**BÁO CÁO CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ**

**Qúy III năm 2021**

*Quỹ Hoán đổi danh mục ETF DCVFMVN DIAMOND*

1. **Thông tin chung về Quỹ**
2. **Mục tiêu của Quỹ**

Phù hợp với Giấy chứng nhận đăng ký thành lập Quỹ do UBCKNN cấp, Điều lệ và Bản cáo bạch của Quỹ.

1. **Hiệu quả hoạt động của Quỹ**

Kết thúc ngày 30 tháng 09 năm 2021, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là **-9.28 %** so với giá trị tài sản ròng của quỹ đầu kỳ báo cáo tại ngày 30 tháng 06 năm 2021; Trong khi giá trị của danh mục của chứng khoán cơ cấu thay đổi là 1.94%, thay đổi của chỉ số tham chiếu là 1.28%.

1. **Chính sách và chiến lược đầu tư của Quỹ**

Mục tiêu của Quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số VN DIAMOND.

Quỹ sử dụng chiến lược đầu tư thụ động để thực hiện mục tiêu đầu tư đã định trước. Khi danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu có sự thay đổi thì Quỹ sẽ thực hiện điều chỉnh danh mục của Quỹ để phù hợp với danh mục của chỉ số tham chiếu về cơ cấu và tỷ trọng tài sản. Quỹ sẽ hướng đến việc có kết quả tương đồng với chỉ số tham chiếu và không thực hiện chiến lược phòng thủ khi thị trường giảm hay hiện thực hóa lợi nhuận khi thị trường được định giá quá cao. Việc đầu tư thụ động nhằm giảm thiểu chi phí và mô phỏng gần hơn chỉ số tham chiếu bằng cách duy trì tỷ lệ vòng quay vốn đầu tư thấp hơn so với các quỹ sử dụng chiến lược đầu tư chủ động.

1. **Phân loại Quỹ**

Quỹ thuộc loại quỹ Hoán đổi danh mục.

1. **Thời gian khuyến cáo đầu tư của Quỹ**

Không có.

1. **Mức độ rủi ro ngắn hạn**

Trung bình.

1. **Thời điểm bắt đầu hoạt động của Quỹ**

Quỹ bắt đầu hoạt động từ ngày 22 tháng 4 năm 2020.

1. **Quy mô Quỹ tại thời điểm báo cáo**

Tại ngày 30 tháng 09 năm 2021, số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành là 471,500,000 và giá trị tài sản ròng của một đơn vị chứng chỉ quỹ là 26,034.85 Đồng Việt Nam.

1. **Chỉ số tham chiếu của Quỹ**

Chỉ số tham chiếu của Quỹ chỉ số VN DIAMOND.

1. **Chính sách phân phối lợi nhuận của Quỹ**

- Để hạn chế tối đa chi phí phát sinh , Quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND sẽ không phân phối lợi nhuận.

-Toàn bộ lợi nhuận của Quỹ phát sinh trong quá trình hoạt động sẽ được tích lũy làm gia tăng giá trị tài sản ròng của Quỹ

1. **Lợi nhuận thuần thực tế phân phối trên một đơn vị Chứng chỉ quỹ Quỹ**

Không có.

1. **Số liệu hoạt động**
2. **Cơ cấu tài sản quỹ**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Cơ cấu tài sản quỹ** | **30/09/2021** | **30/09/2020** |
| Danh mục chứng khoán | 99.73% | 99.27% |
| Tài sản khác | 0.27% | 0.73% |
| **Cộng** | **100.00%** | **100.00%** |

1. **Chi tiết chỉ tiêu hoạt động**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **30/09/2021** | **30/09/2020** |
| Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND) | 12,275,435,735,239 | 2,244,878,995,971 |
| Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND) | 471,500,000 | 168,300,000 |
| Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND) | 26,034.85 | 13,338.55 |
| Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,654.67 | 13,434.36 |
| Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 23,605.97 | 10,767.86 |
| Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND) | 26,250 | 13,370 |
| Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,480 | 13,600 |
| Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 23,610 | 10,500 |
| Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 1.94% | 16.60% |
| *Tăng trưởng vốn (%)/1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá)* | -5.29% | 16.20% |
| *Tăng trưởng thu nhập (%)/1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện)* | 7.24% | 0.39% |
| Phân phối gộp trên 1 đơn vị CCQ (VND) | Không có | Không có |
| Phân phối ròng trên 1 đơn vị CCQ (VND) | Không có | Không có |
| Ngày chốt quyền (Ex-date of distribution) | Không có | Không có |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%) | 1.11% | 1.05% |
| Tốc độ vòng quay danh mục (%) | 14.46% | 7.46% |

