

PHỤ LỤC XXVIII

MẪU THÔNG BÁO VỀ VIỆC SỬA ĐỔI, BỔ SUNG ĐIỀU LỆ
(Ban hành kèm theo Thông tư số 98/2020/TT-BTC ngày 16 tháng 11 năm 2020 của Bộ trưởng Bộ Tài chính)

**CÔNG TY CỔ PHẦN QUẢN LÝ
QUỸ ĐẦU TƯ DRAGON CAPITAL
VIỆT NAM (DCVFM)**

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Số: 08BCB8 - DCVFM

TP HCM, ngày 11 tháng 09 năm 2023

THÔNG BÁO

Về việc sửa đổi, bổ sung Điều lệ/Bản cáo bạch của quỹ đầu tư chứng khoán/công ty đầu tư chứng khoán

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

Chúng tôi báo cáo Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc sửa đổi, bổ sung Bản cáo bạch của Quỹ ETF DCVFMVN30 như sau:

STT	Khoản mục, điều của Điều lệ/Bản cáo bạch cũ	Khoản mục, điều của Điều lệ/Bản cáo bạch mới	Lý do sửa đổi, bổ sung
1	- Tổ chức phát hành - Ông NGUYỄN MINH ĐĂNG KHÁNH – Giám đốc điều hành nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư	- Công ty quản lý quỹ - Ông LÊ HOÀNG ANH – Giám đốc chi nhánh Hà Nội kiêm Quyền Giám đốc, Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư	Cập nhật thông tin
2		Mục lục cập nhật mới	Cập nhật thông tin
I. NHỮNG NGƯỜI CHỊU TRÁCH NHIỆM CHÍNH ĐỐI VỚI NỘI DUNG BẢN CÁO BẠCH			
3	1. Tổ chức phát hành ... Giấy phép sửa đổi số: 88/GPĐC-UBCK do UBCKNN cấp ngày 30/12/2020	1. Công ty quản lý quỹ ... Giấy phép điều chỉnh đổi số: 88/GPĐC-UBCK do UBCKNN cấp ngày 30/12/2020	Cập nhật thông tin
4		Cập nhật địa chỉ NHGS Và chi nhánh tại: Tầng 24, Tháp 1, Tòa nhà Capital Place, 29 Liễu Giai, Phường Ngọc Khánh, Quận Ba Đình, Hà Nội, Việt Nam. Điện thoại: (84-24) 3942 8168 Fax: (84-24) 3942 8169	
II. CÁC THUẬT NGỮ/ĐỊNH NGHĨA			
5	"Công ty Quản lý Quỹ": Nghĩa là Công ty Cổ Phần Quản lý quỹ Đầu tư Dragon Capital Dragon Capital Việt Nam (Sau đây gọi tắt là Công ty quản lý quỹ DCVFM), được thành lập theo Giấy phép số 45/UBCK-GP ngày 08/01/2009 của UBCKNN, Giấy phép điều chỉnh số 88/GPĐC-UBCK ngày 30/12/2020 của UBCKNN, với lĩnh vực hoạt động là quản lý quỹ đầu tư chứng khoán, công ty đầu tư chứng khoán, quản lý danh mục đầu tư chứng khoán và tư vấn đầu tư chứng	" Công ty Quản lý Quỹ ": Nghĩa là Công ty Cổ Phần Quản lý quỹ Đầu tư Dragon Capital Dragon Capital Việt Nam (Sau đây gọi tắt là Công ty quản lý quỹ DCVFM), được thành lập theo Giấy phép số 45/UBCK-GP ngày 08/01/2009 của UBCKNN, Giấy phép điều chỉnh số 88/GPĐC-UBCK ngày 30/12/2020 của UBCKNN, với lĩnh vực hoạt động là quản lý quỹ đầu tư chứng khoán, công ty đầu tư chứng khoán, quản lý danh mục đầu tư	Cập nhật thuật ngữ/định nghĩa

