

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 01/10/2015 Tới 31/12/2015

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	82,585,284,934	79,109,574,419
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	8,149,075,531	2,822,985,214
	II.1 Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	8,149,075,531	2,822,985,214
	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)	669,282,563	652,725,301
	III.1 Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	4,291,109,264	3,142,195,416
	III.2 Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(3,621,826,701)	(2,489,470,115)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I +II + III)	91,403,643,028	82,585,284,934

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 15 tháng 01 năm 2016



Nguyễn Trung Nam

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

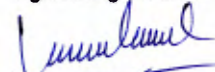
BÁO CÁO HOẠT ĐỘNG VAY, GIAO DỊCH MUA BÁN LẠI CỦA QUỸ
Tháng 12 Năm 2015
Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

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 (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
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 15 tháng 01 năm 2016


Nguyễn Trung Nam
Phó 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:	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 01/10/2015 Tới 31/12/2015

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	25,311,838,666	20,730,829,176	118.38
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	3,611,626,166	1,030,616,676	409.89
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	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	65,172,438,800	61,128,204,300	-
	Cổ phiếu	65,172,438,800	61,128,204,300	-
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	144,736,000	173,976,000	191.64
1	Cổ tức, trái tức được nhận	144,736,000	173,976,000	191.64
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1,366,095,791	995,123,046	97.03
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	91,995,109,257	83,028,132,522	118.48
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	591,466,229	442,847,588	150.90
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại	31,893,368	22,489,292	87.64
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty	31,893,368	22,489,292	87.64
3	Phải trả thuế	5,037,031	1,415,203	194.95
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	31,332,135	87,255,819	194.82
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	807.27
6	Phí quản trị quỹ	9,809,586	9,493,148	342.81
7	Phải trả phí quản lý quỹ	223,617,541	100,378,168	229.23
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	807.27
9	Phí đại lý chuyển nhượng	11,550,000	11,550,000	403.63
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	110,000,000	85,001,366	90.91
12	Thù lao ban đại diện	27,000,000	27,000,000	137.91
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	3,000,000	3,000,000	137.91
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,100,000	2,940,000	71.43
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	60,133,200	25,735,300	130.49
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	591,466,229	442,847,588	83.32
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	91,403,643,028	82,585,284,934	118.81
	Tổng số đơn vị quỹ	6,998,786.28	6,950,115.20	99.55
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	13,059.92	11,882.57	119.34

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	678,216,457	1,685,223,573	4,158,270,675
1	Cổ tức, trái tức được nhận	284,736,000	1,299,758,000	2,598,264,000
	Cổ tức được nhận	284,736,000	1,299,758,000	2,598,264,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	376,040,306	373,146,745	1,501,836,309
3	Các khoản thu nhập khác	17,440,151	12,318,828	58,170,366
II	Chi phí	640,098,426	596,754,859	2,391,032,901
1	Phí quản lý quỹ	334,072,764	308,741,501	1,221,338,761
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	144,323,375	145,906,269	569,345,287
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	63,000,000	63,000,000	251,963,255
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	9,870,000	11,550,000	32,130,000
2.3	Phí giám sát	69,300,000	69,300,000	277,159,580
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	2,153,375	2,056,269	8,092,452
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	64,051,072	64,172,348	257,824,857
3.1	Phí quản trị quỹ	29,112,322	29,112,323	115,459,552
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	34,938,750	35,060,025	142,365,305
4	Phí kiểm toán	24,998,634	24,998,621	110,000,000
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	30,000,000	30,000,000	100,000,000
5.1	Thù lao ban đại diện	30,000,000	30,000,000	100,000,000
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;	-	-	17,791,705
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	-	10,702,233
6.2	Chi phí báo cáo thường niên	-	-	-
6.3	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	7,089,472
7	Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản	14,927,631	13,907,918	42,407,966
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	27,724,950	9,028,202	72,324,325
9.1	Phí ngân hàng	2,085,600	2,098,202	8,844,975
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	18,709,350	-	35,759,350
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	6,930,000	6,930,000	27,720,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	38,118,031	1,088,468,714	1,767,237,774
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	8,110,957,500	1,734,516,500	12,852,414,300
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	3,053,063,063	261,790,476	4,875,455,772
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	5,057,894,437	1,472,726,024	7,976,958,528
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	8,149,075,531	2,822,985,214	14,619,652,074
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	82,585,284,934	79,109,574,419	76,934,977,598
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	8,818,358,094	3,475,710,515	14,468,665,430
	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	8,149,075,531	2,822,985,214	14,619,652,074
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	4,291,109,264	3,142,195,416	9,669,335,583
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(3,621,826,701)	(2,489,470,115)	(9,820,322,227)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	91,403,643,028	82,585,284,934	91,403,643,028

CÔNG
LIÊN Đ
Y QU
HÙNG
IETCON
N. TIEM

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(%)	1.51%	1.51%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.65%	0.71%
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%	0.31%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.11%	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 (%)	0.14%	0.15%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.90%	2.92%
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(%)	22.53%	22.71%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	69,501,152,000	68,995,173,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	6,950,115.20	6,899,517.37
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	333,247.65	264,014.69
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	3,332,476,500	2,640,146,900
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(284,576.57)	(213,416.86)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(2,845,765,700)	(2,134,168,600)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	69,987,862,800	69,501,152,000
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	6,998,786.28	6,950,115.20
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối	79.42%	78.87%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	84.36%	84.74%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	37.45%	37.68%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	333	324
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	13,059.92	11,882.57

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

Tp. HCM, ngày 15 tháng 01 năm 2016



Công ty Quản lý Quỹ