1. **Tăng trưởng qua các thời kỳ**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Giai đoạn** | **Tổng tăng trưởng của NAV/CCQ**  **(%)** | **Tăng trưởng NAV/CCQ hàng năm**  **(%)** |
| 1 năm | 95.18 | 95.18 |
| 3 năm | N/A | N/A |
| Từ khi thành lập | 160.35 | 87.58 |
| Tăng trưởng của chỉ số tham chiếu | N/A | N/A |

1. **Tăng trưởng hàng năm**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Thời kỳ** | **30/09/2021** | **30/09/2020** |
| Tỷ lệ tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 95.18 | 73.68 |

1. **Mô tả thị trường trong kỳ**

VNINDEX tăng 0.8% trong tháng 9 và đóng cửa ở mức 1,342 điểm. Thanh khoản cả thị trường thấp hơn so với tháng trước giá trị giao dịch bình quân hằng ngày giảm lần lượt 9% và 7% còn 928 triệu USD trên HOSE và 1,172 triệu USD trên cả 3 sàn.

Những điểm chính của thị trường trong quý 3:

i. Khối ngoại vẫn bán ròng; nhóm cổ phiếu bất động sản, ngân hàng và chứng khoán giảm giá;

ii. Các cổ phiếu “hàng hóa”, dịch vụ bán lẻ và vốn hóa nhỏ tăng giá tốt;

iii. Thị trường hướng kỳ vọng sang quý 4 khi giãn cách được nới lỏng, duy trì xu hướng tích lũy.

1. **Chi tiết các chỉ tiêu hoạt động của quỹ**
2. **Số liệu chi tiết hoạt động của Quỹ**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **1 năm đến thời điểm báo cáo (%)** | **3 năm gần nhất tính đến thời điểm báo cáo (%)** | **Từ khi thành lập đến thời điểm báo cáo (%)** |
| Tăng trưởng thu nhập/1 đơn vị CCQ | 28.38% | #DIV/0! | 38.02% |
| Tăng trưởng Vốn/1 đơn vị CCQ | 66.80% | #DIV/0! | 122.33% |
| Tổng tăng trưởng/1 đơn vị CCQ | 95.19% | #DIV/0! | 160.35% |
| Tăng trưởng hàng năm(%)/1 đơn vị CCQ | 95.18 | N/A | 87.58 |
| Tăng trưởng của danh mục cơ cấu | 95.18 | N/A | 160.35 |
| Thay đổi giá trị thị trường của 1 đơn vị CCQ | 96.34 | N/A | 150.00 |

● Biểu đồ tăng trưởng hàng tháng của Quỹ trong 3 năm gần nhất như sau: Nguyên

● Thay đổi giá trị tài sản ròng

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **30/09/2021** | **30/06/2021** | **Tỷ lệ thay đổi** |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ | 12,275,435,735,239 | 13,530,434,553,505 | -9.28% |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị CCQ | 26,034.85 | 25,538.75 | 1.94% |

Trong 1 năm từ 30/09/2020 đến 30/09/2021, thị trường chứng khoán Việt Nam tăng trưởng mạnh và cùng với đó được sự quan tâm và góp vốn của nhà đầu tư vào Quỹ ETF VFMVND nên tổng NAV của Quỹ ETF VFMVND có mức tăng mạnh mẽ.

1. **Thống kê về Nhà đầu tư nắm giữ Chứng chỉ quỹ tại thời điểm báo cáo**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Quy mô nắm giữ (Đơn vị)** | **Số lượng Nhà đầu tư nắm giữ** | **Số lượng đơn vị Chứng chỉ quỹ nắm giữ** | **Tỷ lệ nắm giữ** |
| **(%)** |
| Dưới 5.000 | 2,465 | 2,019,283 | 0.43% |
| Từ 5.000 đến 10.000 | 161 | 1,118,730 | 0.24% |
| Từ 10.000 đến 50.000 | 100 | 2,171,550 | 0.46% |
| Từ 50.000 đến 500.000 | 57 | 9,764,510 | 2.07% |
| Trên 500.000 | 62 | 456,425,927 | 96.80% |
| **Tổng cộng** | 2,845 | 471,500,000 | **100.00%** |

1. **Chi phí ngầm và giảm giá**

Để hạn chế vấn đề xung đột về lợi ích và đảm bảo sự chính xác của các khoản mục chi phí của Quỹ, Công ty quy định tất cả các nhân viên của Công ty không được phép nhận các khoản giảm giá bằng tiền và không được thực hiện các khoản chi phí ngầm khi thực hiện các giao dịch của Quỹ với các đối tác cung cấp dịch vụ cho Quỹ.

Trong kỳ báo cáo, Quỹ không phát sinh các khoản giảm giá bằng tiền hoặc chi phí ngầm liên quan đến các giao dịch của Quỹ với các đối tác cung cấp dịch vụ cho Quỹ.

