

Phụ Lục 26 - Mẫu Báo Cáo Thay Đổi Giá Trị Tài Sản Ròng Giao Dịch Chứng Chỉ Quỹ
(Ban hành kèm theo Thông tư 183 hướng dẫn về việc thành lập và quản lý Quỹ mở)

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
01/09/2016 Tới 30/09/2016

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	150,066,602,665	140,895,852,091
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	1,258,747,793	6,053,184,320
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	1,258,747,793	6,053,184,320
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)	3,356,058,285	3,117,566,254
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	4,934,032,224	4,480,304,184
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(1,577,973,939)	(1,362,737,930)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	154,681,408,743	150,066,602,665

Ngân Hàng Giám Sát

Tp. Hồ Chí Minh, ngày 07 tháng 10 năm 2016



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



Bùi Sỹ Tân
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

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	01/09/2016	Tới 30/09/2016

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	54,370,138,206	55,305,486,337	262.27
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	3,142,553,886	5,578,138,780	304.92
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	39,159,127,434	33,658,678,171	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	12,068,456,886	16,068,669,386	61.26
I.2	Các khoản đầu tư	101,764,301,050	95,284,800,200	166.48
	Cổ phiếu	101,764,301,050	95,284,800,200	166.48
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	130,270,000	541,191,000	74.88
1	Cổ tức, trái tức được nhận	130,270,000	541,191,000	74.88
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	857,437,783	1,196,060,691	86.16
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	157,122,147,039	152,327,538,228	189.24
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	-	560,239,100	-
	Cổ phiếu	-	560,239,100	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	2,440,738,296	1,700,696,463	551.15
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	243,558,344	202,722,456	1,083.00
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	244,902,344	204,034,456	1,088.97
3	Phải trả thuế	1,577,976	4,604,008	111.50
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	1,251,057,242	192,712,462	1,433.78
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,467,215	9,782,789	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	186,126,734	760,248,097	185.43
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	33,000,000	66,000,000	285.71
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	30,853,441	85,392,601	36.30
12	Thù lao ban đại diện	27,000,000	45,195,653	100.00
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	3,000,000	5,021,741	100.00
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	6,090,000	5,880,000	207.14
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	-	-	-
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	360,005,000	75,002,200	1,398.88
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	2,440,738,296	2,260,935,563	551.15
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	154,681,408,743	150,066,602,665	187.30
	Tổng số đơn vị quỹ	9,727,507.44	9,512,694.16	139.96
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	15,901.44	15,775.40	133.82

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	487,669,896	1,272,302,036	4,757,204,571
1	Cổ tức, trái tức được nhận	235,270,000	1,006,276,596	3,058,698,696
	Cổ tức được nhận	235,270,000	1,006,276,596	3,058,698,696
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	237,544,821	256,553,905	1,625,606,954
3	Các khoản thu nhập khác	14,855,075	9,471,535	72,898,921
II	Chi phí	347,516,373	291,628,416	2,356,917,897
1	Phí quản lý quỹ	186,126,734	184,311,421	1,297,707,551
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	51,417,240	51,180,847	451,225,599
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	189,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	6,090,000	5,880,000	45,990,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	207,900,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	1,227,240	1,200,847	8,335,599
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	17,628,506	20,782,790	188,336,973
3.1	Phí quản trị quỹ	9,467,216	9,782,790	86,467,233
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	8,161,290	11,000,000	101,869,740
4	Phí kiểm toán	11,460,840	11,842,868	96,853,441
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	65,370,134	10,108,697	178,587,528
5.1	Thù lao ban đại diện	9,782,606	10,108,697	90,000,000
5.2	Chi phí tư vấn pháp luật	55587528	-	88587528
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;	1,158,768	-	20,171,209
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	1,158,768	-	20,171,209
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	8,039,777	9,222,488	88,075,313
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	6,314,374	4,179,305	35,960,283
9.1	Phí ngân hàng	4,004,374	1,869,305	15,170,283
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	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)	140,153,523	980,673,620	2,400,286,674
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	1,118,594,270	5,072,510,700	21,373,637,670
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	-	191,429,369	11,760,467,958
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	1,118,594,270	4,881,081,331	9,613,169,712
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	1,258,747,793	6,053,184,320	23,773,924,344
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	150,066,602,665	140,895,852,091	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	4,614,806,078	9,170,750,574	63,277,765,715
	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	1,258,747,793	6,053,184,320	23,773,924,344
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	4,934,032,224	4,480,304,184	49,222,768,855
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(1,577,973,939)	(1,362,737,930)	(9,718,927,484)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	154,681,408,743	150,066,602,665	154,681,408,743

