

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 Từ

01/01/2016

Tới 31/01/2016

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	91,403,643,028	87,722,837,577
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	(2,653,240,630)	1,805,726,034
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	(2,653,240,630)	1,805,726,034
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)	2,538,618,300	1,875,079,417
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	2,703,606,211	3,292,157,600
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(164,987,911)	(1,417,078,183)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	91,289,020,698	91,403,643,028

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 05 tháng 02 năm 2016



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:	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 01/01/2016 Tới 31/01/2016

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	25,762,564,576	25,311,838,666	114.89
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	4,053,568,742	3,611,626,166	210.67
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	2,008,783,334	2,000,000,000	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19,700,212,500	19,700,212,500	96.10
I.2	Các khoản đầu tư	64,494,750,200	65,172,438,800	-
	Cổ phiếu	64,494,750,200	65,172,438,800	-
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	14,460,000	144,736,000	-
1	Cổ tức, trái tức được nhận	14,460,000	144,736,000	-
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1,490,909,025	1,366,095,791	134.06
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	-	-	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	91,762,683,801	91,995,109,257	116.49
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	473,663,103	591,466,229	137.77
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân	51,494,068	31,893,368	775.81
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	51,494,068	31,893,368	775.81
3	Phải trả thuế	5,202,019	5,037,031	3,546.80
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	124,563,012	31,332,135	1,128.24
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,782,789	9,809,586	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	113,377,339	223,617,541	114.30
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	11,550,000	11,550,000	100.00
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	119,316,939	110,000,000	90.89
12	Thù lao ban đại diện	9,197,803	27,000,000	150.41
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	1,021,977	3,000,000	150.41
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	2,100,000	82.35
28	Chi phí thanh lý tài sản	-	-	-
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	(70,376,911)	60,133,200	(539.80)
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	473,663,103	591,466,229	137.77
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	91,289,020,698	91,403,643,028	116.40
	Tổng số đơn vị quỹ	7,201,138.01	6,998,786.28	101.72
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	12,677.02	13,059.92	114.43

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	149,767,138	390,115,828	149,767,138
1	Cổ tức, trái tức được nhận	14,460,000	255,736,000	14,460,000
	Cổ tức được nhận	14,460,000	255,736,000	14,460,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	135,033,252	127,274,755	135,033,252
3	Các khoản thu nhập khác	273,886	7,105,073	273,886
II	Chi phí	211,077,168	206,765,194	211,077,168
1	Phí quản lý quỹ	113,377,339	113,777,378	113,377,339
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	47,777,407	46,885,536	47,777,407
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	21,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,940,000	2,100,000	2,940,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	23,100,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	737,407	685,536	737,407
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	21,558,014	21,469,311	21,558,014
3.1	Phí quản trị quỹ	9,782,789	9,809,586	9,782,789
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,775,225	11,659,725	11,775,225
4	Phí kiểm toán	9,316,939	8,423,461	9,316,939
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	10,219,780	10,108,693	10,219,780
5.1	Thù lao ban đại diện	10,219,780	10,108,693	10,219,780
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:	-	-	-
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	-	-
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	5,884,089	2,774,415	5,884,089
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	2,943,600	3,326,400	2,943,600
9.1	Phí ngân hàng	633,600	1,016,400	633,600
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	2,310,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	(61,310,030)	183,350,634	(61,310,030)
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	(2,591,930,600)	1,622,375,400	(2,591,930,600)
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	643,334,156	657,358,592	643,334,156
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	(3,235,264,756)	965,016,808	(3,235,264,756)
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	(2,653,240,630)	1,805,726,034	(2,653,240,630)
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	91,403,643,028	87,722,837,577	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	(114,622,330)	3,680,805,451	(114,622,330)
	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	(2,653,240,630)	1,805,726,034	(2,653,240,630)
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	2,703,606,211	3,292,157,600	2,703,606,211
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(164,987,911)	(1,417,078,183)	(164,987,911)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	91,289,020,698	91,403,643,028	91,289,020,698

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(%)	1.53%	1.53%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.64%	0.63%
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 (%)	0.29%	0.29%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.13%	0.11%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.14%	0.14%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.84%	2.78%
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(%)	26.39%	12.43%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	69,987,862,800	68,546,930,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	6,998,786.28	6,854,693.07
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	Số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	215,534.51	254,676.72
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,155,345,100	2,546,767,200
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(13,182.78)	(110,583.51)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(131,827,800)	(1,105,835,100)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	72,011,380,100	69,987,862,800
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	7,201,138.01	6,998,786.28
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	77.20%	79.44%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	82.28%	84.36%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	36.41%	37.45%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	353	337
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	12,677.02	13,059.92

Ngân Hàng Giám Sát

Tp.HCM, ngày 05 tháng 02 năm 2016

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

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

AN
NG
NỘI

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 01 Năm 2016
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

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 05 tháng 02 năm 2016

Đặng Vũ Hoài Diệu
Tổng Giám Đốc