

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	01/08/2016
	Tới 31/08/2016

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	140,895,852,091	137,205,984,597
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	6,053,184,320	2,137,437,336
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	6,053,184,320	2,137,437,336
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)	3,117,566,254	1,552,430,158
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	4,480,304,184	3,856,013,224
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(1,362,737,930)	(2,303,583,066)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	150,066,602,665	140,895,852,091

Ngân Hàng Giám Sát

(Signature)

Trần Đài Trang

Trưởng Ban Dịch Vụ Quản Trị Quỹ

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

(Signature)

Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán

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



Tp. Hồ Chí Minh, ngày 08 tháng 09 năm 2016

(Signature)

Phó 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 01/08/2016 Đến 31/08/2016

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	55,305,486,337	57,075,600,314	252.26
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	5,578,138,780	8,223,698,084	250.84
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	33,658,678,171	25,583,232,844	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	16,068,669,386	23,268,669,386	81.57
I.2	Các khoản đầu tư	95,284,800,200	84,832,444,500	161.27
	Cổ phiếu	95,284,800,200	84,832,444,500	161.27
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	541,191,000	320,000,000	117.06
1	Cổ tức, trái tức được nhận	541,191,000	320,000,000	117.06
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	1,196,060,691	1,831,715,349	136.80
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	-	-	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	315,900,000	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	152,327,538,228	144,375,660,163	184.98
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	166,499,375	345.31
	Cổ phiếu	560,239,100	166,499,375	345.31
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	1,700,696,463	3,313,308,697	474.57
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	202,722,456	165,536,548	1,017.82
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	204,034,456	165,536,548	1,024.40
3	Phải trả thuế	4,604,008	3,241,272	3,849.31
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	192,712,462	959,385,434	3,478.59
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,782,789	9,782,789	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	760,248,097	575,936,676	723.97
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	66,000,000	55,000,000	571.43
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	85,392,601	73,549,733	111.12
12	Thù lao ban đại diện	45,195,653	36,097,826	248.39
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	5,021,741	4,010,871	248.39
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	5,880,000	7,560,000	186.67
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	75,002,200	1,213,571,000	177.78
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	2,260,935,563	3,479,808,072	434.28
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	150,066,602,665	140,895,852,091	183.40
	Tổng số đơn vị quỹ	9,512,694.16	9,306,820.12	135.19
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	15,775.40	15,138.98	135.65

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	1,272,302,036	589,777,617	4,269,534,675
1	Cổ tức, trái tức được nhận	1,006,276,596	320,000,000	2,823,428,696
	Cổ tức được nhận	1,006,276,596	320,000,000	2,823,428,696
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	256,553,905	254,674,108	1,388,062,133
3	Các khoản thu nhập khác	9,471,535	15,103,509	58,043,846
II	Chi phí	291,628,416	294,525,281	2,009,401,524
1	Phí quản lý quỹ	184,311,421	177,631,422	1,111,580,817
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	51,180,847	52,659,987	399,808,359
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	168,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	5,880,000	7,560,000	39,900,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	184,800,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	1,200,847	999,987	7,108,359
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	20,782,790	20,782,789	170,708,467
3.1	Phí quản trị quỹ	9,782,790	9,782,789	77,000,017
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,000,000	11,000,000	93,708,450
4	Phí kiểm toán	11,842,868	11,842,868	85,392,601
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	10,108,697	10,108,697	113,217,394
5.1	Thù lao ban đại diện	10,108,697	10,108,697	80,217,394
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;	-	-	19,012,441
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	-	-	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	9,222,488	16,948,216	80,035,536
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	4,179,305	4,551,302	29,645,909
9.1	Phí ngân hàng	1,869,305	2,241,302	11,165,909
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	18,480,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	980,673,620	295,252,336	2,260,133,151
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	5,072,510,700	1,842,185,000	20,255,043,400
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	191,429,369	3,492,575,705	11,760,467,958
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	4,881,081,331	(1,650,390,705)	8,494,575,442
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	6,053,184,320	2,137,437,336	22,515,176,551
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	140,895,852,091	137,205,984,597	91,403,643,028
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	9,170,750,574	3,689,867,494	58,662,959,637
	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	6,053,184,320	2,137,437,336	22,515,176,551
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	4,480,304,184	3,856,013,224	44,288,736,631
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(1,362,737,930)	(2,303,583,066)	(8,140,953,545)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	150,066,602,665	140,895,852,091	150,066,602,665

