

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
01/01/2015 Đến 30/06/2015

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	76,934,977,598	73,976,386,490
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	3,647,591,329	2,444,922,611
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	3,647,591,329	2,444,922,611
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)	(1,472,994,508)	513,668,497
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	2,236,030,903	7,195,579,514
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(3,709,025,411)	(6,681,911,017)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	79,109,574,419	76,934,977,598

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 24 tháng 07 năm 2015

Nguyễn Trung Nam

Phó Tổng Giám Đốc

Công ty Quản lý Quỹ



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 01/01/2015 Tới 30/06/2015

30/06/2015

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	21,164,263,037	21,381,119,508	94.89
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	1,464,050,537	881,119,508	586.22
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19,700,212,500	20,500,000,000	115.88
I.2	Các khoản đầu tư	56,162,925,800	54,221,645,500	-
	Cổ phiếu	56,162,925,800	54,221,645,500	-
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	30,000,000	75,525,000	17.01
1	Cổ tức, trái tức được nhận	30,000,000	75,525,000	17.01
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	624,718,969	1,407,866,667	90.14
I.5	Tiền bán chứng khoán nhờ thu	1,469,492,451	558,660,750	-
	Cổ phiếu	1,469,492,451	558,660,750	-
I.6	Các khoản phải thu khác	-	-	-
I.7	Các tài sản khác	-	-	-
I.8	Tổng tài sản	79,451,398,257	77,644,817,425	107.09
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	-	317,876,100	-
	Cổ phiếu	-	317,876,100	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	341,823,838	391,963,727	156.71
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	9,539,585	36,391,897	23.86
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	9,539,582	36,391,894	29.96
3	Phải trả thuế	3,312,911	2,583,700	91.32
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	-	16,082,196	-
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	2,601,362	878.11
6	Phí quản trị quỹ	9,493,148	2,881,499	360.87
7	Phải trả phí quản lý quỹ	96,878,167	97,551,088	107.80
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	2,861,499	878.11
9	Phí đại lý chuyển nhượng	11,550,000	2,861,499	439.05
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	60,002,745	121,000,000	505.81
12	Thù lao ban đại diện	18,000,000	19,578,041	93.35

13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quý	2,000,000	2,175,354	93.35
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	2,520,000	2,940,000	109.09
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 Quý mở	-	-	-
27	Phải trả chi phí họp, Đại hội Nhà Đầu Tư Quý mở	-	-	-
28	Chi phí thanh lý tài sản	-	-	-
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	75,087,700	46,083,700	1,057.57
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	341,823,838	709,839,827	156.71
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	79,109,574,419	78,934,977,598	106.94
	Tổng số đơn vị quỹ	6,899,517.37	7,030,274.27	98.68
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	11,465.95	10,943.38	108.37

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	1,794,830,645	2,234,948,142	1,794,830,645
1	Cổ tức, trái tức được nhận	1,013,770,000	1,353,545,000	1,013,770,000
	Cổ tức được nhận	1,013,770,000	1,353,545,000	1,013,770,000
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	752,649,258	833,789,631	752,649,258
3	Các khoản thu nhập khác	28,411,387	47,613,511	28,411,387
II	Chi phí	1,154,179,616	953,129,031	1,154,179,616
1	Phí quản lý quỹ	578,524,496	607,856,146	578,524,496
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	279,115,643	50,506,729	279,115,643