<p>khoán. Công ty quản lý quỹ DCVFM là công ty thực hiện huy động vốn và quản lý Quỹ DCVFMVN30.</p> <p>“Ngân hàng giám sát”: (Sau đây gọi tắt là ngân hàng giám sát) là Ngân hàng TNHH Một thành viên Standard Chartered (Việt Nam), một ngân hàng thương mại được thành lập hợp pháp theo pháp luật Việt Nam, theo Giấy phép thành lập Giấy Phép Thành Lập và Hoạt Động số 236/GP-NHNN do Ngân Hàng Nhà Nước Việt Nam cấp ngày 8 tháng 9 năm 2008 (như được sửa đổi vào từng thời điểm) và được cấp Giấy chứng nhận đăng ký hoạt động lưu ký chứng khoán số 08/GCN-UBCK do Ủy Ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 07/05/2015, thực hiện các nghiệp vụ: bảo quản, lưu ký các chứng khoán, các hợp đồng kinh tế, các chứng từ có liên quan đến tài sản của Quỹ ETF DCVFMVN30, đồng thời giám sát hoạt động của Quỹ. Quyền và nghĩa vụ của Ngân hàng giám sát được quy định tại Chương VII của Điều lệ quỹ.</p> <p>“Đại lý phân phối”: Là các công ty chứng khoán có nghiệp vụ môi giới chứng khoán đã có Giấy chứng nhận đăng ký hoạt động phân phối chứng chỉ quỹ đại chúng ký hợp đồng phân phối chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>ETF DCVFMVN30 với Công ty quản lý quỹ và Thành viên lập quỹ.</p> <p>“Điều lệ quỹ”: Bao gồm điều lệ quỹ, các Phụ lục đính kèm và các sửa đổi bổ sung hợp pháp (nếu có).. Thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đăng ký mua chứng chỉ quỹ ETF được coi là đã thông qua Điều lệ quỹ lần đầu.</p> <p>“Bản cáo bạch”: Là tài liệu hoặc dữ liệu điện tử công khai những thông tin chính xác, trung thực, khách quan liên quan đến việc chào bán chứng chỉ quỹ, công ty quản lý quỹ và các tổ chức có liên quan của Quỹ.</p> <p>“Chỉ số tổng thu nhập VN30” (VN30-TRI): Là chỉ số theo quy mô vốn hóa, gồm 30 công ty niêm yết trên Sở Giao dịch chứng khoán TP. HCM có giá trị vốn hóa và thanh khoản lớn hàng đầu, đáp ứng tư cách tham gia vào bộ chỉ số và các điều kiện sàng lọc theo quy định. Chỉ số này thể hiện biến động giá và giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành phần được tính toán để tái đầu tư vào chỉ số VN30 và được ký hiệu VN30-TRI (VN30 – Total Return Index). Danh mục chỉ số tổng thu nhập VN30 chính là danh mục chỉ số giá</p>	<p>chứng khoán và tư vấn đầu tư chứng khoán. Công ty quản lý quỹ DCVFM được nhà đầu tư uỷ thác quản lý quỹ, có quyền và nghĩa vụ theo quy định tại Chương VI của Điều lệ Quỹ</p> <p>“Ngân hàng giám sát”: Là Ngân hàng TNHH Một Thành Viên Standard Chartered (Việt Nam) (Sau đây gọi tắt là ngân hàng Standard Chartered) Là Ngân Hàng 100% vốn nước ngoài, thành lập theo Giấy phép thành lập và hoạt động số 236/GP-NHNN do Ngân hàng Nhà nước Việt Nam cấp ngày 08 tháng 09 năm 2008, Quyết định số 1477/QĐ-NHNN do Ngân hàng Nhà nước Việt Nam cấp ngày 25 tháng 08 năm 2022 về việc bổ sung nội dung hoạt động vào Giấy phép thành lập và hoạt động Ngân hàng TNHH MTV Standard Chartered (Việt Nam) và Giấy chứng nhận đăng ký hoạt động lưu ký chứng khoán số 08/GCN-UBCK do UBCKNN cấp ngày 07/05/2015, thực hiện các nghiệp vụ: bảo quản, lưu ký các chứng khoán, các hợp đồng kinh tế, các chứng từ có liên quan đến tài sản của Quỹ, đồng thời giám sát hoạt động của Quỹ,.. Quyền và nghĩa vụ của Ngân hàng giám sát được quy định tại Chương VII của Điều lệ quỹ.</p> <p>“Đại lý phân phối”: Là các công ty chứng khoán có nghiệp vụ môi giới chứng khoán đã có Giấy chứng nhận đăng ký hoạt động phân phối chứng chỉ quỹ đại chúng ký hợp đồng phân phối chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30 với Công ty quản lý quỹ và Thành viên lập quỹ.</p> <p>“Điều lệ quỹ”: Bao gồm điều lệ quỹ ETF DCVFMVN30, các Phụ lục đính kèm và các sửa đổi bổ sung hợp pháp (nếu có).</p> <p>“Bản cáo bạch”: Là tài liệu hoặc dữ liệu điện tử công khai những thông tin chính xác, trung thực, khách quan liên quan đến việc chào bán và phát hành chứng chỉ quỹ của Quỹ.</p> <p>“Chỉ số tham chiếu/ Chỉ số VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập)”: Là chỉ số do Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM xây dựng và quản lý bao gồm 30 công ty niêm yết trên Sở Giao dịch chứng khoán TP. HCM có giá trị vốn hóa và thanh khoản lớn hàng đầu, đáp ứng tư cách tham gia vào bộ chỉ số và các điều kiện sàng lọc theo quy định. Chỉ số VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập) thể hiện biến động giá và giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành</p>	
---	---	--

<p>VN30 và chỉ khác chỉ số giá VN30 ở việc tính giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành phần trong chỉ số. Thông tin chi tiết của chỉ số này tham khảo tại trang thông tin điện tử của HOSE.</p> <p>“Chứng khoán cơ cấu”: Là chứng khoán cơ sở cấu thành danh mục chứng khoán của Chỉ số VN30-TRI không bao gồm chứng khoán phái sinh.</p> <p>“Danh mục chứng khoán cơ cấu”: Là danh mục bao gồm các chứng khoán cơ cấu được thiết kế nhằm mô phỏng biến động của chỉ số tham chiếu và được Công ty quản lý quỹ DCVFM chấp nhận trong giao dịch hoán đổi lấy lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30. Danh mục chứng khoán cơ cấu trong giao dịch hoán đổi phải đáp ứng đầy đủ các điều kiện sau: Bao gồm tối thiểu 50% số chứng khoán cơ sở hình thành chỉ số VN30-TRI (danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu). Giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu không thấp hơn 95% giá trị của danh mục chứng khoán tương ứng của chỉ số VN30-TRI.</p> <p>“Giá phát hành lần đầu”: Là mức giá mà Công ty quản lý quỹ dùng làm cơ sở thực hiện việc phân phối các lô chứng chỉ quỹ cho Thành viên lập quỹ, nhà đầu tư để thu lại danh mục chứng khoán cơ cấu. Giá phát hành lần đầu bằng tổng mệnh giá của một lô chứng chỉ quỹ (trong đợt chào bán lần đầu ra công chúng) cộng thêm giá dịch vụ phát hành quy định tại bản cáo bạch này.</p> <p>“Giá dịch vụ phát hành”: Là giá dịch vụ mà Thành viên lập quỹ, nhà đầu tư phải trả cho Công ty quản lý quỹ khi mua các lô chứng chỉ quỹ trong đợt phát hành lần đầu ra công chúng hoặc thực hiện giao dịch hoán đổi danh mục chứng khoán cơ cấu lấy các lô chứng chỉ quỹ. Giá dịch vụ này được thu khi thực hiện giao dịch và được tính theo tỷ lệ phần trăm trên giá trị giao dịch của các lô chứng chỉ quỹ. Giá dịch vụ phát hành này sẽ được quy định tại bản cáo bạch này.</p> <p>“Năm tài chính”: Là mười hai tháng tính từ đầu ngày 01 tháng 01 đến hết ngày 31 tháng 12 năm dương lịch hàng năm. Năm tài chính đầu tiên của Quỹ ETF DCVFMDCVFMVN30 sẽ được tính từ ngày Quỹ ETF DCVFMDCVFMVN30 được Ủy</p>	<p>phần. Thông tin chi tiết của chỉ số này tham khảo tại trang thông tin điện tử của HOSE.</p> <p>“Chứng khoán cơ cấu”: Là chứng khoán cơ sở cấu thành danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu không bao gồm chứng khoán phái sinh.</p> <p>“Danh mục chứng khoán cơ cấu”: Là danh mục bao gồm các chứng khoán cơ cấu được thiết kế nhằm mô phỏng biến động của chỉ số tham chiếu và được Công ty quản lý quỹ DCVFM chấp nhận trong giao dịch hoán đổi lấy lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30. Danh mục chứng khoán cơ cấu trong giao dịch hoán đổi phải đáp ứng đầy đủ các điều kiện sau: Bao gồm tối thiểu 50% số chứng khoán cơ sở hình thành chỉ số tham chiếu (danh mục chứng khoán của chỉ số tham chiếu). Giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu chứng khoán tương ứng của chỉ số tham chiếu.</p> <p>“Giá phát hành lần đầu”: Là mức giá mà Công ty quản lý quỹ dùng làm cơ sở thực hiện việc phân phối các lô chứng chỉ quỹ cho Thành viên lập quỹ, nhà đầu tư để thu lại danh mục chứng khoán cơ cấu. Giá phát hành lần đầu bằng tổng mệnh giá của một lô chứng chỉ quỹ (trong đợt chào bán lần đầu ra công chúng) cộng thêm giá dịch vụ phát hành quy định tại bản cáo bạch này và Điều lệ Quỹ.</p> <p>“Giá dịch vụ phát hành”: Là giá dịch vụ mà Thành viên lập quỹ, nhà đầu tư phải trả cho Công ty quản lý quỹ khi mua các lô chứng chỉ quỹ trong đợt phát hành lần đầu ra công chúng hoặc thực hiện giao dịch hoán đổi danh mục chứng khoán cơ cấu lấy các lô chứng chỉ quỹ. Giá dịch vụ này được thu khi thực hiện giao dịch và được tính theo tỷ lệ phần trăm trên giá trị giao dịch của các lô chứng chỉ quỹ. Giá dịch vụ phát hành này sẽ được quy định tại bản cáo bạch này và Điều lệ Quỹ.</p> <p>“Năm tài chính”: Là mười hai tháng tính từ đầu ngày 01 tháng 01 đến hết ngày 31 tháng 12 năm dương lịch hàng năm. Năm tài chính đầu tiên của Quỹ ETF DCVFMDCVFMVN30 được tính từ ngày Quỹ ETF DCVFMDCVFMVN30 được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp Giấy</p>	
---	--	--

<p>ban Chứng khoán Nhà nước cấp Giấy chứng nhận đăng ký lập quỹ cho đến hết ngày 31 tháng 12 của năm đó.</p> <p>“Giá trị tài sản ròng của quỹ”: Là tổng giá trị thị trường các tài sản có trong danh mục trừ đi tổng nợ phải trả của quỹ tại ngày gần nhất trước ngày định giá.. Công ty quản lý quỹ có trách nhiệm hàng ngày xác định giá trị tài sản ròng của quỹ ETF DCVFMDCVFMVN30.</p> <p>“Dịch vụ quản trị quỹ đầu tư”: Là dịch vụ được Công ty quản lý quỹ DCVFM ủy quyền cho tổ chức cung cấp dịch vụ có liên quan cung cấp, bao gồm các hoạt động sau:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ghi nhận kế toán các giao dịch của Quỹ; ghi nhận biến động phản ánh dòng tiền ra, vào quỹ; - Lập báo cáo tài chính quỹ; phối hợp, hỗ trợ tổ chức kiểm toán của quỹ trong việc thực hiện kiểm toán cho quỹ; - Xác định giá trị tài sản ròng của quỹ, giá trị tài sản ròng trên một lô chứng chỉ quỹ, giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ quỹ theo quy định của pháp luật và Điều lệ quỹ; - Thực hiện các hoạt động khác theo quy định của pháp luật, Điều lệ quỹ và Hợp đồng đã ký với Công ty quản lý quỹ DCVFM; <p>”Trung tâm Lưu ký chứng khoán Việt Nam”</p>	<p>chứng nhận đăng ký lập quỹ cho đến hết ngày 31 tháng 12 của năm đó.</p> <p>“Giá trị tài sản ròng của quỹ”: Là tổng giá trị các tài sản và các khoản đầu tư do Quỹ sở hữu trừ đi các nghĩa vụ nợ của quỹ tại ngày gần nhất trước ngày định giá.</p> <p>“Dịch vụ quản trị quỹ đầu tư”: Là dịch vụ được Công ty quản lý quỹ DCVFM ủy quyền cho tổ chức cung cấp dịch vụ có liên quan cung cấp, bao gồm các hoạt động sau:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ghi nhận kế toán các giao dịch của Quỹ; ghi nhận biến động phản ánh dòng tiền ra, vào quỹ; - Lập báo cáo tài chính quỹ; phối hợp, hỗ trợ tổ chức kiểm toán của quỹ trong việc thực hiện kiểm toán cho quỹ; - Xác định giá trị tài sản ròng của quỹ, giá trị tài sản ròng trên một lô chứng chỉ quỹ, giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ quỹ theo quy định của pháp luật và Điều lệ quỹ; - Thực hiện các hoạt động khác theo quy định của pháp luật, Điều lệ quỹ và Hợp đồng dịch vụ quản trị quỹ đã ký với Công ty quản lý quỹ DCVFM; <p>“Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam”</p>	
---	---	--

III. TRIỂN VỌNG, CƠ HỘI ĐẦU TƯ

<p>6</p>	<p>2. Giới thiệu Chỉ số VN30-TRI</p> <p>Chỉ số tổng thu nhập VN30 là chỉ số thể hiện biến động giá và giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành phần được tính toán để tái đầu tư vào chỉ số VN30 và được ký hiệu VN30-TRI (VN30 – Total Return Index). Chỉ số VN30 là chỉ số bao gồm 30 công ty có giá trị vốn hoá và thanh khoản hàng đầu niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HOSE) đáp ứng tư cách tham gia vào chỉ số và các điều kiện sàng lọc theo quy định. Trong đó tư cách tham gia vào chỉ số bao gồm những tiêu chí như sau:</p> <p>Tiêu chí về niêm yết:</p> <p>Cổ phiếu không thuộc một trong các diện sau đây:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu thuộc diện bị cảnh báo do vi phạm công bố thông tin, diện bị kiểm soát, diện tạm ngưng giao dịch trong vòng 03 tháng tính đến thời điểm xem xét. - Cổ phiếu có thời gian niêm yết trên HOSE dưới 06 tháng tính đến thời điểm xem xét. 	<p>2. Giới thiệu Chỉ số tham chiếu</p> <p>Chỉ số VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập) là chỉ số thể hiện biến động giá và giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành phần được tính toán để tái đầu tư vào chỉ số VN30 (theo phương pháp chỉ số giá). Chỉ số VN30 là bao gồm 30 công ty có giá trị vốn hoá và thanh khoản hàng đầu niêm yết trên Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HOSE) đáp ứng tư cách tham gia vào chỉ số và các điều kiện sàng lọc theo quy định. Trong đó tư cách tham gia vào chỉ số bao gồm những tiêu chí như sau:</p> <p>Tiêu chí về niêm yết:</p> <p>Cổ phiếu không thuộc một trong các diện sau đây:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu thuộc diện bị cảnh báo do vi phạm công bố thông tin, diện bị kiểm soát, diện kiểm soát đặc biệt, diện tạm ngưng giao dịch (ngoại trừ tạm ngưng giao dịch do các sự kiện doanh nghiệp như tách/gộp 	<p>Cập nhật thông tin</p>
-----------------	--	--	---------------------------

