**BÁO CÁO CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ**

**Quý I năm 2022**

*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 31 tháng 03 năm 2022, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là **12.28 %** so với giá trị tài sản ròng của quỹ đầu kỳ báo cáo tại ngày 31 tháng 12 năm 2021; Trong khi giá trị của danh mục của chứng khoán cơ cấu thay đổi là 6.23%, thay đổi của chỉ số tham chiếu là 6.86%.

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 31 tháng 03 năm 2022, số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành là 517,700,000 và giá trị tài sản ròng của một đơn vị chứng chỉ quỹ là 29,913.09 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** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Danh mục chứng khoán | 98.80% | 98.51% |
| Tài sản khác | 1.20% | 1.49% |
| **Cộng** | **100.00%** | **100.00%** |

1. **Chi tiết chỉ tiêu hoạt động**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND) | 15,486,009,740,868 | 9,799,077,340,633 |
| Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND) | 517,700,000 | 493,900,000.00 |
| Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND) | 29,913.09 | 19,840.20 |
| Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 29,913.09 | 20,410.40 |
| Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,614.29 | 16,585.33 |
| Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND) | 30,080 | 19,890 |
| Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 30,080 | 20,420 |
| Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,690 | 16,740 |
| Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 6.23% | N/A |
| *Tăng trưởng vốn (%)/1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá)* | 3.45% | N/A |
| *Tăng trưởng thu nhập (%)/1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện)* | 2.79% | N/A |
| 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 (%) | 1.06% | 1.03% |
| Tốc độ vòng quay danh mục (%) | 14.21% | 19.67% |

1. **Tăng trưởng qua các thời kỳ**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Giai đoạn** | **Tổng tăng trưởng của NAV/CCQ**  **(%)** | **Tăng trưởng NAV/CCQ hàng năm**  **(%)** |
| 1 năm | 50.77 | 50.77 |
| 3 năm | N/A | N/A |
| Từ khi thành lập | 199.13 | 72.02 |
| Tăng trưởng của chỉ số tham chiếu | N/A | N/A |

1. **Tăng trưởng hàng năm**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Thời kỳ** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Tỷ lệ tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 50.77 | 98.40 |

1. **Mô tả thị trường trong kỳ**

Chỉ số VNINDEX gần như đi ngang trong tháng 3, chỉ tăng 0,1% lên 1492 điểm. Chỉ số gần như không phản ứng với sự biến động của thị trường toàn cầu và số liệu vĩ mô tích cực của 2 tháng đầu năm. Dòng tiền tiếp tục đổ vào thị trường chứng khoán. Cụ thể, thanh khoản tăng 13% lên $1,16 tỷ trên sàn HOSE và tăng 17% lên $1,33 tỷ trên cả 3 sàn. Khối ngoại bán ròng $174 triệu trong tháng 3 và $313 triệu kể từ đầu năm, bằng một nửa so với Q12021, nhưng được hấp thụ hoàn toàn bởi nhà đầu tư trong nước. Số tài khoản mở mới đạt mức kỷ lục 270.217, cao hơn 20% so với mức đỉnh của tháng 12/2021. Tâm lý của nhà đầu tư trong nước vẫn giữ được sự lạc quan về triển vọng phục hồi của nền kinh tế. Tuy nhiên, sự tập trung cũng đang hướng về những đánh giá mức độ ảnh hưởng của các sự kiện bên ngoài tới Việt Nam.

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 | 25.79% | #DIV/0! | 53.31% |
| Tăng trưởng Vốn/1 đơn vị CCQ | 24.98% | #DIV/0! | 145.83% |
| Tổng tăng trưởng/1 đơn vị CCQ | 50.77% | #DIV/0! | 199.13% |
| Tăng trưởng hàng năm(%)/1 đơn vị CCQ | 50.77% | N/A | 72.02% |
| Tăng trưởng của danh mục cơ cấu | 50.77% | N/A | 199.13% |
| Thay đổi giá trị thị trường của 1 đơn vị CCQ | 51.23% | N/A | 186.48% |

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

● Thay đổi giá trị tài sản ròng

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **31/03/2022** | **31/03/2021** | **Tỷ lệ thay đổi** |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ | 15,486,009,740,868 | 9,799,077,340,633 | 58.04% |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị CCQ | 29,913.09 | 19,840.20 | 50.77% |

Từ 31/12/2021 đến 31/03/2022, 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 DCVFMVND nên tổng NAV của quỹ có mức tăng mạnh mẽ.

**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 | 3,402 | 2,855,391 | 0.55% |
| Từ 5.000 đến 10.000 | 228 | 1,588,890 | 0.31% |
| Từ 10.000 đến 50.000 | 155 | 3,205,000 | 0.62% |
| Từ 50.000 đến 500.000 | 67 | 12,154,020 | 2.35% |
| Trên 500.000 | 58 | 497,896,699 | 96.17% |
| **Tổng cộng** | **3,910** | **517,700,000** | **100%** |

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**

Kinh tế Việt Nam tiếp đà hồi phục và khởi sắc trong Quý 1 đạt mức 5%, cao hơn mức 4,7% và 3,7% của cùng kỳ năm 2021 và 2020. Lĩnh vực sản xuất vẫn tiếp tục là đầu tàu kinh tế, tăng 7,8% so với cùng kỳ năm trước, và là cơ sở cho sự tăng trưởng của hoạt động thương mại. Xuất khẩu tăng 13,4% đạt mức $89,1 tỷ và nhập khẩu tăng 15,2% đạt $87,6 tỷ, tương ứng với mức thặng dư $1,5 tỷ 3 tháng đầu năm. Ngành dịch vụ (tăng 4,6% so với cũng kỳ) đã đánh dấu cho sự trở lại ngoạn mục từ tháng 10 năm ngoái và được kỳ vọng trở thành động lực mới dẫn dắt kinh tế phục hồi trong thời gian tới, khi Việt Nam đã mở cửa lại các chuyến bay quốc tế và đặt mục tiêu đón hơn 5 triệu lượt khách nội địa trọng năm 2022. Ngành nông nghiệp, thủy hải sản và lâm nghiệp có sự phân hóa chỉ tăng 2,45% trong Quý 1. Sự leo thang của giá của phân bón và thức ăn gia súc làm gây áp lực đối với chăn nuôi, nhưng các lĩnh vực khác lại đang được hưởng lợi với sự giá tăng về giá xuất khẩu và đơn hàng đi nước ngoài. Bất chấp những sự biến động của toàn cầu, kinh tế Việt Nam vẫn có một khởi đầu vững chắc và ổn định trong quý 1. Sự ổn định vĩ mô của Việt Nam cũng được đánh giá rất cao bởi các tổ chức xếp hạng tín nhiệm quốc tế uy tín, khi Fitch và Moody’s duy trì tín nhiệm ở mức BB và Ba3 với triển vọng tích cực. Sau khi làn sóng Covid qua đi, chúng tôi tin rằng kinh tế Việt Nam có thể đạt 7,0% tăng trưởng năm nay, và nếu triển khai gói phục hồi kinh tế sớm và hiệu quả, tăng trưởng 8,6% là mục tiêu khả dĩ có thể đạt được.

**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 |
| 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.  -Từ 12/03/2021 đến nay Giám đốc chi nhánh Hà Nội |
|  | | | | |
| 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 tháng 12/2019 : Kiểm toán viên, giám đốc kiểm toán công ty kiểm toán Đại Tín.  - Từ tháng 1/2020 đến nay: Giám đốc nghiệp vụ Công ty TNHH kiểm toán Chuẩn Vàng |
| Trần Ngọc Hân | Thành viên | Thạc sỹ Luật, 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 đến 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