

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: Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu tư chứng khoán Vietcombank
 2. Tên Ngân Hàng Giám Sát: Deutsche Bank AG, Chi Nhánh HCM
 3. Tên quỹ: Quỹ đầu tư Cân Bằng Chiến Lược VCBF (VCBF-TBF)
 4. Ngày lập báo cáo: Từ 01/06/2016 Tới 30/06/2016

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	48,862,579,000	28,445,516,156	230.87
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	6,114,561,418	3,706,241,530	417.65
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	23,047,805,082	5,039,062,126	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19,700,212,500	19,700,212,500	100.00
I.2	Các khoản đầu tư	84,779,970,500	77,033,302,300	150.95
	Cổ phiếu	84,779,970,500	77,033,302,300	150.95
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	156,639,500	215,802,000	522.13
1	Cổ tức, trái tức được nhận	156,639,500	215,802,000	522.13
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	2,184,340,768	2,028,023,015	349.65
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	3,785,982,495	-	-
	Cổ phiếu	3,785,982,495	-	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	139,769,512,263	107,722,643,471	175.92
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	1,012,516,500	186,279,000	-
	Cổ phiếu	1,012,516,500	186,279,000	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	1,551,011,166	2,462,648,523	453.75
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân	133,875,160	85,620,272	1,403.36
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	133,875,160	85,620,272	1,403.37
3	Phải trả thuế	937,690	725,383	28.30
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	137,233,822	124,483,812	-
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,467,215	9,782,790	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	398,305,254	254,498,081	411.99
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	44,000,000	33,000,000	380.95
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	61,706,865	50,246,025	102.84
12	Thù lao ban đại diện	27,000,000	18,098,901	150.00
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	3,000,000	2,010,987	150.00
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	8,400,000	4,830,000	333.33
17	Lãi trả trước	-	-	-
26	Phí dịch vụ khác của Nhà cung cấp dịch vụ cho Quỹ mở	-	-	-
27	Phải trả chi phí họp, Đại hội Nhà Đầu Tư Quỹ mở	-	-	-
28	Chi phí thanh lý tài sản	-	-	-
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	549,110,000	1,749,632,000	731.29
30	Doanh thu ghi nhận trước	-	-	-
31	Các khoản phải trả khác	-	-	-
32	Chi phí quản lý khác	-	-	-
33	Phải trả phí Báo Cáo Thường Niên	-	-	-
34	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
II.3	Tổng nợ	2,563,527,666	2,648,927,523	749.96
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	137,205,984,597	105,073,715,948	173.44
	Tổng số đơn vị quỹ	9,203,929.51	7,444,184.65	133.40
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	14,907.32	14,114.87	130.01



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	711,802,498	653,125,328	2,407,455,022
1	Cổ tức, trái tức được nhận	541,975,500	496,068,600	1,497,152,100
	Cổ tức được nhận	541,975,500	496,068,600	1,497,152,100
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	168,061,461	152,414,583	876,834,120
3	Các khoản thu nhập khác	1,765,537	4,642,145	33,468,802
II	Chi phí	272,581,930	273,094,280	1,423,247,827
1	Phí quản lý quỹ	143,807,173	131,539,497	749,637,974
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	53,447,089	49,783,390	295,967,525
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	126,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	8,400,000	4,830,000	26,460,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	138,600,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	947,089	853,390	4,907,525
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	20,467,215	20,782,790	129,142,888
3.1	Phí quản trị quỹ	9,467,215	9,782,790	57,434,438
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,000,000	11,000,000	71,708,450
4	Phí kiểm toán	11,460,840	11,842,868	61,706,865
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	9,890,112	43,219,779	93,000,000
5.1	Thù lao ban đại diện	9,890,112	10,219,779	60,000,000
5.2	Chi phí tư vấn pháp luật	-	33,000,000	33,000,000
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;	6,494,441	4,202,000	19,012,441
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	6,494,441	4,202,000	19,012,441
6.2	Chi phí báo cáo thường niên	-	-	-
6.3	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
7	Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản quỹ	22,202,130	8,454,960	53,864,832
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	4,812,930	3,268,996	20,915,302
9.1	Phí ngân hàng	2,502,930	958,996	7,055,302
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	-	-	-
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	13,860,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	439,220,568	380,031,048	984,207,195
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	6,044,688,200	1,964,360,600	13,340,347,700
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	3,538,973,816	746,031,061	8,076,462,884
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	2,505,714,384	1,218,329,539	5,263,884,816
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	6,483,908,768	2,344,391,648	14,324,554,895
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	105,073,715,948	100,546,670,881	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	32,132,268,649	4,527,045,067	45,802,341,569
	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	6,483,908,768	2,344,391,648	14,324,554,895
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	25,860,668,156	2,908,037,712	35,952,419,223
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(212,308,275)	(725,384,293)	(4,474,632,549)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	137,205,984,597	105,073,715,948	137,205,984,597