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	65,894	68,000	4,480,792,000	2.85%
	VNR	103,900	22,100	2,296,190,000	1.46%
	VNM	98,409	140,000	13,777,260,000	8.77%
	VLC	107,400	15,800	1,696,920,000	1.08%
	VIT	70,000	30,800	2,156,000,000	1.37%
	VHC	20,475	58,800	1,203,930,000	0.77%
	VGC	50,600	17,200	870,320,000	0.55%
	TRA	5,952	123,500	735,072,000	0.47%
	TCM	235,000	18,650	4,382,750,000	2.79%
	TCL	58,000	29,900	1,734,200,000	1.10%
	SVI	77,268	46,300	3,577,508,400	2.28%
	SVC	16,500	49,700	820,050,000	0.52%
	SGN	8,500	100,000	850,000,000	0.54%
	RAL	12,000	106,800	1,281,600,000	0.82%
	PVT	122,100	14,450	1,764,345,000	1.12%
	PVS	210,000	21,200	4,452,000,000	2.83%
	PVD	60,750	26,600	1,615,950,000	1.03%
	PNJ	2	75,000	150,000	-
	PLC	37,000	28,000	1,036,000,000	0.66%
	PET	155,000	11,550	1,790,250,000	1.14%
	NT2	55,120	37,900	2,089,048,000	1.33%
	NSC	34,000	100,000	3,400,000,000	2.16%
	NNG	82,300	19,000	1,563,700,000	1.00%
	NCT	11,000	95,300	1,048,300,000	0.67%
	MBB	422,378	14,900	6,293,432,200	4.01%
	KDC	75,000	37,750	2,831,250,000	1.80%
	HDG	34,507	23,750	819,541,250	0.52%
	HCM	82,920	29,400	2,437,848,000	1.55%
	GAS	17,540	70,500	1,236,570,000	0.79%
	FPT	124,702	46,650	5,817,348,300	3.70%
	FCN	107,000	20,800	2,225,600,000	1.42%
	DRC	14,300	42,000	600,600,000	0.38%
	DPR	96,700	33,500	3,239,450,000	2.06%
	DHG	38,076	112,000	4,264,512,000	2.71%
	DGC	5,923	57,300	339,387,900	0.22%
	CAV	13,000	98,500	1,280,500,000	0.81%
	BVS	45,900	18,100	830,790,000	0.53%
	BMP	13,000	193,800	2,519,400,000	1.60%
	BCC	210,000	18,700	3,927,000,000	2.50%
	ANV	139,130	7,200	1,001,736,000	0.64%
	ACB	190,000	18,300	3,477,000,000	2.21%
	Tổng			101,764,301,050	64.77%
II	Cổ phiếu chưa niêm yết				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại cổ phiếu			101,764,301,050	64.77%
III	Trái phiếu				
	Tổng			-	-
IV	Chứng khoán				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại chứng khoán			101,764,301,050	64.77%
V	Các tài sản khác				
	Tổng			130,270,000	0.08%
1	Cổ tức, trái tức được nhận			-	-
2	Trái tức được nhận			857,437,783	0.55%
3	Lãi được nhận			-	-
4	Tiền bán chứng khoán nhờ thu			-	-
5	Các khoản phải thu khác			-	-
6	Các tài sản khác			-	-
	Tổng			987,707,783	0.63%
VI	Tiền và các khoản tương đương tiền				
	Tổng			-	-
1	Tiền			3,142,553,886	2.00%
2	Tiền gửi ngân hàng			-	-
3	Các khoản đương tương tiền			39,159,127,434	24.92%
4	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng			12,068,456,886	7.68%
5	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng			54,370,138,206	34.60%
	Tổng			157,122,147,039	100.00%
VII	Tổng giá trị danh mục				

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 (%)	0.41%	0.42%
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 (%)	0.14%	0.17%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.09%	0.10%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.52%	0.08%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.76%	2.41%
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(%)	21.26%	25.44%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ	95,126,941,600	93,068,201,200
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	9,512,694.16	9,306,820.12
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ		
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ	314,582.62	294,710.49
	Số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	3,145,826,200	2,947,104,900
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	(99,769.34)	(88,836.45)
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(997,693,400)	(888,364,500)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư		
3	Quy mô quỹ cuối kỳ	97,275,074,400	95,126,941,600
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	9,727,507.44	9,512,694.16
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	69.59%	71.15%
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	75.33%	77.62%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	27.01%	27.62%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	622	590
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	15,901.44	15,775.40
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng		

Ngân Hàng Giám Sát

Tp.HCM, ngày 07 tháng 10 năm 2016


Trần Đại 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


Bùi Sỹ Tân
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 09 Năm 2016

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 (nếu 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
I	1.1 Vay tiền								
	Không có								
I	Tỷ lệ tiền vay từ các hợp đồng/giá trị tài sản ròng								
II	1.2 Hợp đồng repo								
	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 Đại Trang

Trần Đại 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 10 năm 2016

