

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
 01/07/2016

Tới 31/07/2016

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	137,205,984,597	105,073,715,948
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	2,137,437,336	6,483,908,768
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	2,137,437,336	6,483,908,768
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)	1,552,430,158	25,648,359,881
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	3,856,013,224	25,860,668,156
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(2,303,583,066)	(212,308,275)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	140,895,852,091	137,205,984,597

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

Đặng Vũ Hoài Diệu
 Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán

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



PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Bùi Sỹ Tân
 Công ty Quản lý Quỹ

Tp. Hồ Chí Minh, ngày 05 tháng 08 năm 2016

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 07 Năm 2016

Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

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

Địa chỉ:

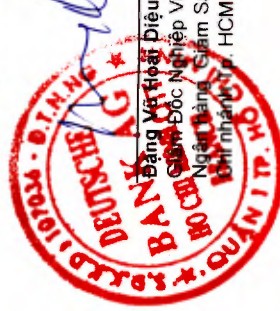
Ngân hàng giám sát:
Địa chỉ: Ngân Hàng Deutsche Bank AG, Chi nhánh Hồ Chí Minh
65 Lê Lợi, Quận 1, TP.HCM, Việt Nam

STT	Nội dung hoạt động (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								
	Tỷ lệ tiền vay từ các hợp đồng/giá trị tài sản ròng								
I	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)								
II	2.1 Cho vay chứng khoán								
	Không có								
I	Tổng giá trị các hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ								
	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



Hồ Chí Minh, ngày 05 tháng 08 năm 2016

PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC
Bùi Sỹ Sơn

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 01/07/2016 Tới 31/07/2016

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	57,075,600,314	48,862,579,000	257.67
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	8,223,698,084	6,114,561,418	334.98
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	25,583,232,844	20,026,348,196	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	23,268,669,386	22,721,669,386	115.34
I.2	Các khoản đầu tư	84,832,444,500	84,779,970,500	140.2468987
	Cổ phiếu	84,832,444,500	84,779,970,500	140.2468987
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	320,000,000	156,639,500	89.66
1	Cổ tức, trái tức được nhận	320,000,000	156,639,500	89.66
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1,831,715,349	2,184,340,768	244.38
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	315,900,000	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	144,375,660,163	139,769,512,263	172.39
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	166,499,375	1,012,516,500	-
	Cổ phiếu	166,499,375	1,012,516,500	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	3,313,308,697	1,551,011,166	885.25
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	165,536,548	133,875,160	1,004.29
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	165,536,548	133,875,160	1,004.29
3	Phải trả thuế	3,241,272	937,690	73.88
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	959,385,434	137,233,822	1,261.90
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,782,789	9,467,215	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	575,936,676	398,305,254	557.25
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	55,000,000	44,000,000	476.19
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	73,549,733	61,706,865	107.49
12	Thủ lao ban đại diện	36,097,826	27,000,000	396.77
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	4,010,871	3,000,000	396.77
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	7,560,000	8,400,000	138.46
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	1,213,571,000	549,110,000	14,997.73
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	3,479,808,072	2,563,527,666	929.74
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	140,895,852,091	137,205,984,597	168.99
	Tổng số đơn vị quỹ	9,306,820.12	9,203,929.51	132.67
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	15,138.98	14,907.32	127.38

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	589,777,617	711,802,498	2,997,232,639
1	Cổ tức, trái tức được nhận	320,000,000	541,975,500	1,817,152,100
	Cổ tức được nhận	320,000,000	541,975,500	1,817,152,100
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	254,674,108	168,061,461	1,131,508,228
3	Các khoản thu nhập khác	15,103,509	1,765,537	48,572,311
II	Chi phí	294,525,281	272,581,930	1,717,773,108
1	Phí quản lý quỹ	177,631,422	143,807,173	927,269,396
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	52,659,987	53,447,089	348,627,512
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	147,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	7,560,000	8,400,000	34,020,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	161,700,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	999,987	947,089	5,907,512
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	20,782,789	20,467,215	149,925,677
3.1	Phí quản trị quỹ	9,782,789	9,467,215	67,217,227
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,000,000	11,000,000	82,708,450
4	Phí kiểm toán	11,842,868	11,460,840	73,549,733
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, bảo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	10,108,697	9,890,112	103,108,697
5.1	Thù lao ban đại diện	10,108,697	9,890,112	70,108,697
5.2	Chi phí tư vấn pháp luật	-	-	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	19,012,441
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	6,494,441	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	16,948,216	22,202,130	70,813,048
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	4,551,302	4,812,930	25,466,604
9.1	Phí ngân hàng	2,241,302	2,502,930	9,296,604
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	16,170,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	295,252,336	439,220,568	1,279,459,531
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	1,842,185,000	6,044,688,200	15,182,532,700
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	3,492,575,705	3,538,973,816	11,569,038,584
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	(1,650,390,705)	2,505,714,384	3,613,494,111
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	2,137,437,336	6,483,908,768	16,461,992,231
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	137,205,984,597	105,073,715,948	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	3,689,867,494	32,132,268,649	49,492,209,063
	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	2,137,437,336	6,483,908,768	16,461,992,231
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	-	-	-
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ	3,856,013,224	25,860,668,156	39,808,432,447
5	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(2,303,583,066)	(212,308,275)	(6,778,215,615)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	140,895,852,091	137,205,984,597	140,895,852,091