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	72,000	4,744,368,000	3.11%
	VNR	103,900	21,800	2,265,020,000	1.49%
	VNM	98,409	156,000	15,351,804,000	10.08%
	VLC	107,400	17,000	1,825,800,000	1.20%
	VIT	70,000	27,200	1,904,000,000	1.25%
	VHC	20,475	55,500	1,136,362,500	0.75%
	VGC	50,600	15,000	759,000,000	0.50%
	TRA	5,952	112,000	666,624,000	0.44%
	TCM	207,250	20,600	4,269,350,000	2.80%
	TCL	11,700	29,800	348,660,000	0.23%
	SVI	77,268	40,500	3,129,354,000	2.05%
	SVC	16,500	42,900	707,850,000	0.46%
	RAL	12,000	95,000	1,140,000,000	0.75%
	PVT	122,100	14,600	1,782,660,000	1.17%
	PVS	210,000	21,000	4,410,000,000	2.90%
	PVD	60,750	25,300	1,536,975,000	1.01%
	PNJ	2	70,500	141,000	-
	PLC	37,000	28,900	1,069,300,000	0.70%
	PET	155,000	12,700	1,968,500,000	1.29%
	NT2	55,120	35,600	1,962,272,000	1.29%
	NSC	34,000	102,000	3,468,000,000	2.28%
	NNG	82,300	15,300	1,259,190,000	0.83%
	NCT	5,000	101,000	505,000,000	0.33%
	MBB	402,378	14,800	5,955,194,400	3.91%
	KDC	75,000	38,500	2,887,500,000	1.90%
	HDG	34,507	25,500	879,928,500	0.58%
	HCM	72,420	28,900	2,092,938,000	1.37%
	GAS	17,540	64,000	1,122,560,000	0.74%
	FPT	124,702	43,900	5,474,417,800	3.59%
	FCN	107,000	21,400	2,289,800,000	1.50%
	DRC	14,300	38,600	551,980,000	0.36%
	DPR	91,910	34,500	3,170,895,000	2.08%
	DHG	38,076	96,500	3,674,334,000	2.41%
	DGC	5,923	46,000	272,458,000	0.18%
	CAV	13,000	88,000	1,144,000,000	0.75%
	BVS	45,900	15,600	716,040,000	0.47%
	BMP	13,000	163,000	2,119,000,000	1.39%
	BCC	210,000	17,600	3,696,000,000	2.43%
	ANV	119,020	6,200	737,924,000	0.48%
	ACB	127,200	18,000	2,289,600,000	1.50%
	Tổng			95,284,800,200	62.55%
II	Cổ phiếu chưa niêm yết				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại cổ phiếu			95,284,800,200	62.55%
III	Trái phiếu				
	Tổng			-	-
IV	Chứng khoán				
	Tổng			-	-
	Tổng các loại chứng khoán			95,284,800,200	62.55%
V	Các tài sản khác				
1	Cổ tức, trái tức được nhận			541,191,000	0.36%
2	Trái tức được nhận			-	-
3	Lãi được nhận			1,196,060,691	0.79%
4	Tiền bán chứng khoán nhờ thu			-	-
5	Các khoản phải thu khác			-	-
6	Các tài sản khác			-	-
	Tổng			1,737,251,691	1.14%
VI	Tiền và các khoản tương đương tiền				
1	Tiền			-	-
2	Tiền gửi ngân hàng			5,578,138,780	3.66%
3	Các khoản tương đương tiền			-	-
4	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng			33,658,678,171	22.10%
5	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng			16,068,669,386	10.55%
	Tổng			55,305,486,337	36.31%
VII	Tổng giá trị danh mục			152,327,538,228	100.00%

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 (%)	0.42%	0.45%
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 (%)	0.17%	0.18%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.10%	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 (%)	0.08%	0.09%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.41%	2.53%
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(%)	25.44%	48.51%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	93,068,201,200	92,039,295,100
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	9,306,820.12	9,203,929.51
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	294,710.49	255,086.74
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,947,104,900	2,550,867,400
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(88,836.45)	(152,196.13)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(888,364,500)	(1,521,961,300)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	95,126,941,600	93,068,201,200
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	9,512,694.16	9,306,820.12
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	71.15%	73.44%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	77.62%	79.32%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	27.62%	28.22%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	590	564
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	15,775.40	15,138.98

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



Bùi Sỹ Tấn
Phó Tổng Giám Đốc

Công ty Quản Lý Quỹ

