

## 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 Từ: 01/05/2016 Tới: 31/05/2016

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	100,546,670,881	97,389,120,916
II	Thay đổi NAV so với kỳ trước (=II.1 + II.2), trong đó	2,344,391,648	1,755,109,616
II.1	Thay đổi NAV do biến động thị trường và hoạt động giao dịch của quỹ trong kỳ	2,344,391,648	1,755,109,616
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)	2,182,653,419	1,402,440,349
III.1	Khoản thu từ việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ	2,908,037,712	2,296,501,480
III.2	Khoản thanh toán từ việc mua lại chứng chỉ quỹ	(725,384,293)	(894,061,131)
IV	Giá trị tài sản ròng của quỹ cuối kỳ (= I + II + III)	105,073,715,948	100,546,670,881

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 07 tháng 06 năm 2016



PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

*Bùi Sỹ Tân*

Công ty Quản lý Quỹ

Phụ Lục 31 - Mẫu Báo Cáo hoạt động vay, giao dịch mua bán tại 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 TẠI CỦA QUỸ**  
**Tháng 05 Năm 2016**

Kính gửi: Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước

Công ty quản lý quỹ:  
Địa chỉ:

Công ty liên doanh quản lý quỹ đầu 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		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	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 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 Hoài Diệu  
Giám Đốc Nghiệp Vụ Chứng Khoán  
Ngân hàng Giám Sát Deutsche Bank AG  
Chi nhánh Tp. HCM



ngày 07 tháng 06 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 01/05/2016 Tới 31/05/2016

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	28,445,516,156	29,689,236,446	137.40
	Tiền	-	-	-
	Tiền gửi ngân hàng	3,706,241,530	4,958,783,727	369.59
	Các khoản tương đương tiền	-	-	-
	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng	5,039,062,126	5,030,240,219	-
	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng	19,700,212,500	19,700,212,500	100.00
I.2	Các khoản đầu tư	77,033,302,300	72,160,301,700	137.04
	Cổ phiếu	77,033,302,300	72,160,301,700	137.04
I.3	Cổ tức, trái tức được nhận	215,802,000	-	126.63
1	Cổ tức, trái tức được nhận	215,802,000	-	126.63
2	Trái tức được nhận	-	-	-
I.4	Lãi được nhận	2,028,023,015	1,886,033,470	402.44
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	107,722,643,471	103,735,571,616	138.84
STT	Nợ phải trả	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	%/ cùng kỳ năm trước (*)
II.1	Tiền phải thanh toán mua chứng khoán	186,279,000	-	-
	Cổ phiếu	186,279,000	-	-
	Trái Phiếu	-	-	-
II.2	Các khoản phải trả khác	2,462,648,523	3,188,900,735	723.59
1	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Đại lý phân phối	85,620,272	62,005,128	1,069.12
2	Phải trả phí phát hành, mua lại chứng chỉ quỹ cho Cty QLQ	85,620,272	62,005,128	1,069.12
3	Phải trả thuế	725,383	8,573,971	24.85
4	Phải trả do việc mua lại chứng chỉ quỹ	124,483,812	873,323,023	162.95
5	Phải trả phí lưu ký	21,000,000	21,000,000	100.00
6	Phí quản trị quỹ	9,782,790	9,467,215	99.73
7	Phải trả phí quản lý quỹ	254,498,081	474,291,304	261.09
8	Phải trả Phí ngân hàng giám sát	23,100,000	23,100,000	100.00
9	Phí đại lý chuyển nhượng	33,000,000	22,000,000	285.71
10	Phải trả Phí môi giới	-	-	-
11	Phải trả Phí kiểm toán	50,246,025	148,403,157	100.38
12	Thù lao ban đại diện	18,098,901	35,901,084	150.00
13	Phải trả thuế thu nhập Lương Ban Đại Diện Quỹ	2,010,987	3,989,025	150.00
14	Chi phí Ban Đại Diện	-	-	-
15	Phải trả khác - hợp đồng repo	-	-	-
16	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	4,830,000	1,680,000	1,150.00
17	Lãi trả trước	-	-	-
28	Chi phí thanh lý tài sản	-	-	-
29	Phải trả cho Nhà đầu tư về mua Chứng chỉ quỹ	1,749,632,000	1,443,161,700	9,619.86
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	2,648,927,523	3,188,900,735	778.33
	Tài sản ròng của quỹ (I.8-II.3)	105,073,715,948	100,546,670,881	136.02
	Tổng số đơn vị quỹ	7,444,184.65	7,285,929.46	107.60
	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ	14,114.87	13,800.11	126.41

