAV/CCQ) của Quỹ là +13,67%, thay đổi giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu là 53,93% so với từ khi thành lập. Tại ngày 30 tháng 06 năm 2024, giá trị tài sản ròng của Quỹ là 147.574.610.666 đồng. Giá trị tài sản ròng trên chứng chỉ quỹ trong kỳ cao nhất vào ngày 13/06/2024 (16.551,11 đồng) và thấp nhất vào ngày 01/01/2024 (13.959,85 đồng).

- Tính đến ngày 30 tháng 06 năm 2024, giá trị tài sản ròng của 01 lô chứng chỉ Quỹ là 1.586.823.770 đồng, giá trị tài sản ròng của 01 chứng chỉ Quỹ là 15.868,23 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 5.872.585.000 đồng và tổng giá trị bán ra là 5.847.995.000 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 2024, 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 pháp luật liên quan.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2024 đến ngày 30 tháng 06 năm 2024, Quỹ đã thực hiện:

- Phát hành thêm 100.000 chứng chỉ Quỹ, tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 1.000.000.000 đồng.
- Mua lại 1.000.000 chứng chỉ Quỹ, tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 10.000.000.000 đồng.

- Số lượng Nhà đầu tư bao gồm cả Công ty Quản lý Quỹ và Người có liên quan tính đến ngày 30/06/2024 là 1.752 Nhà Đầu tư, trong đó công ty Quản lý Quỹ và người có liên quan của công ty Quản lý Quỹ nắm giữ chứng chỉ quỹ với tỷ lệ là 36,32%, tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất là 67,45% và tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài là 9,36%.

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 2024, 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 thu nhập	Tỷ lệ so với tổng chi phí hoạt động
Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng	0,17%	0,16%	3,12%
Chi phí dịch vụ Quản trị quỹ	0,51%	0,49%	9,37%
Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	0,19%	0,18%	3,51%

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

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	99.000.000
3	Tiền dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu (iNAV)	37.131.981
Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền		169.131.981

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 cho Quý 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 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

Trong kỳ, Tổng Công ty Lưu ký và Bù trừ Chứng khoán Việt Nam (“VSDC”) 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 quý 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 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)



Trần Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC