**BÁO CÁO CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ**

**Qúy II năm 2022**

*Qũy Hoán đổi danh mục ETF DCVFMVN30*

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 06 năm 2022, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là -16.5% so với giá trị tài sản ròng của quỹ đầu kỳ báo cáo tại ngày 31 tháng 03 năm 2022; Trong khi giá trị của danh mục của chứng khoán cơ cấu thay đổi là -16.8%, thay đổi của chỉ số tham chiếu là -16.8%.

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

Mục tiêu của Quỹ là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số tổng thu nhập VN30 (VN30-TRI) sau khi trừ đi chi phí của Quỹ. Chỉ số VN30-TRI là chỉ số tổng thu nhập (total return index) do Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh xây dựng và quản lý.

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 VN30-TRI 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 18 tháng 9 năm 2014.

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

Tại ngày 30 tháng 06 năm 2022, số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành là 365,500,000 và giá trị tài sản ròng của một đơn vị chứng chỉ quỹ là 21,076.64 Đồng Việt Nam.

1. **Chỉ số tham chiếu của Quỹ**

Chỉ số tham chiếu của Quỹ chỉ số tổng thu nhập VN30 (VN30-TRI).

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

Chính sách phân phối lợi nhuận của Quỹ sẽ được xem xét hàng năm và phụ thuộc vào kết quả hoạt động và quyết định của nhà đầu tư trong Đại hội Nhà Đầu tư.

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 | 30/06/2022 | 30/06/2021 | 30/06/2020 |
| Danh mục chứng khoán | 95.53% | 98.52% | 98.74% |
| Tài sản khác | 4.47% | 1.48% | 1.26% |
| Cộng | 100.00% | 100.00% | 100.00% |

1. **Chi tiết chỉ tiêu hoạt động**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Chỉ tiêu | 30/06/2022 | 30/06/2021 | 30/06/2020 |
| Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND) | 7,703,513,010,992 | 10,225,479,776,367 | 5,071,210,799,975 |
| Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND) | 365,500,000.00 | 397,700,000.00 | 394,700,000.00 |
| Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND) | 21,076.64 | 25,711.54 | 12,848.26 |
| Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,126.01 | 25,729.54 | 13,977.00 |
| Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 20,407.83 | 20,592.84 | 10,462.32 |
| Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND) | 21,350.00 | 25,840.00 | 13,300.00 |
| Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 26,100.00 | 25,840.00 | 14,140.00 |
| Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 20,600.00 | 20,600.00 | 10,380.00 |
| Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | -16.79% | 27.98% | 26.45% |
| Tăng trưởng vốn (%)/1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá) | -19.05% | 18.57% | 31.53% |
| Tăng trưởng thu nhập (%)/1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện) | 3.52% | 2.25% | 0.02% |
| Phân phối gộp trên 1 đơn vị CCQ (VND) | Không có | Không có | Không có |
| Phân phối ròng trên 1 đơn vị CCQ (VND) | Không có | Không có | Không có |
| Chỉ tiêu | 30/06/2022 | 30/06/2021 | 30/06/2020 |
| Ngày chốt quyền (Ex-date of distribution) | Không có | Không có | Không có |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%) | 1.13% | 0.97% | 0.90% |
| Tốc độ vòng quay danh mục (%) | 127.80% | 57.85% | 33.01% |

1. **Tăng trưởng qua các thời kỳ**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Giai đoạn** | **Tổng tăng trưởng của NAV/CCQ**  **(%)** | **Tăng trưởng NAV/CCQ hàng năm**  **(%)** |
| 1 năm | -18.0 | -18.0 |
| 3 năm | 47.0 | 13.7 |
| Từ khi thành lập | 110.8 | 9.9 |
| Tăng trưởng của chỉ số tham chiếu | N/A | N/A |

1. **Tăng trưởng hàng năm**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Thời kỳ** | **30-06-2022** | **30-06-2021** | **30-06-2020** | **30-06-2019** |
| Tỷ lệ tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | -18.0 | 100.1 | -10.4 | -7.9 |

1. **Mô tả thị trường trong kỳ**

VNINDEX giảm 7.4% trong tháng 6, ghi nhận tháng giảm thứ 3 liên tiếp. VNINDEX đóng cửa tại mức 1.197,6 điểm, giảm 20,1% so với đầu năm. Thanh khoản trung bình trong quý 2 là hơn 16,000 tỷ, giảm 35,6% so với quý 1.

Những điểm chính của thị trường trong QII.2022:

i. Thanh khoản giảm mạnh theo tâm lý tiêu cực của nhà đầu tư

ii. Nhóm ngành thực phẩm đứng vững trước xu hướng giảm của thị trường

iii. Các ngành như chứng khoán, bất động sản, thép tiếp tục giảm điểm

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 | 22.69% | 57.96% | 91.68% |
| Tăng trưởng Vốn/1 đơn vị CCQ | -40.72% | -10.98% | 19.09% |
| Tổng tăng trưởng/1 đơn vị CCQ | -18.03% | 46.98% | 110.77% |
| Tăng trưởng hàng năm(%)/1 đơn vị CCQ | -18.0% | 13.7% | 9.9% |
| Tăng trưởng của danh mục cơ cấu | -18.0% | 47.0% | 110.8% |
| Thay đổi giá trị thị trường của 1 đơn vị CCQ | -17.4% | 50.2% | 105.3% |

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

● Thay đổi giá trị tài sản ròng

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Chỉ tiêu | 30/06/2022 | 30/06/2021 | Tỷ lệ thay đổi |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ | 7,703,513,010,992 | 10,225,479,776,367 | -24.66% |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị CCQ | 21,076.64 | 25,711.54 | -18.03% |

Trong 12 tháng qua (từ ngày 30 tháng 06 năm 2021 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022), thị trường chứng khoán Việt Nam giảm mạnh và trong kỳ có sự rút vốn từ phía nhà đầu tư. Chính vì thế mà NAV có mức giảm lớn hơn mức giảm của NAV/CCQ

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 | 8,605 | 6,544,140.00 | 1.78% |
| Từ 5.000 đến 10.000 | 313 | 2,078,650.00 | 0.57% |
| Từ 10.000 đến 50.000 | 290 | 5,470,500.00 | 1.50% |
| Từ 50.000 đến 500.000 | 65 | 10,327,120.00 | 2.83% |
| Trên 500.000 | 35 | 341,079,590.00 | 93.32% |
| **Tổng cộng** | 9,308 | 365,500,000.00 | 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**

Tiếp đà phục hồi nền kinh tế Việt Nam đã tăng trưởng 7.7% trong Quý 2, mức cao nhất kể từ năm 2011. Nền kinh tế chứng kiến sự quay trở lại trong hầu hết các lĩnh vực và hoạt động đáng chú ý FDI vẫn tiếp tục tăng mạnh, thương mại khởi sắc và lạm phát vẫn ở trong mức kiểm soát. Với tăng trưởng 6 tháng đầu năm đã đạt 6.4%, nền tăng trưởng thấp trong nửa sau của năm ngoái, tăng trưởng kinh tế cả năm nay có thể đạt 7.0% trong kịch bản cơ sở và 8.3% trong kịch bản tốt.

**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 |
| Vũ Đức Sửu | Trưởng phòng quản lý danh mục đầu tư | Thạc sỹ Toán ứng dụng | - Từ 2010-2014: Chuyên viên đầu tư  2014- tháng 1/2016: Chuyên viên đầu tư cao cấp  - Từ tháng 1/2016 đến nay: Trưởng phòng quản lý danh mục đầu tư |
|  | | | | |
| 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 |
| Lê Thị Thu Hương | Thành viên | Cử nhân Kế toán – Kiểm toán | - Từ 2011 đến 2012: Phó giám đốc công ty TNHH kiểm toán AS  - Từ 2012 đến 2020: Phó Tổng giám đốc công ty TNHH kiểm toán Đại Tín.  - Từ 2020 đến nay: Sáng lập viên & Giám đốc Công ty TNHH kiểm toán Chuẩn Vàng. |
| Phạm Thị Thanh Thúy | Thành viên | Luật Sư | - Từ 2010 đến 01/01/2021: Trưởng phòng Pháp chế tuân thủ  - Từ 01/01/2021: đến nay là luật sư tư vấn nội bộ Công ty Cổ Phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam. |
|  | | | | |
| 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 Cổ Phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam |

TP.HCM, ngày 18 tháng 07 năm 2022

**Giám đốc điều hành Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư**

**NGUYỄN MINH ĐĂNG KHÁNH**