

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
Quý III Năm 2015

Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

Công ty quản lý quỹ:
Địa chỉ:

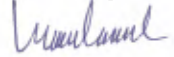
Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Vietcombank

Ngân hàng giám sát:
Địa chỉ:

Ngân Hàng Deutsche Bank AG, Chi Nhánh Hồ Chí Minh
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 16 tháng 09 năm 2015

Nguyễn Trung Năm
Phó Tổng Giám Đốc



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

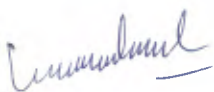
Tên Công ty Quản lý quỹ:
Tên Ngân Hàng Giám Sát:
Kỳ báo cáo: Từ

Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Vietcombank
Deutsche Bank AG, Chi nhánh Hồ Chí Minh
01/07/2015 Tới 30/09/2015

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	79,109,574,419	75,525,594,702
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	2,822,985,214	3,813,206,817
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	2,822,985,214	3,813,206,817
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)	652,725,301	(229,227,100)
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	3,142,195,416	1,039,818,769
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(2,489,470,115)	(1,269,045,869)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	82,585,284,934	79,109,574,419

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 15 tháng 10 năm 2015

Nguyễn Trung Nam

Phó Tổng Giám Đốc

Công ty Quản lý Quỹ

Phụ Lục 34 - Mẫu Báo Cáo Định Kỳ về hoạt động đầu tư của Quỹ
(Ban hành kèm theo Thông tư 183 hướng dẫn về việc thành lập và quản lý Quỹ mở)

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 Vietcombank
Deutsche Bank AG, Chi nhánh HCM
Quỹ đầu tư Cân Bằng Chiến Lược VCBF (VCBF-TBF)
Từ 01/07/2015 Tới 30/09/2015

30/09/2015

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	20,730,829,176	21,164,263,037	100.20
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	1,030,616,676	1,464,050,537	47.05
	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	115.88
I.2	Các khoản đầu tư	61,128,204,300	56,162,925,800	103.89
	Cổ phiếu	61,128,204,300	56,162,925,800	103.89
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	173,976,000	30,000,000	-
1	Cổ tức, trái tức được nhận	173,976,000	30,000,000	-
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	995,123,046	624,716,969	100.60
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	-	1,469,492,451	-
	Cổ phiếu	-	1,469,492,451	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	83,028,132,522	79,451,398,257	102.81
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	-	-	-
	Cổ phiếu	-	-	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	442,847,588	341,823,838	123.93
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	22,489,292	9,539,585	215.04
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	22,489,292	9,539,582	215.04
3	Phải trả thuê	1,415,203	3,312,911	64.92
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	87,255,819	-	-
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	779.92
6	Phí quản trị quỹ	9,493,148	9,493,148	320.52
7	Phải trả phí quản lý quỹ	100,378,168	96,678,167	99.41
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	779.92
9	Phí đại lý chuyển nhượng	11,550,000	11,550,000	389.96
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	85,001,366	60,002,745	127.95
12	Thù lao ban đại diện	27,000,000	18,000,000	138.96
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	3,000,000	2,000,000	138.96
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,940,000	2,520,000	280.00
17	Lãi trả trước	-	-	-
18	Phải trả vay ngắn hạn	-	-	-
19	Các khoản phải trả, phải nộp khác	-	-	-
20	Phải trả thu nhập cho Nhà đầu tư	-	-	-
21	Phải trả chi phí lãi vay	-	-	-
22	Chi phí giao dịch bán các khoản đầu tư	-	-	-
23	Chi phí in ấn tài liệu	-	-	-
24	Phí giấy phép thành lập	-	-	-
25	Chi phí tư vấn định giá	-	-	-

II. BÁO CÁO KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG

STT	Chi tiêu	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	Lũy kế từ đầu năm
I.	Thu nhập từ hoạt động đầu tư	1,685,223,573	1,202,177,048	3,480,054,218
1	Cổ tức, trái tức được nhận	1,299,758,000	827,505,000	2,313,528,000
	Cổ tức được nhận	1,299,758,000	827,505,000	2,313,528,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	373,146,745	367,626,681	1,125,796,003
3	Các khoản thu nhập khác	12,318,828	7,045,367	40,730,215
II	Chi phí	596,754,859	562,899,531	1,750,934,475
1	Phí quản lý quỹ	308,741,501	289,512,870	887,265,997
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	145,906,269	137,461,503	425,021,912
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	63,000,000	63,000,000	188,963,255
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	11,550,000	3,150,000	22,260,000
2.3	Phí giám sát	69,300,000	69,300,000	207,859,580
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	2,056,269	2,011,503	5,939,077
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	64,172,348	63,619,133	193,773,785
3.1	Phí quản trị quỹ	29,112,323	28,795,883	86,347,230
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	35,060,025	34,823,250	107,426,555
4	Phí kiểm toán	24,998,621	30,167,126	85,001,366
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	30,000,000	20,000,000	70,000,000
5.1	Thù lao ban đại diện	30,000,000	20,000,000	70,000,000
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;	-	10,291,705	17,791,705
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	3,202,233	10,702,233
6.2	Chi phí báo cáo thường niên	-	-	-
6.3	Chi phí Ban Đại Diện	-	7,089,472	7,089,472
7	Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản quỹ	13,907,918	4,199,909	27,480,335
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	9,028,202	7,647,285	44,599,375
9.1	Phí ngân hàng	2,098,202	717,285	6,759,375
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	-	-	17,050,000
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	6,930,000	6,930,000	20,790,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	1,088,468,714	639,277,517	1,729,119,743
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	1,734,516,500	3,173,929,300	4,741,456,800
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	261,790,476	653,366,081	1,822,392,709
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	1,472,726,024	2,520,563,219	2,919,064,091
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	2,822,985,214	3,813,206,817	6,470,576,543
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	79,109,574,417	75,525,594,702	76,934,977,598
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	3,475,710,515	3,583,979,717	5,650,307,336
	Trong đó			
1	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ do các hoạt động liên quan	2,822,985,214	3,813,206,817	6,470,576,543
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 do phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ	293,292,224	1,039,818,769	5,378,226,319
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(1,295,597,573)	(1,269,045,869)	(6,198,495,526)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	82,585,284,934	79,109,574,419	82,585,284,934

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 (%)	1.51%	1.50%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.71%	0.71%
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 (%)	0.31%	0.33%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.12%	0.16%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, bảo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.15%	0.10%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.92%	2.91%
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 (%)	22.71%	7.24%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	68,995,173,700	69,196,773,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	6,899,517.37	6,919,677.37
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	264,014.69	94,149.26
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,640,146,900	941,492,600
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(213,416.86)	(114,309.26)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(2,134,168,600)	(1,143,092,600)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	69,501,152,000	68,995,173,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	6,950,115.20	6,899,517.37
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	78.87%	79.57%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	84.74%	85.47%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	37.68%	37.92%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	324	294
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	11,882.57	11,465.95

Ngân Hàng Giám Sát

(Signature)

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



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



Công ty Quản lý Quỹ

