**BÁO CÁO CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ**

**Quý I năm 2023**

*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 **2.0 %** so với giá trị tài sản ròng của quỹ đầu kỳ báo cáo tại ngày 31 tháng 12 năm 2022; Trong khi giá trị của danh mục của chứng khoán cơ cấu thay đổi là 0.33%, thay đổi của chỉ số tham chiếu là -0.20%.

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 2023, số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành là 823,200,000 ccq và giá trị tài sản ròng của một đơn vị chứng chỉ quỹ là 22,406.40 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** | **31/03/2023** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Danh mục chứng khoán | 99.37% | 98.80% | 98.51% |
| Tài sản khác | 0.63% | 1.20% | 1.49% |
| **Cộng** | **100.00%** | **100.00%** | **100.00%** |

1. **Chi tiết chỉ tiêu hoạt động**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **31/03/2023** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Giá trị tài sản ròng của Quỹ (VND) | 18,444,953,668,093 | 15,486,009,740,868 | 9,799,077,340,633 |
| Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành (VND) | 823,200,000 | 517,700,000 | 493,900,000.00 |
| Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ) (VND) | 22,406.40 | 29,913.09 | 19,840.20 |
| Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 24,413.86 | 29,913.09 | 20,410.40 |
| Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 21,759.12 | 26,614.29 | 16,585.33 |
| Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo (VND) | 22,470 | 30,080 | 19,890 |
| Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 24,460 | 30,080 | 20,420 |
| Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo (VND) | 21,700 | 26,690 | 16,740 |
| Tổng tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | 0.33% | 6.23% | N/A |
| *Tăng trưởng vốn (%)/1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá)* | -0.04% | 3.45% | N/A |
| *Tăng trưởng thu nhập (%)/1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện)* | 0.36% | 2.79% | N/A |
| 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 (%) | 1.04% | 1.06% | 1.03% |
| Tốc độ vòng quay danh mục (%) | 25.20% | 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 | -25.10 | -25.10 |
| 3 năm | N/A | N/A |
| Từ khi thành lập | 124.06 | 30.62 |
| Tăng trưởng của chỉ số tham chiếu | N/A | N/A |

1. **Tăng trưởng hàng năm**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Thời kỳ** | **31/03/2023** | **31/03/2022** | **31/03/2021** |
| Tỷ lệ tăng trưởng (%)/1 đơn vị CCQ | -25.10 | 50.77 | 98.40 |

1. **Mô tả thị trường trong kỳ**

VNINDEX tăng 3.9% trong tháng 3, đóng cửa tại mức 1,064.64 điểm, tăng 5.7% so với đầu năm. Thanh khoản trung bình trong quý 1 là hơn 8,471 tỷ đồng, giảm 19.1% so với quý 4.

Những điểm chính của thị trường trong Q1/2023:

i. Nhà đầu tư nước ngoài mua ròng 117 triệu USD (2,749 tỷ đồng)

ii. Điều chỉnh lãi suất tác động tích cực tới tâm lý thị trường

iii. Chính sách vĩ mô tạo tâm lý vững vàng hơn cho thị trường.

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 | 3.57% | #DIV/0! | 40.06% |
| Tăng trưởng Vốn/1 đơn vị CCQ | -28.66% | #DIV/0! | 84.01% |
| Tổng tăng trưởng/1 đơn vị CCQ | -25.10% | #DIV/0! | 124.06% |
| Tăng trưởng hàng năm(%)/1 đơn vị CCQ | -25.10% | N/A | 30.62% |
| Tăng trưởng của danh mục cơ cấu | -25.10% | N/A | 124.06% |
| Thay đổi giá trị thị trường của 1 đơn vị CCQ | 25.30% | N/A | 114.00% |

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

● Thay đổi giá trị tài sản ròng

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **31/03/2023** | **31/03/2022** | **Tỷ lệ thay đổi** |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ | 18,444,953,668,093 | 15,486,009,740,868 | 19.11% |
| Giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị CCQ | 22,406.40 | 29,913.09 | -25.10% |

Từ 31/12/2022 đến 31/03/2023, thị trường chứng khoán Việt Nam giảm mạnh nhưng Quỹ ETF DCVFMVND được sự quan tâm và góp vốn của nhà đầu tư 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 | 4,801 | 4,682,674 | 0.57% |
| Từ 5.000 đến 10.000 | 380 | 2,692,488 | 0.33% |
| Từ 10.000 đến 50.000 | 281 | 5,777,826 | 0.70% |
| Từ 50.000 đến 500.000 | 112 | 18,239,780 | 2.22% |
| Trên 500.000 | 67 | 791,807,232 | 96.19% |
| **Tổng cộng** | 5,641 | 823,200,000 | 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 đối mặt với nhiều thách thức trong quý đầu tiên của năm 2023, tăng trưởng GDP đạt 3,3%; chỉ cao hơn mức 3,2% ghi nhận tại Quý 1 năm Covid 2020 trong 10 năm qua. Ngành công nghiệp giảm 0,8% và chỉ số sản xuất công nghiệp (IIP) giảm 2,2% so với cùng kỳ. Ngành dịch vụ lại trở thành điểm sáng của kinh tế với doanh số bán lẻ tăng 13,9% trong Quý 1, và tổng lượng khách quốc tế đạt 2,7 triệu, tương đương 60% giai đoạn trước Covid. Hoạt động thương mại tiếp tục chậm lại, xuất khẩu tháng 3 giảm 14,8% và Quý 1 giảm 11,9% so với cùng kỳ. Chỉ số hàng tồn kho tăng mạnh 19,8% trong quý 1 với nguyên nhân đến từ sự suy yếu của nhu cầu tiêu dùng toàn cầu. Số liệu mới nhất về GDP cho thấy kế hoạch đạt mục tiêu 6.0% đến 6.5% có thể gặp nhiều trở ngại. Do đó, Chính phủ đang hết sức nỗ lực đưa ra các phương án điều hành nhằm đạt được mục tiêu về tăng trưởng kinh tế. Trong 2 ngày Chủ nhật đầu tháng 3, Chính phủ đã ban hành 2 Nghị định nhằm tháo gỡ các vướng mắc của thị trường trái phiếu và hỗ trợ thị trường bất động sản. Cơ quan quản lý cũng đã dự thảo thông tư cho phép các ngân hàng thương mại mua lại trái phiếu doanh nghiệp đã bán đi trong vòng 12 tháng, đồng thời thảo luận về các biện pháp xử lý phù hợp cho các doanh nghiệp bất động sản khó khăn, như giãn nợ gốc, lãi vay, cơ cấu lại nhóm nợ.

**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 năm 2010 đến ngày 12/3/2021: Phó Tổng Giám đốc – Khối đầu tư nghiên cứu Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư Việt Nam   - Từ ngày 12/3/2021 đến nay: 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 giải tích và ứng dụng  Thạc sỹ Lý thuyết xác suất và thống kê toán học. | * Từ năm 2010 đến năm 2015: Chuyên viên cao cấp phân tích đầu tư Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư Việt Nam * Từ năm 2016 đến năm 2020: Trưởng phòng quản lý danh mục đầu tư Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ đầu tư Việt Nam   -Từ tháng 1/2021 đến nay Trưởng phòng quản lý danh mục đầu tư 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 năm 2010 đến năm 2012: Trưởng phòng giao dịch chứng khoán Công ty Cổ phần Chứng khoán Dầu khí   -Từ năm 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 | - Từ tháng 8/2004 đến tháng 11/2007: Kế toán trưởng Công ty TNHH Minh Thắng  - Từ tháng 12/2007 đến tháng 4/2012: Kiểm toán viên, Trưởng phòng Kiểm toán Công ty Kiểm toán AS  - Từ tháng 9/2012 đến tháng 5/2013: Kiểm toán viên, Giám đốc Kiểm toán Công ty Hợp danh Kiểm toán F&A   * Từ năm 2013 đến tháng 9/2016: Kiểm toán viên, Giám đốc Kiểm toán Công ty Kiểm toán Đại Tín. * Từ tháng 10/2016 đến tháng 8/2019: Kiểm toán viên, Giám đốc Kiểm toán - Chi nhánh Công ty TNHH Kiểm toán Đại Tín.   -Từ tháng 9/2019 đến nay: Giám đốc nghiệp vụ Công ty TNHH Kiểm toán Chuẩn Vàng |
| Trần Ngọc Hân | Thành viên | Thạc sỹ Luật, Luật Sư | Từ năm 2015 đến nay: Chuyên viên cao cấp Pháp chế tuân thủ 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 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