36 -
 CÔNG
 HEN D
 LÝ Q
 HƯNG
 ETCO
 KIẾN

III. BÁO CÁO DANH MỤC ĐẦU TƯ CỦA QUỸ

STT	Loại tài sản	Số lượng	Giá thị trường hoặc giá trị hợp lý tại ngày báo cáo	Tổng giá trị	%/Tổng giá trị tài sản của quỹ
I	Cổ phiếu niêm yết				
	VSC	53,394	65,500	3,497,307,000	2.50%
	VNM	82,008	141,000	11,563,128,000	8.27%
	VLC	97,400	17,900	1,743,460,000	1.25%
	VIT	70,000	24,100	1,687,000,000	1.21%
	VHC	53,405	45,500	2,429,927,500	1.74%
	VGC	50,600	13,500	683,100,000	0.49%
	TRA	5,952	115,000	684,480,000	0.49%
	TCM	119,000	25,200	2,998,800,000	2.15%
	SVI	77,268	39,900	3,082,993,200	2.21%
	SVC	39,500	50,000	1,975,000,000	1.41%
	RAL	40,000	86,500	3,460,000,000	2.48%
	PVT	111,000	13,800	1,531,800,000	1.10%
	PVS	210,000	18,200	3,822,000,000	2.73%
	PVD	60,750	31,000	1,883,250,000	1.35%
	PNJ	6,682	77,000	514,514,000	0.37%
	PLC	37,000	30,600	1,132,200,000	0.81%
	PET	155,000	13,000	2,015,000,000	1.44%
	NT2	55,120	34,700	1,912,664,000	1.37%
	NSC	34,000	100,000	3,400,000,000	2.43%
	NNG	56,400	14,500	817,800,000	0.59%
	MBB	392,378	14,900	5,846,432,200	4.18%
	KDC	30,000	28,000	840,000,000	0.60%
	HDG	31,370	26,300	825,031,000	0.59%
	HCM	67,420	29,900	2,015,858,000	1.44%
	GAS	17,540	62,500	1,096,250,000	0.78%
	FPT	109,702	41,800	4,585,543,600	3.28%
	FCN	107,000	20,300	2,172,100,000	1.55%
	DRC	14,300	39,400	563,420,000	0.40%
	DPR	86,390	35,000	3,023,650,000	2.16%
	DHG	38,076	103,000	3,921,828,000	2.81%
	DGC	5,000	50,100	250,500,000	0.18%
	CAV	23,000	98,500	2,265,500,000	1.62%
	BMP	13,000	146,000	1,898,000,000	1.36%
	BCC	210,000	15,500	3,255,000,000	2.33%
	ANV	119,020	6,700	797,434,000	0.57%
	ACB	31,000	19,000	589,000,000	0.42%
	Tổng			84,779,970,500	60.66%
II	Cổ phiếu chưa niêm yết				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại cổ phiếu			84,779,970,500	60.66%
III	Trái phiếu				
	Tổng			-	-
IV	Chứng khoán				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại chứng khoán			84,779,970,500	60.66%
V	Các tài sản khác				
1	Cổ tức, trái tức được nhận			156,639,500	0.11%
2	Trái tức được nhận			-	-
3	Lãi được nhận			2,184,340,768	1.56%
4	Tiền bán chứng khoán nhờ thu			3,785,982,495	2.71%
5	Các khoản phải thu khác			-	-
6	Các tài sản khác			-	-
	Tổng			6,126,962,763	4.38%
VI	Tiền và các khoản tương đương tiền				
1	Tiền			-	-
2	Tiền gửi ngân hàng			6,114,561,418	4.37%
3	Các khoản tương đương tiền			-	-
4	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng			23,047,805,082	16.49%
5	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng			19,700,212,500	14.09%
	Tổng			48,862,579,000	34.96%
VII	Tổng giá trị danh mục			139,769,512,263	100.00%



 CHẾ ĐỘ
 ĐẦU TƯ
 HOÀN
 BANK
 TP. HỒ

IV. MỘT SỐ CHỈ TIÊU KHÁC

STT	Chi 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 (%)	0.55%	0.58%
3	Tỷ lệ phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyên nhượng và các chi phí khác cho tổ chức cung cấp dịch vụ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.21%	0.24%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.12%	0.14%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.10%	0.50%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.80%	3.17%
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(%)	75.97%	32.68%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	74,441,846,500	72,859,294,600
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	7,444,184.65	7,285,929.46
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	1,774,652.33	210,556.10
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	17,746,523,300	2,105,561,000
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(14,907.47)	(52,300.91)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(149,074,700)	(523,009,100)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	92,039,295,100	74,441,846,500
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	9,203,929.51	7,444,184.65
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	74.99%	74.32%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	79.92%	79.18%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	28.53%	35.26%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch kỳ danh	523	462
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	14,907.32	14,114.87

Ngân Hàng Giám Sát

Tp. HCM, ngày 07 tháng 07 năm 2016


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

 Đặng Văn Hoà Diệu
 Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán
 Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG, Chi
 nhánh Tp. HCM


 Phó Tổng Giám Đốc
 Bùi Lý Liên

