Phụ lục số 25

Nội dung Báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ

*(ban hành kèm theo Thông tư số 98/2020/TT-BTC ngày 16 tháng 11 năm 2020 của Bộ trưởng Bộ Tài chính)*

BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ

Bán niên năm 2022

1. Thông tin về quỹ

a) Tên quỹ: QUỸ ĐẦU TƯ TRÁI PHIẾU GIA TĂNG THU NHẬP CỐ ĐỊNH (DCIP)

*tiền thân là* *QUỸ ĐẦU TƯ ĐỊNH HƯỚNG BẢO TOÀN VỐN VIỆT NAM (VFMVFC)*

b) Mục tiêu đầu tư của quỹ:

Mục tiêu đầu tư của Quỹ phù hợp với Giấy chứng nhận đăng ký thành lập Quỹ do UBCKNN cấp. Quỹ DCIP tìm kiếm lợi nhuận từ việc đầu tư vào các loại chứng khoán nợ (bao gồm, nhưng không giới hạn, trái phiếu Chính phủ, trái phiếu được Chính phủ bảo lãnh, Trái phiếu chính quyền địa phương, Trái phiếu của các tổ chức phát hành hoạt động theo pháp luật Việt Nam…), giấy tờ có giá và các công cụ chứng khoán nợ khác. Chiến lược đầu tư của Quỹ DCIP là đầu tư vào các công cụ đầu tư có độ an toàn cao đồng thời hướng tới việc đáp ứng nhu cầu thanh khoản của nhà đầu tư có nhu cầu đầu tư trong khoảng thời gian từ 3 đến 12 tháng.

c) Thời hạn hoạt động của quỹ (nếu có): được tính từ ngày được UBCKNN cấp giấy chứng nhận đăng ký lập quỹ, và không giới hạn về thời hạn hoạt động

d) Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio) (nếu có): không có

e) Chính sách phân chia lợi nhuận: Quỹ DCIP sẽ không phân phối lợi nhuận

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Tổng số chứng chỉ Quỹ tại ngày 31/12/2021 | | 28,078,292.71 | ccq |
| Tổng số lượng chứng Quỹ phát hành thêm trong kỳ | | 11,510,740.66 | ccq |
| Tổng số lượng chứng Quỹ mua lại trong kỳ | | (3,327,379.03) | ccq |
| Tổng số lượng chứng chỉ Quỹ tại ngày 30/06/2022 | | 36,261,654.34 | ccq |
|  |

g) Nội dung thay đổi tại Điều lệ Quỹ trong kỳ báo cáo: được đề cập trong Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên năm tài chính 2021 của Quỹ Đầu tư Trái phiếu Gia tăng thu nhập cố định thông qua theo hình thức lấy ý kiến bằng văn bản ngày 06/04/2022 (chi tiết theo file đính kèm).



h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo: Nghị quyết Đại hội Nhà đầu tư thường niên năm tài chính 2021 của Quỹ Đầu tư Trái phiếu Gia tăng thu nhập cố định thông qua theo hình thức lấy ý kiến bằng văn bản ngày 06/04/2022 đã thông qua những thay đổi về điều lệ quỹ phù hợp với pháp luật…(chi tiết theo file đính kèm)



i) Ý kiến nhận xét của ngân hàng giám sát về các nội dung quy định tại Thông tư hướng dẫn về hoạt động và quản lý các quỹ đầu tư chứng khoán.

Chi tiết xin xem tại mục 4. Báo cáo hoạt động của ngân hàng giám sát

1. Báo cáo về kết quả hoạt động của quỹ
2. Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12 của 3 năm gần nhất (nếu có), cụ thể:

* Danh mục đầu tư của quỹ phân bố theo ngành, lĩnh vực và loại sản phẩm (cổ phiếu, trái phiếu...) *(không nêu chi tiết cả danh mục theo mã chứng khoán)*

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| STT | Chỉ tiêu | 30/06/2022 | | 30/06/2021 | | 30/06/2020 | |
| 1 | Cổ phiếu | - | - | 1,496,000 | 0.00% | 24,729,750 | 0.04% |
| 2 | Trái phiếu | 239,796,855,647 | 66.36% | 63,014,427,697 | 29.67% | 6,156,656,301 | 13.96% |
| 3 | Chứng chỉ tiền gửi | 51,240,497,485 | 14.18% | 83,321,979,450 | 39.23% | 7,951,541,097 | 18.02% |
| 4 | Tiền gửi ngân hàng | 70,247,903,462 | 19.44% | 65,500,000,000 | 30.84% | 11,000,000,000 | 24.92% |
| 5 | Tiền & Tài sản khác | 73,271,506 | 0.02% | 558,396,910 | 0.26% | 19,003,283,325 | 43.06% |
|  | Tổng cộng | 361,282,376,586 | 100.00% | 212,396,300,057 | 100% | 44,136,210,473 | 100.00% |

* Phân bổ tài sản theo ngành:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| STT | Ngành | 30/06/2022 | 30/06/2021 | 30/06/2020 |
| 1 | Ngân Hàng | - | 18.95% | 0.013% |
| 2 | Bất Động Sản | 10.05% | 24.96% | 7.00% |
| 3 | Bán Lẻ | 2.89% | - | - |
| 4 | Hàng Hoá Công Nghiệp | 4.27% | - | - |
| 5 | Phần Mềm & Dịch Vụ Phần Mềm | - | - | 0.014% |
| 6 | Vận tải | 16.30% | 0% | 0% |
| 7 | Vật Liệu | - | 0% | 7.15% |
| 8 | Ô tô & Phụ Tùng Ô tô | - | - | - |
| 9 | Dịch Vụ Tài Chính & Tài chính tiêu dùng | 28.38% | 39.16% | 17.50% |
| 10 | Xây dựng công trình kỹ thuật dân dụng | 18.65% | 4.74% | 0.02% |
| 11 | Tiền & các khoản tương đương tiền | 19.46% | 12.19% | 68.29% |
| 12 | Chứng khoán nợ | - | - | - |
| 13 | Dệt May & Thiết Bị Tiêu Dùng |  | 0% | 0.013% |
|  | Tổng | 100% | 100% | 100% |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Chỉ tiêu | 30/06/2022 | 30/06/2021 | | 30/06/2020 | |
|  |  |  | |  | |
|  |  |  | |  | |
| Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND) | 361,357,528,100 | 212,147,745,088 | | 43,930,664,612 | |
| Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND) | 36.261.654,34 | 22.732.273,59 | | 4.572.808,43 | |
| Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND) | 9.965,27 | 9.332,44 | | 9.604,74 | |
| Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 9.965,56 | 9.664,14 | | 10.487,49 | |
| Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 9.663,54 | 9.283,89 | | 9.553,65 | |
|  |  |  | |  | |
| Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND) | N/A | N/A | | N/A | |
| Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | N/A | N/A | | N/A | |
| Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | N/A | N/A | | N/A | |
| Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 3,12% | (3,53%) | | (6,93%) | |
| *Tăng trưởng vốn (%)/1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá)* | 0,48% | (3,83%) | | 2,44% | |
| *Tăng trưởng thu nhập (%)/1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện)* | 2,64% | 0,30% | | (9,37%) | |
| 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 | |
| Ngày chốt quyền (Ex-date of distribution) |  |  | |  | |
| Không có | Không có | | Không có | |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%) | 1.68% | 3,31% | | 3,42% | |
| Tốc độ vòng quay danh mục (%) | 108.40% | 247,19% | | 75,26% | |
|  |  | |  | |  | |

* Tổng lợi nhuận của quỹ :

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| STT | Chỉ tiêu | Số liệu |
| 1 | Lợi nhuận thu được từ sự tăng trưởng giá chứng khoán (giá trị lãi vốn) | -277,820,460 |
| 2 | Lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, chứng chỉ tiền gửi, lãi suất tiền gửi) | 11,334,995,109 |
| 3 | Lợi nhuận thu được từ bán cổ phiếu | 355,756,879 |
| 4 | Tổng chi phí | (2,452,091,672) |
| 5 | Lợi nhuận khác |  |
| 6 | Chi phí khác | - |
|  | Tổng lợi nhuận của quỹ | 8,960,839,856 |

* Lợi nhuận đã phân phối trên một đơn vị quỹ (giá trị thuần và giá trị gộp) trong kỳ báo cáo, kể cả trong trường hợp chi trả bằng tiền mặt hoặc chi trả bằng đơn vị quỹ; thời điểm phân chia lợi nhuận; giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ trước và sau thời điểm phân chia lợi nhuận: không có

b) Chỉ tiêu về lợi nhuận của quỹ:

|  |  |
| --- | --- |
| Tổng lợi nhuận bình quân năm của quỹ phát sinh trong kỳ báo cáo xác định: | |
| (i)trong thời hạn 12 tháng (1 năm) | 17,675,526,406 |
| (ii)trong thời hạn 36 tháng (3 năm) (\*) | 5,202,384,392 |
| (iii) trong thời hạn 60 tháng (5 năm) (\*) | 5,016,324,263 |

*(\*) Quỹ thành lập từ 03/04/2019*

c) Các chỉ tiêu so sánh khác, bảo đảm tuân thủ nguyên tắc:

* Phương thức, nguyên tắc xác định giá trị tài sản, giá trị lợi nhuận là thống nhất, đã được công bố và được thẩm định bởi một tổ chức độc lập khác;
* Dữ liệu được cung cấp bởi một tổ chức độc lập.

d) Thông tin về kết quả hoạt động của quỹ chỉ mang tính tham khảo và không có nghĩa là việc đầu tư sẽ bảo đảm khả năng sinh lời cho nhà đầu tư.

1. Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ

Báo cáo về hoạt động quản lý tài sản của Công ty quản lý quỹ phải bao gồm các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi công ty quản lý quỹ (nếu có): không có

b) Thuyết minh về việc quỹ có đạt được các mục tiêu đầu tư (thuyết minh này chỉ cần thiết tại báo cáo hàng năm của quỹ): *không áp dụng cho báo cáo bán niên*

c) So sánh kết quả lợi nhuận của quỹ với kết quả lợi nhuận của danh mục tham chiếu, chỉ số cơ sở công bố tại bản cáo bạch trong cùng kỳ báo cáo (bằng đồ thị): *Quỹ không áp dụng danh mục tham chiếu, chỉ số tham chiếu*.

d) So sánh kết quả lợi nhuận của quỹ với kết quả lợi nhuận của danh mục tham chiếu, chỉ số cơ sở công bố tại bản cáo bạch trong khoảng thời gian năm (05) năm gần nhất, tính tới ngày báo cáo (bằng đồ thị): *Quỹ không áp dụng danh mục tham chiếu, chỉ số tham chiếu.*

e) Mô tả chiến lược, chiến thuật đầu tư mà quỹ đã sử dụng trong kỳ báo cáo. Trường hợp có sự khác biệt giữa chiến lược, chiến thuật đầu tư thực hiện trong kỳ so với chiến lược, chiến thuật đầu tư đã công bố tại bản cáo bạch, thì phải bổ sung thuyết minh và đánh giá ưu, nhược điểm của chiến lược, chiến thuật đầu tư đã thực hiện trong kỳ: *Trong kỳ quỹ áp dụng chính xác các chiến lược, chiến thuật đầu tư như đã được công bố trong Bản cáo bạch*

Vào ngày 26/4/2021, Đại hội Nhà đầu tư thường niên năm tài chính lần 2 đã quyết định chuyển mục tiêu và chiến lược đầu tư từ danh mục đầu tư đa dạng sang danh mục đầu tư có tính bảo toàn cao, tập trung vào các công cụ chứng khoán nợ. Chiến lược đầu tư của Quỹ dựa trên cơ sở phân tích kinh tế vĩ mô, phân tích cơ bản về doanh nghiệp và áp dụng chiến lược phòng vệ rủi ro để đưa ra các quyết định đầu tư hướng tới mục tiêu bảo toàn vốn và gia tăng lợi nhuận cho danh mục. Quỹ DCIP sẽ phân bổ vào các loại tài sản bao gồm tiền gửi tại các ngân hàng thương mại, ngoại tệ, công cụ thị trường tiền tệ, trái phiếu Chính phủ, trái phiếu được Chính phủ bảo lãnh, trái phiếu chính quyền địa phương, cổ phiếu niêm yết và chuẩn bị niêm yết, cổ phiếu đăng ký giao dịch, trái phiếu niêm yết và chuẩn bị niêm yết, chuẩn bị đăng ký giao dịch phát hành bởi các tổ chức phát hành hoạt động theo pháp luật Việt Nam cùng các loại tài sản tài chính khác theo quy định của pháp luật.

f) Mô tả sự khác biệt về cơ cấu danh mục đầu tư của quỹ tại thời điểm báo cáo, so với danh mục đầu tư của quỹ năm liền kề năm báo cáo:

Về cơ cấu tài sản theo ngành (theo phân loại của GICS bậc 2): Quỹ nắm giữ 19.59% tiền mặt và tiền gửi ngân hàng. So với cùng kỳ năm trước, tại thời điểm báo cáo, quỹ đã gia tăng phân bổ đầu tư sang các công cụ nợ với ba loại tài sản chính là trái phiếu, chứng chỉ tiền gửi và tiền gửi ngân hàng; trong đó, trái phiếu chiếm tỷ trọng lớn nhất.

g) Phân tích kết quả hoạt động của quỹ dựa trên việc so sánh giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ (sau khi đã điều chỉnh phần lợi nhuận đã phân phối, nếu có) tại kỳ báo cáo này tại kỳ báo cáo gần nhất:

Trong giai đoạn 31/12/2021– 30/06/2022, NAV/ccq của DCIP tăng 3.12%, từ 9.663,41đ/CCQ lên 9.965,28đ/CCQ. Có nhiều nguyên nhân dẫn tới kết quả hoạt động của Quỹ. Thứ nhất, do thị trường chứng khoán sụt giảm mạnh từ vùng đỉnh tháng 4/2022 nên phần lớn dòng tiền đầu tư cổ phiếu từ các nhà đầu tư cá nhân đã dịch chuyển sang các kênh đầu tư an toàn hơn và có thu nhập lãi cố định như tiền gửi ngân hàng và các chứng chỉ quỹ trái phiếu, trong đó DCIP là quỹ đầu tư thu nhập cố định ngắn hạn có mức sinh lời cao hơn lãi suất tiền gửi kỳ hạn 3 tháng khoảng 1% và có cơ chế bán chứng chỉ quỹ rất linh hoạt trên cơ sơ hàng ngày . Do đó, trong khoảng thời gian 6 tháng đầu năm 2022, Quỹ đã ghi nhận sự gia tăng tiền mới khá đều đặn từ các nhà đầu tư. Nguyên nhân thứ hai là việc chuyển đổi chiến lược đầu tư của quỹ từ nhiều loại tài sản bao gồm cả cổ phiếu lẫn trái phiếu sang chỉ chuyên về trái phiếu và các công cụ nợ, điều này khiến quỹ chỉ tập trung vào việc tìm kiếm các trái phiếu doanh nghiệp niêm yết có chất lượng tín nhiệm cao với mức lãi suất tốt, đồng thời cũng cân đối tối ưu lượng tiền gửi để duy trì thanh khoản tốt cho quỹ khi. Sau 6 tháng đầu năm 2022 quỹ đã có tăng trưởng ổn định với mức trung bình khoảng 0.5% mỗi tháng. Tính từ ngày 24/05/2021 là thời điểm quỹ chính thức nhận được giấy chứng nhận từ Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước cho phép chuyển đổi tên thành “Quỹ Đầu Tư Trái Phiếu Gia Tăng Thu Nhập Cố Định DC”, đến 30/06/2022 Quỹ đã tăng 7.27%á biến động của các thị trường trong kỳ báo cáo, kể cả thị trường nước ngoài, mà quỹ được phép đầu tư vào, thông tin về lợi nhuận đầu tư đối với từng loại tài sản:

Trong tháng 6/2022, chỉ số sức mạnh đồng Đô La Mỹ DXY bật tăng trở lại mạnh từ mức 101,782 vào cuối tháng 5 lên 104,685 vào cuối tháng 6. Tỷ giá USD/VND tăng lên mức 23.270 vào cuối tháng 6, tiếp tục tăng thêm 0,47% so với cuối tháng 5. Tính từ đầu năm 2022, tỷ giá USD/VND đã tăng 2,23%, trái ngược với mức giảm 1,27% trong năm 2021. Tuy nhiên, nhìn chung mức tăng tỷ giá trong nước vẫn thấp hơn so với mức tăng của đồng USD trên thị trường quốc tế, nghĩa là VND đang tăng giá so với hầu hết các đồng tiền khác. Ví dụ như, so với đầu năm 2022, sức mạnh 1 đồng Euro của Châu Âu đã bị giảm 7,4% từ 1,1323 xuống 1,0482 USD, hoặc đồng Yên Nhật yếu đi 17,97% khi tỷ giá lên mức 135,73 JPY trên 1 USD so với mức 115,06 trước kia. Trong bối cảnh chung ấy, đường cong lãi suất trái phiếu chính phủ Mỹ dần phẳng hơn với mức tăng mạnh ở kỳ hạn ngắn dưới 1 năm trong khi lãi suất các kỳ hạn dài gần như không đổi. Lãi suất trái phiếu chính phủ Mỹ kỳ hạn ngắn nằm trong vùng 1,28-2,80%, trung hạn 5 năm ở mức 3,0% (tăng 0,2% so với cuối tháng trước). Kỳ hạn 10 năm ở mức 2,98%, tăng 0,13%. Trong khi đó, lãi suất kỳ hạn 20 và 30 năm tăng 0.10% và 0.07%. Trái phiếu chính phủ Thái Lan kỳ hạn 10 năm ở mức 2,90% (giảm nhẹ 0.06% so với cuối tháng trước).

Trong tháng 06/2022 lợi suất trái phiếu Chính Phủ Việt Nam (viết tắt: TPCP hay VGB) tiếp tục đà tăng với mức tăng 0.18% và 0,03% ở kỳ hạn 3 và 5 năm lên mức tương ứng 2,40% và 2,50%. Mức tăng này giảm đáng kể so với tháng 4 và tháng 5 khi hai kỳ hạn này tăng tương ứng từ 0.2% đến 0.41%. Tuy nhiên, mặt bằng lãi suất nhìn chung đã tăng nhiều so với mặt bằng lãi suất vào cuối năm 2021 khi các kỳ hạn này chỉ ở mức 0,83% và 0,94%. Các kỳ hạn dài có phản ứng chậm nhưng đã mạnh hơn trong hai tháng 5 và 6. Lãi suất VGB 10 năm tăng 0.12% lên mức 3,37% (+1,2% so với cuối năm 2021). VGB 15 năm cũng có mức tăng tương tự lên mức 3.59% trong tháng 6/2022.

Kế hoạch phát hành TPCP cho cả năm 2022 là 400 nghìn tỷ đồng. Trong đó, kế hoạch phát hành cho quý 2/2022 là 120 nghìn tỷ đồng, tập trung vào kỳ hạn 10 và 15 năm.

KBNN đã tổ chức 15 đợt đấu thầu TPCP trong tháng 6 và 88 đợt tính từ đầu năm 2022 với khối lượng phát hành tương ứng 15,27 và 69,09 nghìn tỷ. Trong khi đó, khối lượng gọi thầu tương ứng là 22,5 và 136 nghìn tỷ đồng. Tỷ lệ trúng thầu tương ứng 67,8% và 50,8%, tăng đáng kể so với mức gần 43% của tháng 05/2022 nhưng vẫn thấp hơn mức trung bình 72.9% của cả năm 2021. Với việc điều chỉnh lượng gọi thầu cho mỗi đợt đấu thầu và liên tục từ chối tăng lãi suất, KBNN đang cho thấy họ không gặp nhiều áp lực trong việc phát hành. Từ tháng 5/2022, KBNN cho phép lãi suất TPCP sơ cấp tăng khoảng 0,03-0,06% sau mỗi đợt phát hành, giúp tỷ lệ trúng thầu cải thiện đáng kể. Tỷ lệ trúng thầu cho kỳ hạn 10 và 15 năm tăng lên mức 42% và 53% so với mức 23-26% trong quý 1, nhưng vẫn cách rất xa so với mức 84% và 71% trong năm 2021. Nhìn chung lãi suất cung-cầu trên thị trường sơ cấp vẫn chưa gặp nhau và cho thấy thị trường vẫn khá yếu. Với bức tranh kinh tế vĩ mô nhìn chung khá tốt, lý do khiến thị trường trái phiếu không tốt hiện xuất phát từ quan ngại đối với xu hướng lạm phát, áp lực từ tỷ giá chung toàn cầu, sự gián đoạn trong thanh khoản từ thị trường trái phiếu doanh nghiệp và lãi suất huy động tăng. Tính đến cuối tháng 6, KBNN chỉ mới phát hành được 17% tổng lượng TPCP dự kiến phát hành trong năm 2022.

Trên thị trường thứ cấp, tổng lượng TPCP được giao dịch thỏa thuận là 97,7 nghìn tỷ đồng (tăng 28% so với tháng trước) và 61 nghìn tỷ đồng giao dịch qua hợp đồng repo (giảm 9% so với tháng trước). Giá trị giao dịch bình quân theo ngày của giao dịch thỏa thuận là 4,44 nghìn tỷ/ ngày, tăng 28% so với mức trung bình của tháng trước. Kỳ hạn được giao dịch phổ biến đối với giao dịch thỏa thuận là 5 đến 10 năm với giá trị 62,9 nghìn tỷ, tương đương 61% toàn thị trường.

TRÁI PHIẾU CHÍNH PHỦ - KHỐI LƯỢNG PHÁT HÀNH SƠ CẤP và KẾ HOẠCH PHÁT HÀNH



Thị trường Trái phiếu Doanh ngiệp

Theo dữ liệu tổng hợp từ các nguồn HNX và VBMA, trong tháng 6/2022 không có đợt trái phiếu doanh nghiệp (TPDN) nào được phát hành ra công chúng, 1 đợt phát hành trái phiếu quốc tế và 44 đợt phát hành riêng lẻ. Tổng giá trị phát hành trong tháng là 32,8 nghìn tỷ đồng (tăng 36% so với tháng trước). Đây là tín hiệu đáng mừng so với bức tranh ảm đạm trong tháng 4 khi chỉ có 16,5 nghìn tỷ tương ứng với 24 đợt phát hành riêng lẻ được phát hành được báo cáo vào cuối tháng. Tuy nhiên, không có sự đa dạng về đối tượng phát hành khi ngân hàng chiếm đến 89% tổng giá trị phát hành. Tỷ trọng tổ chức phát hành là công ty bất động sản tăng lên 4% so với mức 0% trong tháng 4/2022 và 28% trong tháng 5/2022. Dịch vụ lưu trú, tài chính và các ngành khác chiếm 7% còn lại. Kỳ hạn 3 là các kỳ hạn được lựa chọn trong tháng 6. Kỳ hạn trung bình giảm đáng kể, xuống mức 3,87 so với 5,24 năm 5/2022. Tác động từ sự kiện trái phiếu Tân Hoàng Minh đang dần lắng dịu so với tháng trước.

Tính từ đầu năm, có tổng cộng 259 TPDN được phát hành với tổng giá trị 180 nghìn tỷ đồng. Trong đó, 241 TPDN phát hành thông qua hình thức riêng lẻ, với giá trị 156 nghìn tỷ chiếm 87% tổng lượng TPDN được phát hành; 17 TPDN phát hành thông qua chào bán ra công chúng với tổng giá trị 8,99 nghìn tỷ, chiếm 5% tổng lượng TPDN được phát hành; 2 TPDN quốc tế do tập đoàn Vingroup phát hành với tổng giá trị 625 triệu USD, tương đương 8% tổng lượng TPDN được phát hành.

i) Thông tin về việc chia, tách đơn vị quỹ trong kỳ(nếu có); ảnh hưởng của việc chia tách đơn vị quỹ và giá trị tài sản ròng trên từng đơn vị quỹ (trước và sau khi chia, tách): không có

k) Các trường hợp có ảnh hưởng tới quyền lợi của cổ đông nắm giữ chứng chỉ quỹ: không có

m) Thông tin về các giao dịch với người có quyền lợi liên quan (nếu có).

1. Báo cáo về hoạt động giám sát của ngân hàng giám sát

Ngân hàng giám sát phải đưa ra ý kiến về sự tuân thủ quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch của Công ty Cổ phần Quản Lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam trong quá trình vận hành và quản lý Quỹ đầu tư Trái phiếu gia tăng thu nhập cố định DC (tiền thân là “Quỹ Đầu Tư Định Hướng Bảo Toàn Vốn Việt Nam”) (“DCIP” hoặc “Quỹ”) đối với các nội dung sau:

a) Thuyết minh về việc thay đổi ngân hàng giám sát (nếu có): từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ không thay đổi Ngân hàng giám sát.

b) Việc lưu ký tài sản của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ đã thực hiện lưu ký tài sản theo các quy định pháp luật hiện hành.

c) Việc đầu tư tuân thủ các hạn chế về đầu tư, hạn chế về vay theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch;

Trong quá trình giám sát hoạt động đầu tư và các giao dịch tài sản của Quỹ cho giai đoạn từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ đã tuân thủ các giới hạn về hạn mức đầu tư được quy định tại các văn bản pháp luật chứng khoán hiện hành về quỹ mở, Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ không có bất kỳ hợp đồng vay và cho vay.

d) Việc xác định giá trị tài sản ròng theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch: việc xác định giá trị tài sản ròng của Quỹ đã tuân thủ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch và các văn bản pháp luật có liên quan.

e) Việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch: việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ được tuân thủ theo quy định pháp luật liên quan hiện hành, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ đã thực hiện:

• Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: phát hành thêm 11.510.740,66 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 115.107.406.600 đồng.

• Mua lại chứng chỉ Quỹ: mua lại 3.327.379,03 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 33.273.790.300 đồng.

f) Việc phân chia lợi nhuận của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận cho nhà đầu tư.

5. Báo cáo về hoạt động ủy quyền (nếu có)

Công ty quản lý quỹ phải lập váo cáo đánh giá chất lượng dịch vụ cung cấp bởi các tổ chức khác (bên nhận ủy quyền), như dịch vụ đại lý chuyển nhượng, dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ xác định giá trị tài sản ròng... với các nội dung sau:

1. Chi phí phải trả cho bên nhận ủy quyền so với lợi nhuận, thu nhập, tổng chi phí hoạt động của quỹ :

|  |  |
| --- | --- |
| Chỉ tiêu | Tỷ lệ |
| Tỷ lệ chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng so với lợi nhuận (lỗ) | 0.74% |
| Tỷ lệ chi phí dịch vụ Quản trị Quỹ so với lợi nhuận (lỗ) | 2.50% |

1. Các ảnh hưởng (nếu có) của hoạt động ủy quyền tới lợi nhuận, mức độ rủi ro của quỹ: không có
2. Tổng chi phí các hoạt động ủy quyền phải trả cho bên nhận ủy quyền (trường hợp bên nhận ủy quyền cung cấp nhiều dịch vụ cho công ty quản lý quỹ):

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| STT | Chỉ tiêu | Số liệu |
| 1 | Chi phí dịch vụ Đại lý chuyển nhượng | 66,000,000 |
| 2 | Chi phí dịch vụ Quản trị Quỹ | 223,575,000 |
|  | Tổng cộng | 289,575,000 |

1. Đánh giá khả năng duy trì hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, tính bảo mật, hạ tầng cơ sở vật chất kỹ thuật, hệ thống dự phòng nóng, hệ thống dự phòng thảm hoạ.. của bên nhận ủy quyền, bảo đảm hoạt động ủy quyền được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của nhà đầu tư.

|  |  |
| --- | --- |
| Giám đốc điều hành Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư  Nguyễn Minh Đăng Khánh |  |