

BÁO CÁO THAY ĐỔI GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG GIAO DỊCH CHỨNG CHỈ QUỸ

Tên Công ty Quản lý quỹ:

Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Vietcombank

Tên Ngân Hàng Giám Sát:

Deutsche Bank AG, Chi nhánh Hồ Chí Minh

Kỳ báo cáo: Từ

01/11/2015

Tới 30/11/2015

Đơn vị tính: VND

STT	Nội dung	Kỳ báo cáo	Kỳ trước
Quỹ đầu tư Cân Bằng Chiến Lược VCBF (VCBF-TBF)			
I	Giá trị tài sản ròng của quỹ (NAV) đầu kỳ	88,875,043,421	82,585,284,934
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	(603,859,453)	6,947,208,950
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	(603,859,453)	6,947,208,950
II.2	Thay đổi NAV do phân chia lợi nhuận cho nhà đầu tư trong kỳ	-	-
III	Thay đổi NAV do mua lại, phát hành thêm chứng chỉ quỹ (=III.1 - III.2)	(548,346,391)	(657,450,463)
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	554,980,832	443,970,832
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(1,103,327,223)	(1,101,421,295)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	87,722,837,577	88,875,043,421

Ngân Hàng Giám Sát

Trần Đài Trang

Trưởng Ban Dịch Vụ Quản Trị Quỹ

Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



Tp. Hồ Chí Minh, ngày 07 tháng 12 năm 2015

Nguyễn Trung Nam

Phó Tổng Giám Đốc

Công ty Quản lý Quỹ



Đặng Vũ Hoài Diệu

Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán

Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM

BÁO CÁO ĐỊNH KỲ HOẠT ĐỘNG ĐẦU TƯ CỦA QUỸ

1. Tên Công ty quản lý quỹ:
2. Tên Ngân Hàng Giám Sát:
3. Tên quỹ:
4. Ngày lập báo cáo:

Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán
Deutsche Bank AG, Chi Nhánh
Quỹ đầu tư Cân Bằng Chiến Lược VCBF (VCBF-TBF)
Từ 01/11/2015 Đến 30/11/2015

Đơn vị tính: VND

I. BÁO CÁO VỀ TÀI SẢN CỦA QUỸ

STT	Tài sản	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
I.1	Tiền và các khoản tương đương tiền	23,438,987,567	25,619,884,015	97.92
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	3,738,775,067	5,919,671,515	108.75
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19,700,212,500	19,700,212,500	96.10
I.2	Các khoản đầu tư	63,851,293,400	62,577,719,600	114.46
	Cổ phiếu	63,851,293,400	62,577,719,600	114.46
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	29,000,000	-	-
1	Cổ tức, trái tức được nhận	29,000,000	-	-
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1,240,718,381	1,119,933,790	98.24
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	-	73,889,000	-
	Cổ phiếu	-	73,889,000	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	88,559,999,348	89,391,426,405	109.19
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	403,354,125	80,801,020	-
	Cổ phiếu	403,354,125	80,801,020	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	433,807,646	435,581,964	16.76
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	9,272,168	4,038,584	26.49
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	9,272,168	4,038,584	28.80
3	Phải trả thuế	3,619,952	2,516,624	158.05
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	-	52,735,652	-
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	771.11
6	Phí quản trị quỹ	9,493,149	9,809,586	316.90
7	Phải trả phí quản lý quỹ	109,840,163	110,455,223	107.55
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	771.11
9	Phí đại lý chuyển nhượng	11,550,000	11,550,000	385.56
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	101,576,539	93,424,814	98.99
12	Thù lao ban đại diện	17,902,176	36,097,827	132.97
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	1,989,131	4,010,870	132.97
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,100,000	5,670,000	55.56
17	Lãi trả trước	-	-	-
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	113,092,200	57,134,200	622.49
30	Doanh thu ghi nhận trước	-	-	-
II.3	Tổng nợ	837,161,771	516,382,984	32.35
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	87,722,837,577	88,875,043,421	111.72
	Tổng số đơn vị quỹ	6,854,693.07	6,896,620.98	97.69
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	12,797.48	12,886.75	114.36

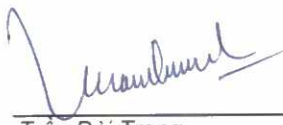
II. BÁO CÁO KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG

STT	Chỉ tiêu	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	Lũy kế từ đầu năm
I.	Thu nhập từ hoạt động đầu tư	158,211,029	129,889,600	3,768,154,847
1	Cổ tức, trái tức được nhận	29,000,000	-	2,342,528,000
	Cổ tức được nhận	29,000,000	-	2,342,528,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	122,951,846	125,813,705	1,374,561,554
3	Các khoản thu nhập khác	6,259,183	4,075,895	51,065,293
II	Chi phí	201,433,282	231,899,950	2,184,267,707
1	Phí quản lý quỹ	109,840,163	110,455,223	1,107,561,383
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	46,969,394	50,468,445	522,459,751
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	230,963,255
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,100,000	5,670,000	30,030,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	254,059,580
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	769,394	698,445	7,406,916
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	21,152,874	21,428,887	236,355,546
3.1	Phí quản trị quỹ	9,493,149	9,809,587	105,649,966
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,659,725	11,619,300	130,705,580
4	Phí kiểm toán	8,151,725	8,423,448	101,576,539
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	9,782,610	10,108,697	89,891,307
5.1	Thù lao ban đại diện	9,782,610	10,108,697	89,891,307
5.3	Phí cung cấp giá chứng khoán	-	-	-
6	Chi phí dự thảo, in ấn, bản cáo bạch tóm tắt, sao kê tài khoản, tài liệu nhà đầu tư, chi phí tổ chức họp, ban đại diện quỹ;	-	-	17,791,705
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	-	10,702,233
6.2	Chi phí báo cáo thường niên	-	-	-
6.3	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	7,089,472
7	Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản quỹ	2,751,316	9,401,900	39,633,551
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	2,785,200	21,613,350	68,997,925
9.1	Phí ngân hàng	475,200	594,000	7,828,575
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	-	18,709,350	35,759,350
9.3	Phí giấy phép thành lập	-	-	-
9.4	Dịch vụ bưu chính	-	-	-
9.5	Phí quảng cáo	-	-	-
9.6	Dịch vụ quỹ mở - DBDI	2,310,000	2,310,000	25,410,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	(43,222,253)	(102,010,350)	1,583,887,140
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	(560,637,200)	7,049,219,300	11,230,038,900
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	-	2,395,704,471	4,218,097,180
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	(560,637,200)	4,653,514,829	7,011,941,720
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	(603,859,453)	6,947,208,950	12,813,926,040
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	88,875,043,421	82,585,284,934	76,934,977,598
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	(1,152,205,844)	6,289,758,487	10,787,859,979
	Trong đó			
1	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do các hoạt động liên quan đến đầu tư của quỹ trong kỳ	(603,859,453)	6,947,208,950	12,813,926,040
2	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do việc phân phối thu nhập của quỹ cho các nhà đầu tư trong kỳ	-	-	-
3	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do việc phát hành thêm/mua lại chứng chỉ quỹ cho các nhà đầu tư trong kỳ	554,980,832	443,970,832	6,377,177,983
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(1,103,327,223)	(1,101,421,295)	(8,403,244,044)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	87,722,837,577	88,875,043,421	87,722,837,577

IV. MỘT SỐ CHỈ TIÊU KHÁC

STT	Chỉ tiêu	Kỳ báo cáo	Kỳ trước
I	Các chỉ tiêu về hoạt động		
1	Tỷ lệ phí quản lý quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ(%)	1.48%	1.53%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.63%	0.70%
3	Tỷ lệ phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng và các chi phí khác cho tổ chức cung cấp dịch vụ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.28%	0.30%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.11%	0.12%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.13%	0.14%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.71%	3.21%
7	Tốc độ vòng quay danh mục trong kỳ (%) = (Tổng giá trị danh mục mua vào + Tổng giá trị danh mục bán ra)/ Giá trị tài sản ròng trung bình(%)	12.36%	43.39%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	68,966,209,800	69,501,152,000
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	6,896,620.98	6,950,115.20
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	42,816.60	35,754.33
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	428,166,000	357,543,300
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(84,744.51)	(89,248.55)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(847,445,100)	(892,485,500)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	68,546,930,700	68,966,209,800
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	6,854,693.07	6,896,620.98
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	79.99%	79.50%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	85.93%	85.38%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	38.23%	37.99%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	317	325
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	12,797.48	12,886.75

Ngân Hàng Giám Sát



Trần Đài Trang
Trưởng Ban Dịch Vụ Quản Trị Quỹ
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



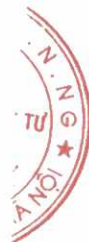
Đặng Vũ Hoạt Diệu
Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



Chi nhánh Tp. HCM, ngày 07 tháng 12 năm 2015

Nguyễn Trung Nam
Phó Tổng Giám Đốc

Công ty Quản lý Quỹ



Phụ Lục 31 - Mẫu Báo Cáo hoạt động vay, giao dịch mua bán lại của quỹ
(Ban hành kèm theo Thông tư 183 hướng dẫn về việc thành lập và quản lý Quỹ mở)

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

BÁO CÁO HOẠT ĐỘNG VAY, GIAO DỊCH MUA BÁN LẠI CỦA QUỸ

Tháng 11 Năm 2015

Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

Công ty quản lý quỹ:

Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Vietcombank

Địa chỉ:

Ngân hàng giám sát:

Ngân Hàng Deutsche Bank AG, Chi Nhánh Hồ Chí Minh

Địa chỉ:

65 Lê Lợi, Quận 1, TP.HCM, Việt Nam

STT	Nội dung hoạt động (nêu chi tiết theo mục tiêu và đối tác)	Đối tác	Mục tiêu/Tài sản đảm bảo	Kỳ hạn	Giá trị khoản vay hoặc khoản cho vay	Thời điểm giao dịch		Thời điểm báo cáo	
						Ngày tháng năm	Tỷ lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ	Ngày tháng năm	Tỷ lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ
1.1	Vay tiền								
	Không có								
I	Tỷ lệ tiền vay từ các hợp đồng/giá trị tài sản ròng								
1.2	Hợp đồng repo								
II	Tổng giá trị các hợp đồng Repo/giá trị tài sản ròng của quỹ								
A	Tổng giá trị các khoản vay/giá trị tài sản ròng của quỹ (=I+II)								
2.1	Cho vay chứng khoán								
	Không có								
I	Tổng giá trị các hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ								
2.2	Hợp đồng reverse repo								
	Không có								
II	Tổng giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ								
B	Tổng giá trị các khoản cho vay/giá trị tài sản ròng của quỹ (=I+II)								

Ngân Hàng Giám Sát



Trần Đài Trang

Trưởng Ban Dịch Vụ Quản Trị Quỹ
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



Đặng Vũ Hoài Diệu

Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



Tp. Hồ Chí Minh, ngày 07 tháng 12 năm 2015

Nguyễn Trung Nam

Phó Tổng Giám Đốc