1. **Thông tin về triển vọng thị trường**

GDP của Việt Nam giảm 6.2% vào quý 3 nhưng vẫn tăng trưởng dương ở mức 1.42% trong 9 tháng đầu năm. Trong đó 2 ngành chiếm tỷ trọng lớn nhất là sản xuất và dịch vụ đều ghi nhận giảm ở mức tương ứng -9.3% và -5% so với cùng kỳ. Nông lâm ngư nghiệp là ngành duy nhất giữ được mức tăng trưởng dương trong quý 3, ở mức +1.0%. Nền kinh tế đã có những tín hiệu phục hồi, chỉ số sản xuất công nghiệp tăng 5% so với tháng Tám trong khi chỉ số PMI dường như đã tạo đáy tại mức 40.2 bằng với tháng trước. Cán cân thanh toán của tháng đã chuyển thành thặng dư 0.5 tỷ USD và thu hẹp mức thâm hụt 9 tháng về còn 2.1 tỷ USD, khi xuất khẩu có giảm 0.8%, đạt 27 tỷ USD, nhưng nhập khẩu thu hẹp 3.9%, đạt 26.5 tỷ USD. Các hoạt động khác cũng đang dần trở lại với tổng mức bán lẻ hàng hóa tăng 6.5% so với tháng trước tổng khối lượng hàng hóa vận chuyển trong nước tăng 26% nhờ vào việc lược bỏ bớt các thủ tục hành chính khi di chuyển giữa các thành phố. Năm 2020 khi áp dụng chính sách zero-COVID, cả hai ngành dịch vụ và sản xuất đều phục hồi mạnh mẽ ngay sau khi dịch bệnh được kiểm soát. Lần này, khi xoay trục về chiến lược “Sống chung với COVID”, ngành sản xuất là ngành được kỳ vọng sẽ dẫn dắt sự phục hồi kinh tế những tháng cuối năm với nhiều đơn hàng quốc tế dồn lại trong thời gian giãn cách.

**Thông tin khác**

Thông tin về từng nhân sự điều hành quỹ, Ban đại diện quỹ, và Ban điều hành Công ty quản lý Quỹ như sau:

|  | **Tên** | **Chức vụ** | **Bằng cấp** | **Quá trình công tác** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Nhân sự điều hành Quỹ | Lương Thị Mỹ Hạnh | Giám đốc quản lý tài sản , khối trong nước | Thạc sỹ Kinh tế | -Từ 2010 đến 12/03/2021: Phó tổng giám đốc – Khối đầu tư nghiên cứu Công ty CP quản lý quỹ đầu tư Việt Nam.  -Từ 12/03/2021 đến nay là Giám đốc Quản lý tài sản, khối trong nước Công ty Cổ Phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam |
| Trần Lê Minh | Giám đốc chi nhánh Hà Nội | Thạc sỹ Quản trị Tài chính | Từ 2011 đến 12/03/2021: Phó Tổng giám đốc – Giám đốc chi nhánh Hà Nội – công ty CP quản lý quỹ đầu tư Việt Nam.  -Từ 12/03/2021 đến nay Giám đốc chi nhánh Hà Nội - Công ty Cổ Phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam |
|  | | | | |
| Ban đại diện Quỹ | Nguyễn Bội Hồng Lê | Chủ tịch | Thạc sỹ Quản trị kinh doanh | Từ 2010 đến 2012: Trưởng phòng giao dịch chứng khoán công ty CP chứng khoán dầu khí  Từ 2012 đến nay: Chuyên gia Kinh tế và Quản lý dầu khí Viện Dầu khí Việt Nam |
| Vương Thị Hoàng Yến | Thành viên | Cử nhân Kế toán – Kiểm toán | 8/2004-11/2007: kế toán trưởng công ty TNHH Minh Thắng  12/2007 – 4/2012:Kiểm toán viên, trưởng phòng kiểm toán công ty kiểm toán AS.  9/2012-5/2013: Kiểm toán viên, giám đốc kiểm toán công ty Hợp danh kiểm toán FA  Từ 2013 đến nay: Kiểm toán viên, giám đốc kiểm toán công ty kiểm toán Đại Tín. |
| Trần Ngọc Hân | Thành viên | Luật Sư | Từ 2015 đến nay: Chuyên viên cao cấp Pháp chế tuân thủ |
|  | | | | |
| Ban điều hành Công ty Quản lý quỹ | Ông Beat Schurch | Tổng Giám đốc | Thạc sỹ Kinh tế | Từ 30/12/2020– nay: Tổng giám đốc Công ty CP quản lý quỹ đầu tư Dragon Capital Việt Nam |

Thay mặt Ban Giám đốc Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Việt Nam

Ông **Nguyễn Minh Đăng Khánh**

Giám đốc điều hành Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư