

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: 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 cáo: Từ 01/02/2016 Đến 29/02/2016

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	91,289,020,698	91,403,643,028
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	4,111,213,716	(2,653,240,630)
	II.1 Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	4,111,213,716	(2,653,240,630)
	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)	1,205,418,637	2,538,618,300
	III.1 Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	1,211,684,832	2,703,606,211
	III.2 Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(6,266,195)	(164,987,911)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	96,605,653,051	91,289,020,698

Ngân Hàng Giám Sát



TP. Hồ Chí Minh, ngày 07 tháng 03 năm 2016

Hồ Thị Như Liên

Trưởng Ban Thanh Toán & Bu Trừ

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

Avinash Deepak Satwalekar

Công ty Quản lý Quỹ

TỔNG GIÁM ĐỐC

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 02 Năm 2016

Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

Công ty quản lý quỹ:
Địa chỉ:

Công ty liên doanh quản lý quỹ 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 (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 Ngày tháng năm	Ty lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ	Thời điểm báo cáo Ngày tháng năm	Ty lệ giá trị hợp đồng/giá trị tài sản ròng của quỹ
1.1	Vay liên								
	Không có								
I	Ty 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

Hồ Thị Như Liên
Trưởng Ban Thanh Toán Bù Trừ
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG
Chi nhánh Tp. HCM



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



Avinash Deepak Satwalekar
TỔNG GIÁM ĐỐC

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 01/02/2016 Đến 29/02/2016

29/02/2016

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	25.337.129.809	25.762.564.576	117,37
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	2.619.596.647	4.053.568.742	138,82
	Các khoản đương tương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	3.017.320.662	2.008.783.334	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19.700.212.500	19.700.212.500	100,00
I.2	Các khoản đầu tư	69.790.755.000	64.494.750.200	121,99
	Cổ phiếu	69.790.755.000	64.494.750.200	121,99
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	43.960.000	14.460.000	-
1	Cổ tức, trái tức được nhận	43.960.000	14.460.000	-
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1.611.009.815	1.490.909.025	316,69
I.5	Tiền bán chứng khoán nợ thu	860.756.925	-	-
	Cổ phiếu	860.756.925	-	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	97.643.611.549	91.762.683.801	122,81
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	304.456.000	-	113,01
	Cổ phiếu	304.456.000	-	113,01
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	733.502.498	473.663.103	165,75
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	31.482.284	51.494.068	360,69
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	31.482.284	51.494.068	360,70
3	Phải trả thuế	5.208.285	5.202.019	1.314,84
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	124.523.412	124.563.012	-
5	Phải trả phí lưu ký	21.000.000	21.000.000	100,00
6	Phí quản trị quỹ	9.151.638	9.782.789	103,29
7	Phải trả phí quản lý quỹ	225.220.889	113.377.339	118,76
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23.100.000	23.100.000	100,00
9	Phí đại lý chuyên nhượng	11.550.000	11.550.000	100,00
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	128.032.786	119.316.939	91,09
12	Thu lao ban đại diện	17.802.200	9.197.803	152,96
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	1.978.020	1.021.977	152,96
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	2.940.000	100,00
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	-	-	-
26	Phí dịch vụ khác của Nhà cung cấp dịch vụ cho Quỹ mở	-	-	-
27	Phải trả chi phí hợp. 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	100.030.700	(70.376.911)	710,06
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	1.037.958.498	473.663.103	145,80
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	96.605.653.051	91.289.020.698	122,61
	Tổng số đơn vị quỹ	7.294.125.04	7.201.138.01	103,05
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	13.244.30	12.677.02	118,98



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	246,402,754	149,767,138	396,169,892
1	Cổ tức, trái tức được nhận	116,668,000	14,460,000	131,128,000
	Cổ tức được nhận	116,668,000	14,460,000	131,128,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	129,734,754	135,033,252	264,768,006
3	Các khoản thu nhập khác	-	273,886	273,886
II	Chi phí	210,293,838	211,077,168	421,371,006
1	Phi quản lý quỹ	111,843,550	113,377,339	225,220,889
2	Phi lưu ký, phí ngân hàng giám sát	47,803,112	47,777,407	95,580,519
2.1	Phi dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	42,000,000
2.2	Phi giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,940,000	2,940,000	5,880,000
2.3	Phi giám sát	23,100,000	23,100,000	46,200,000
2.4	Phi lưu ký chứng khoán trả cho VSD	763,112	737,407	1,500,519
3	Phi quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	24,871,189	21,558,014	46,429,203
3.1	Phi quản trị quỹ	9,151,639	9,782,789	18,934,428
3.2	Phi đại lý chuyển nhượng	15,719,550	11,775,225	27,494,775
4	Phi kiểm toán	8,715,847	9,316,939	18,032,786
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, bảo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	9,560,440	10,219,780	19,780,220
5.1	Thù lao ban đại diện	9,560,440	10,219,780	19,780,220
5.3	Phi cung cấp giá chứng khoán	-	-	-
6	Chi phí dự thảo, in ấn, báo 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 quý	4,417,500	5,884,089	10,301,589
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	3,082,200	2,943,600	6,025,800
9.1	Phi ngân hàng	772,200	633,600	1,405,800
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	-	-	-
9.3	Phi giấy phép thành lập	-	-	-
9.4	Dịch vụ bưu chính	-	-	-
9.5	Phi quảng cáo	-	-	-
9.6	Dịch vụ quỹ mở - DBDI	2,310,000	2,310,000	4,620,000
9.7	Phi khác	-	-	-
9.8	Phi quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	36,108,916	(61,310,030)	(25,201,114)
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	4,075,104,800	(2,591,930,600)	1,483,174,200
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	436,205,173	643,334,156	1,079,539,329
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	3,638,899,627	(3,235,264,756)	403,634,871
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	4,111,213,716	(2,653,240,630)	1,457,973,086
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	91,289,020,698	91,403,643,028	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	5,316,632,353	(114,622,330)	5,202,010,023
	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	4,111,213,716	(2,653,240,630)	1,457,973,086
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	1,211,684,832	2,703,606,211	3,915,291,043
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(6,266,195)	(164,987,911)	(171,254,106)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	96,605,653,051	91,289,020,698	96,605,653,051

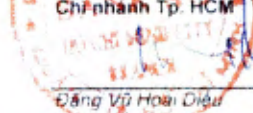
6 - L.
 CÔNG T
 EN DOAN
 LÝ QUỸ Đ
 ỨNG KHO
 TCOMBA
 KIỂM - T

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(%)	1.43%	1.53%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.61%	0.64%
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 (%)	0.32%	0.29%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.11%	0.13%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, bao gồm, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.12%	0.14%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.68%	2.84%
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(%)	18.79%	26.39%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	72.011.380.100	69.987.862.800
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	7.201.138.01	6.998.786.28
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	93.487.03	215.534.51
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	934.870.300	2.155.345.100
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(500.00)	(13.182.78)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(5.000.000)	(131.827.800)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	72.941.250.400	72.011.380.100
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	7.294.125.04	7.201.138.01
4	Tỷ lệ năm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	74.78%	76.15%
5	Tỷ lệ năm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	81.17%	82.28%
6	Tỷ lệ năm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	35.96%	36.41%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	372	355
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	13.244.30	12.677.02

Ngân Hàng Giám Sát


 Hồ Thị Như Liên
 Trưởng Ban Thanh Toán & Bộ Trú
 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 07 tháng 03 năm 2016

Công ty Quản lý Quỹ

Avinash Deepak Satwalekar
TỔNG GIÁM ĐỐC