**II. BÁO CÁO KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG**

STT	Chỉ tiêu	Kỳ báo cáo	Kỳ trước	Lũy kế từ đầu năm
<b>I.</b>	<b>Thu nhập từ hoạt động đầu tư</b>	<b>653,125,328</b>	<b>328,193,379</b>	<b>1,695,652,524</b>
1	Cổ tức, trái tức được nhận	496,068,600	172,900,000	955,176,600
	Cổ tức được nhận	496,068,600	172,900,000	955,176,600
	Trái tức được nhận	-	-	-
2	Lãi được nhận	152,414,583	147,264,950	708,772,659
3	Các khoản thu nhập khác	4,642,145	8,028,429	31,703,265
<b>II</b>	<b>Chi phí</b>	<b>273,094,280</b>	<b>225,085,363</b>	<b>1,150,665,897</b>
1	Phí quản lý quỹ	131,539,497	122,958,584	605,830,801
2	Phí lưu ký, phí ngân hàng giám sát	49,783,390	46,639,941	242,520,436
2.1	Phí dịch vụ lưu ký	21,000,000	21,000,000	105,000,000
2.2	Phí giao dịch thanh toán bù trừ chứng khoán	4,830,000	1,680,000	18,060,000
2.3	Phí giám sát	23,100,000	23,100,000	115,500,000
2.4	Phí lưu ký chứng khoán trả cho VSD	853,390	859,941	3,960,436
3	Phí quản trị quỹ, phí đại lý chuyển nhượng	20,782,790	20,467,216	108,675,673
3.1	Phí quản trị quỹ	9,782,790	9,467,216	47,967,223
3.2	Phí đại lý chuyển nhượng	11,000,000	11,000,000	60,708,450
4	Phí kiểm toán	11,842,868	11,053,432	50,246,025
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao trả ban đại diện quỹ	43,219,779	9,890,109	83,109,888
5.1	Thù lao ban đại diện	10,219,779	9,890,109	50,109,888
5.2	Chi phí tư vấn pháp luật	33,000,000	-	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;	4,202,000	8,316,000	12,518,000
6.1	Chi phí họp, Đại hội Quỹ mở	4,202,000	8,316,000	12,518,000
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	8,454,960	2,699,441	31,662,702
8	Chi phí lãi vay	-	-	-
9	Các loại phí khác	3,268,996	3,060,640	16,102,372
9.1	Phí ngân hàng	958,996	750,640	4,552,372
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	11,550,000
9.7	Phí khác	-	-	-
9.8	Phí quản lý thường niên cho SSC	-	-	-
<b>III</b>	<b>Thu nhập ròng từ hoạt động đầu tư (I-II)</b>	<b>380,031,048</b>	<b>103,108,016</b>	<b>544,986,627</b>
<b>IV</b>	<b>Lãi (lỗ) từ hoạt động đầu tư</b>	<b>1,964,360,600</b>	<b>1,652,001,600</b>	<b>7,295,659,500</b>
1	Lãi (lỗ) từ thực tế phát sinh từ hoạt động đầu tư	746,031,061	365,448,120	4,537,489,068
2	Thay đổi giá trị các khoản đầu tư trong kỳ	1,218,329,539	1,286,553,480	2,758,170,432
<b>V</b>	<b>Thay đổi giá trị tài sản ròng của quỹ do các hoạt động đầu tư trong kỳ (III + IV)</b>	<b>2,344,391,648</b>	<b>1,755,109,616</b>	<b>7,840,646,127</b>
<b>VI</b>	<b>Giá trị tài sản ròng đầu kỳ</b>	<b>100,546,670,881</b>	<b>97,389,120,916</b>	<b>91,403,643,028</b>
<b>VII</b>	<b>Thay đổi giá trị tài sản ròng của Quỹ trong kỳ</b>	<b>4,527,045,067</b>	<b>3,157,549,965</b>	<b>13,670,072,920</b>
	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	2,344,391,648	1,755,109,616	7,840,646,127
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	2,908,037,712	2,296,501,480	10,091,751,067
4	Thay đổi giá trị tài sản ròng do mua lại Chứng chỉ Quỹ	(725,384,293)	(894,061,131)	(4,262,324,274)
<b>VIII</b>	<b>Giá trị tài sản ròng cuối kỳ</b>	<b>105,073,715,948</b>	<b>100,546,670,881</b>	<b>105,073,715,948</b>

06-  
CÔNG  
LIÊN D  
V LỸ QU  
HỨNG  
ETCO  
KIỂM

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	Tổng giá trị	%/Tổng giá trị tài sản của quỹ
<b>I</b>	<b>Cổ phiếu niêm yết</b>				
	VSC	48,540	60,500	2,936,670,000	2.73%
	VNM	82,008	142,000	11,645,136,000	10.81%
	VIT	70,000	22,000	1,540,000,000	1.43%
	VHC	53,405	33,900	1,810,429,500	1.68%
	VGC	35,600	13,700	487,720,000	0.45%
	TRA	7,230	126,000	910,980,000	0.85%
	TCM	59,000	26,300	1,551,700,000	1.44%
	SVI	79,168	37,800	2,992,550,400	2.78%
	SVC	39,500	37,800	1,493,100,000	1.39%
	RAL	52,000	70,500	3,666,000,000	3.40%
	PVT	111,000	13,000	1,443,000,000	1.34%
	PVS	210,000	18,700	3,927,000,000	3.65%
	PVD	60,750	31,600	1,919,700,000	1.78%
	PNJ	36,302	65,000	2,359,630,000	2.19%
	PLC	37,000	32,000	1,184,000,000	1.10%
	PET	125,000	12,500	1,562,500,000	1.45%
	NT2	55,120	31,600	1,741,792,000	1.62%
	NSC	29,000	93,000	2,697,000,000	2.50%
	MWG	10,000	86,000	860,000,000	0.80%
	MBB	392,378	15,600	6,121,096,800	5.68%
	KDC	30,000	26,900	807,000,000	0.75%
	HDG	31,370	27,400	859,538,000	0.80%
	HCM	22,420	31,500	706,230,000	0.66%
	GAS	17,540	60,000	1,052,400,000	0.98%
	FPT	89,702	40,800	3,659,841,600	3.40%
	FCN	107,000	20,800	2,225,600,000	2.07%
	DRC	11,000	52,500	577,500,000	0.54%
	DPR	71,390	37,600	2,684,264,000	2.49%
	DHG	38,076	76,000	2,893,776,000	2.69%
	CAV	40,000	69,500	2,780,000,000	2.58%
	BMP	13,000	139,000	1,807,000,000	1.68%
	BCC	190,000	14,100	2,679,000,000	2.49%
	ANV	119,020	7,400	880,748,000	0.82%
	ACB	31,000	18,400	570,400,000	0.53%
	<b>Tổng</b>			<b>77,033,302,300</b>	<b>71.51%</b>
<b>II</b>	<b>Cổ phiếu chưa niêm yết</b>				
	<b>Tổng</b>			-	-
	<b>Tổng các loại cổ phiếu</b>			<b>77,033,302,300</b>	<b>71.51%</b>
<b>III</b>	<b>Trái phiếu</b>				
	<b>Tổng</b>			-	-
<b>IV</b>	<b>Chứng khoán</b>				
	<b>Tổng</b>			-	-
	<b>Tổng các loại chứng khoán</b>			<b>77,033,302,300</b>	<b>71.51%</b>
<b>V</b>	<b>Các tài sản khác</b>				
1	Cổ tức, trái tức được nhận			215,802,000	0.20%
2	Trái tức được nhận			-	-
3	Lãi được nhận			2,028,023,015	1.88%
4	Tiền bán chứng khoán nhờ thu			-	-
5	Các khoản phải thu khác			-	-
6	Các tài sản khác			-	-
	<b>Tổng</b>			<b>2,243,825,015</b>	<b>2.08%</b>
<b>VI</b>	<b>Tiền và các khoản tương đương tiền</b>				
1	Tiền			-	-
2	Tiền gửi ngân hàng			3,706,241,530	3.44%
3	Các khoản tương đương tiền			-	-
4	Tiền gửi có kỳ hạn không quá 3 tháng			5,039,062,126	4.68%
5	Tiền gửi có kỳ hạn trên 3 tháng			19,700,212,500	18.29%
	<b>Tổng</b>			<b>28,445,516,156</b>	<b>26.41%</b>
<b>VII</b>	<b>Tổng giá trị danh mục</b>			<b>107,722,643,471</b>	<b>100.00%</b>

370  
TTS  
K  
K  
+3  
D  
TY  
ANH  
ĐẦU TƯ  
HOÀN  
BANK  
TP. HỒ

**IV. MỘT SỐ CHỈ TIÊU KHÁC**

STT	Chỉ tiêu	Kỳ báo cáo	Kỳ trước
<b>I</b>	<b>Các chỉ tiêu về hoạt động</b>		
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 (%)	0.58%	0.56%
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 (%)	0.24%	0.25%
4	Chi phí kiểm toán (phát sinh)/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.14%	0.13%
5	Chi phí dịch vụ pháp lý, báo giá, thù lao ban đại diện quỹ/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	0.50%	0.12%
6	Tỷ lệ chi phí hoạt động/ Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%)	3.17%	2.70%
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(%)	32.68%	10.80%
<b>II</b>	<b>Các chỉ tiêu khác</b>		
1	Quy mô quỹ đầu kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành đầu kỳ	72,859,294,600	71,843,950,900
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành đầu kỳ	7,285,929.46	7,184,395.09
2	Thay đổi quy mô quỹ trong kỳ		
	số lượng đơn vị quỹ phát hành thêm trong kỳ	210,556.10	166,084.92
	Giá trị vốn thực huy động trong kỳ	2,105,561,000	1,660,849,200
	Số lượng đơn vị quỹ mua lại trong kỳ	(52,300.91)	(64,550.55)
	Giá trị vốn thực phải thanh toán trong kỳ khi đáp ứng lệnh của nhà đầu tư	(523,009,100)	(645,505,500)
3	Quy mô quỹ cuối kỳ		
	Tổng giá trị chứng chỉ quỹ đang lưu hành	74,441,846,500	72,859,294,600
	Tổng số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành cuối kỳ	7,444,184.65	7,285,929.46
4	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của công ty quản lý quỹ và người liên quan cuối kỳ	74.32%	77.01%
5	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của 10 nhà đầu tư lớn nhất cuối kỳ	79.18%	80.97%
6	Tỷ lệ nắm giữ chứng chỉ quỹ của nhà đầu tư nước ngoài cuối kỳ	35.26%	36.02%
7	Số nhà đầu tư tham gia vào quỹ, kể cả giao dịch ký danh	462	438
8	Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cuối tháng	14,114.87	13,800.11

Ngân Hàng Giám Sát

*[Handwritten signature]*

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



Tp. HCM, ngày 07 tháng 06 năm 2016

**PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC AG**

Công ty Quản lý Quỹ

*Bùi Sỹ Tân*