2.1	Phí dịch vụ lưu ký	125,963,255	16,108,091	125,963,255
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	10,710,000	13,020,000	10,710,000
2.3	Phí giám sát	138,559,580	17,718,900	138,559,580
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	3,882,808	3,659,738	3,882,808
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	129,601,437	35,882,476	129,601,437
3.1	Phí quản trị quỹ	57,234,907	17,718,900	57,234,907
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	72,366,530	18,163,576	72,366,530
4	Phí kiểm toán	80,002,745	109,137,254	80,002,745
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	40,000,000	40,328,752	40,000,000
5.1	Thù lao ban đại diện	40,000,000	40,328,752	40,000,000
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	-	17,791,705
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	10,702,233	-	10,702,233
6.2	Chi phí báo cáo thường niên	-	-	-
6.3	Chi phí Ban Đại Diện	7,089,472	-	7,089,472
7	Chi phí liên quan đến thực hiện các giao dịch tài sản quỹ	13,572,417	23,504,915	13,572,417
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	35,571,173	53,110,759	35,571,173
9.1	Phí ngân hàng	4,881,173	37,416,759	4,881,173
9.2	Chi phí in ấn tài liệu	17,050,000	24,420,000	17,050,000
9.3	Phí giấy phép thành lập	-	-	-
9.4	Dịch vụ bưu chính	-	414,000	-
9.5	Phí quảng cáo	-	-	-
9.6	Dịch vụ quỹ mở - DBDI	13,860,000	13,860,000	13,860,000
9.7	Phí khác	-	10,000,000	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
III	Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)	640,651,029	1,281,819,111	640,651,029
IV	Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư	3,006,940,300	1,163,103,500	3,006,940,300
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	1,560,602,233	1,778,309,515	1,560,602,233
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	1,446,338,067	(615,206,015)	1,446,338,067
V	Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)	3,647,591,329	2,444,922,611	3,647,591,329
VI	Giá trị tài sản ròng đầu kỳ	76,934,977,598	73,976,386,490	76,934,977,598
VII	Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ	2,174,596,821	2,958,591,108	2,174,596,821
	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	3,647,591,329	2,444,922,611	3,647,591,329
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	2,236,030,903	7,195,579,514	2,236,030,903
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(3,709,025,411)	(6,881,911,017)	(3,709,025,411)
VIII	Giá trị tài sản ròng cuối kỳ	79,109,574,419	76,967,977,598	79,109,574,419

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(%)	1.49%	1.51%
2	Tỷ lệ phí lưu ký, phí giám sát/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.72%	0.13%
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 (%)	0.33%	0.09%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.15%	0.27%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.10%	0.18%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	2.97%	2.29%
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(%)	11.64%	19.50%
II	Các chỉ tiêu khác		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	70,302,742,700	69,916,984,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	7,030,274.27	6,991,898.47
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	201,965.59	615,835.87
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,019,655,900	6,156,358,700
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(332,722.49)	(577,060.07)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(3,327,224,900)	(5,770,600,700)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	68,995,173,700	70,302,742,700
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	6,899,517.37	7,030,274.27
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	79.57%	78.11%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	85.47%	83.97%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	37.92%	37.14%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	294	303
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	11,105.95	10,943.38

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



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
Bán Niên 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 (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
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 24 tháng 07 năm 2015
Nguyễn Trung Nam
Phó Tổng Giám Đốc

Phụ Lục số 27 - Bản thống kê phí giao dịch trong hoạt động đầu tư của quỹ
(Ban hành kèm theo Thông tư 183 hướng dẫn về việc thành lập và quản lý Quỹ mở)

THÔNG KÊ PHÍ GIAO DỊCH CỦA CÁC QUỸ

Tên của Công ty quản lý quỹ:

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

Địa chỉ:

Tên của Quỹ:

Quỹ đầu tư Cân Bằng Chiến Lược VCBF (VCBF-TBF)

Kỳ báo cáo:

từ 01/01/2015 tới 30/06/2015

Đơn vị tính: VND

STT	Tên (mã) các Công ty chứng khoán có giá trị giao dịch vượt quá 5% tổng giá trị giao dịch trong năm	Quan hệ với công ty quản lý quỹ	Tỷ lệ giao dịch của quỹ qua từng công ty chứng khoán			Phí giao dịch bình quân	Phí giao dịch bình quân trên thị trường
			Giá trị giao dịch trong kỳ báo cáo của quỹ (VND)	Tổng giá trị giao dịch trong kỳ báo cáo của quỹ (VND)	Tỷ lệ giao dịch của quỹ qua từng công ty chứng khoán		
1	Công ty TNHH Chứng Khoán NHTMCP Ngoại Thương Việt Nam	không có liên quan	4,316,595,000.00	9,048,280,000.00	47.71	0.15	0.15
2	Công ty CP Chứng khoán Sài Gòn	không có liên quan	1,931,745,000.00	9,048,280,000.00	21.35	0.15	0.15
3	Công ty CP Chứng khoán Bản Việt	không có liên quan	2,799,940,000.00	9,048,280,000.00	30.94	0.15	0.15
Tổng			9,048,280,000.00	9,048,280,000.00	100.00	0.45	0.15

Ngân Hàng Giám Sát

Trần Đài Trang

Trần Đài Trang

Trưởng Ban Dịch Vụ Quản Trị Quỹ

DefaultHeaderValue

DEUTSCHE BANK AG

BANK AG

HO CHI MINH CITY

Đang Vũ Hoạt Diệu

Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán

DefaultHeaderValue

DefaultHeaderValue



Tp. Hồ Chí Minh, ngày 24 tháng 07 năm 2015

Nguyễn Trung Nam

Phó Tổng Giám Đốc

DefaultHeaderValue

DefaultHeaderValue