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	68,000	3,630,792,000	2.51%
	VNR	88,900	19,900	1,769,110,000	1.23%
	VNM	82,008	158,000	12,957,264,000	8.97%
	VLC	97,400	15,900	1,548,660,000	1.07%
	VIT	70,000	26,000	1,820,000,000	1.26%
	VHC	20,475	52,500	1,074,937,500	0.74%
	VGC	50,600	14,700	743,820,000	0.52%
	TRA	5,952	114,000	678,528,000	0.47%
	TCM	132,000	20,700	2,732,400,000	1.89%
	SVI	77,268	41,000	3,167,988,000	2.19%
	SVC	16,500	41,600	686,400,000	0.48%
	RAL	15,880	100,000	1,588,000,000	1.10%
	PVT	111,000	15,300	1,698,300,000	1.18%
	PVS	210,000	16,900	3,549,000,000	2.46%
	PVD	60,750	25,600	1,555,200,000	1.08%
	PNJ	2	64,000	128,000	
	PLC	37,000	29,400	1,087,800,000	0.75%
	PET	155,000	13,000	2,015,000,000	1.40%
	NT2	55,120	35,100	1,934,712,000	1.34%
	NSC	34,000	108,000	3,672,000,000	2.54%
	NNG	62,300	15,000	934,500,000	0.65%
	MBB	402,378	15,000	6,035,670,000	4.18%
	KDC	75,000	28,900	2,167,500,000	1.50%
	HDG	31,370	28,900	906,593,000	0.63%
	HCM	67,420	31,200	2,103,504,000	1.46%
	GAS	17,540	58,500	1,026,090,000	0.71%
	FPT	124,702	41,000	5,112,782,000	3.54%
	FCN	107,000	21,900	2,343,300,000	1.62%
	DRC	14,300	39,500	564,850,000	0.39%
	DPR	91,910	35,000	3,216,850,000	2.23%
	DHG	38,076	92,500	3,522,030,000	2.44%
	DGC	5,923	42,000	248,766,000	0.17%
	CAV	13,000	106,000	1,378,000,000	0.95%
	BVS	27,500	13,700	376,750,000	0.26%
	BMP	13,000	163,000	2,119,000,000	1.47%
	BCC	210,000	17,100	3,591,000,000	2.49%
	ANV	119,020	6,000	714,120,000	0.49%
	ACB	31,000	18,100	561,100,000	0.39%
	Tổng			84,832,444,500	58.76%
II	Cổ phiếu chưa niêm yết				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại cổ phiếu			84,832,444,500	58.76%
III	Trái phiếu				
	Tổng			-	-
IV	Chứng khoán				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại chứng khoán			84,832,444,500	58.76%
V	Các tài sản khác				
1	Cổ tức, trái tức được nhận			320,000,000	0.22%
2	Trái tức được nhận			-	-
3	Lãi được nhận			1,831,715,349	1.27%
4	Tiền bán chứng khoán nhờ thu			-	-
5	Các khoản phải thu khác			315,900,000	0.22%
6	Các tài sản khác			-	-
	Tổng			2,467,615,349	1.71%
VI	Tiền và các khoản tương đương tiền				
1	Tiền			-	-
2	Tiền gửi ngân hàng			8,223,698,084	5.70%
3	Các khoản tương đương tiền			-	-
4	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng			26,130,232,844	18.10%
5	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng			22,721,669,386	15.74%
	Tổng			57,075,600,314	39.53%
VII	Tổng giá trị danh mục			144,375,660,163	100.00%

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(%)	1.53%	1.48%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.45%	0.55%
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 (%)	0.18%	0.21%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.10%	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 (%)	0.09%	0.10%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.53%	2.80%
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(%)	48.51%	75.96%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	92,039,295,100	74,441,846,500
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	9,203,929.51	7,444,184.65
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	255,086.74	1,774,652.33
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,550,867,400	17,746,523,300
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(152,196.13)	(14,907.47)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(1,521,961,300)	(149,074,700)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	93,068,201,200	92,039,295,100
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	9,306,820.12	9,203,929.51
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	73.44%	74.99%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	79.32%	79.92%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	28.22%	28.53%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	564	523
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	15,138.98	14,907.32

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.HCM, ngày 05 tháng 08 năm 2016



Công ty Quản lý Quỹ

PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Bùi Sỹ Tân