<p>Đối với cổ phiếu có giá trị vốn hóa hàng ngày bình quân thuộc nhóm 05 công ty lớn nhất (top-5) thì thời gian niêm yết dưới 03 tháng.</p> <p>Tiêu chí về tỷ lệ tự do chuyển nhượng (free-float): Cổ phiếu được tham gia vào chỉ số khi tỷ lệ tự do chuyển nhượng của cổ phiếu lớn hơn 10%. Cụ thể :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Nếu tỷ lệ tự do chuyển nhượng lớn hơn 10% : đáp ứng điều kiện tham gia vào Bộ chỉ số. - Nếu tỷ lệ tự do chuyển nhượng nhỏ hơn hoặc bằng 10% : loại khỏi Bộ chỉ số, ngoại trừ cổ phiếu có giá trị vốn hóa điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng (GTVHFF) lớn hơn trung vị của tập hợp 90% GTVHFF của cả rổ cổ phiếu đáp ứng tiêu chí niêm yết. <p>Tiêu chí về thanh khoản: Cổ phiếu tham gia vào chỉ số VN30 đảm bảo thanh khoản bằng cách tính toán tỷ suất quay vòng chứng khoán (turnover ratio) như sau:</p> <p style="text-align: center;"> <small>Tỷ suất quay vòng chứng khoán = $\frac{\text{Giá trị giao dịch hàng ngày bình quân trong kỳ xem xét (*)}}{\text{Giá trị vốn hóa hàng ngày bình quân sau điều chỉnh free float trong kỳ xem xét}}$</small> </p> <p>(*) Giá trị giao dịch hàng ngày bình quân bao gồm cả giao dịch khớp lệnh và thỏa thuận</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu không thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng nhỏ hơn 0,05% sẽ bị loại. - Cổ phiếu thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng nhỏ hơn 0,04% sẽ bị loại khỏi. <p>Tập hợp các cổ phiếu đáp ứng các tiêu chí về niêm yết, về tỷ lệ tự do chuyển nhượng và về thanh khoản gọi là danh sách sẽ được sắp xếp theo thứ tự giảm dần về giá trị vốn hóa hàng ngày bình quân trong 12 tháng chưa điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng.</p> <p>Bước 1: Lấy các cổ phiếu thuộc tập hợp 90% giá trị giao dịch tích lũy của rổ VNAllshare. Nếu tập hợp không đủ 50 cổ phiếu thì lấy cổ phiếu kế tiếp trong danh sách theo giá trị giao dịch từ cao xuống thấp sao cho đủ 50 cổ phiếu.</p> <p>Bước 2: Sắp xếp các cổ phiếu được chọn theo thứ tự giảm dần về giá trị vốn hóa:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu đứng ở vị trí thứ 20 trở lên đương nhiên có mặt trong chỉ số; - Cổ phiếu đứng ở vị trí thứ 41 trở xuống đương nhiên bị loại khỏi chỉ số; - Cổ phiếu đứng ở vị trí 21 đến 40: ưu tiên cổ phiếu đã có trong danh mục cổ phiếu 	<p>cổ phiếu, chia tách/sáp nhập... dưới 30 ngày giao dịch) trong vòng 03 tháng tính đến thời điểm xem xét.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu có thời gian niêm yết trên HOSE dưới 06 tháng tính đến thời điểm xem xét. Đối với cổ phiếu có giá trị vốn hóa hàng ngày bình quân thuộc nhóm 05 công ty lớn nhất (top-5) thì thời gian niêm yết dưới 03 tháng. <p>Tiêu chí về tỷ lệ tự do chuyển nhượng (free-float): Cổ phiếu được tham gia vào chỉ số khi tỷ lệ tự do chuyển nhượng của cổ phiếu lớn hơn 10%. Cụ thể :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Nếu tỷ lệ tự do chuyển nhượng lớn hơn 10%: đáp ứng điều kiện tham gia vào Bộ chỉ số. - Nếu tỷ lệ tự do chuyển nhượng nhỏ hơn hoặc bằng 10%: loại khỏi chỉ số, ngoại trừ cổ phiếu có giá trị vốn hóa điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng (GTVHFF) lớn hơn hoặc bằng 2.000 tỷ đồng đối với cổ phiếu thuộc bộ chỉ số kỳ trước, và lớn hơn hoặc bằng 2.500 tỷ đồng đối với các cổ phiếu mới. <p>Tiêu chí về thanh khoản: Cổ phiếu tham gia vào chỉ số đảm bảo thanh khoản bằng cách tính toán tỷ suất quay vòng chứng khoán (turnover ratio) như sau :</p> <p style="text-align: center;"> <small>Tỷ suất quay vòng chứng khoán = $\frac{\text{Giá trị giao dịch hàng ngày bình quân trong kỳ xem xét (*)}}{\text{Giá trị vốn hóa hàng ngày bình quân sau điều chỉnh free float trong kỳ xem xét}}$</small> </p> <p>(*) Giá trị giao dịch hàng ngày bình quân bao gồm cả giao dịch khớp lệnh và thỏa thuận</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu không thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng nhỏ hơn 0,05% sẽ bị loại. - Cổ phiếu thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng nhỏ hơn 0,04% sẽ bị loại khỏi. <p>Các cổ phiếu tiếp tục được xem xét theo tiêu chí thanh khoản về khối lượng giao dịch khớp lệnh bình quân hàng ngày (KLGD_KL) và giá trị giao dịch khớp lệnh bình quân hàng ngày (GTGD_KL) như sau :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Cổ phiếu có KLGD_KL nhỏ hơn 100.000 cổ phiếu sẽ bị loại. - Cổ phiếu thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có GTGD_KL nhỏ hơn 9 tỷ đồng sẽ bị loại. - Cổ phiếu không thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có GTGD_KL nhỏ hơn 10 tỷ
---	--

<p>thành phần của rổ VN30-TRI kỳ trước sau đó mới xét đến cổ phiếu mới sao cho số lượng cổ phiếu trong rổ bằng 30 cổ phiếu. Trong trường hợp có nhiều hơn 1 cổ phiếu thuộc rổ kỳ trước có cùng vị trí, ưu tiên chọn cổ phiếu có giá trị vốn hóa bình quân cao hơn của kỳ xem xét.</p> <p>- Chọn 05 cổ phiếu tiếp theo sau 30 cổ phiếu đã chọn nằm trong danh mục chỉ số VN30-TRI được đưa vào danh mục cổ phiếu dự phòng, sử dụng để thay thế trong trường hợp một hay nhiều cổ phiếu thành phần của VN30-TRI bị loại bỏ khỏi rổ chỉ số vào giữa kỳ xem xét.</p> <p>Chỉ số VN30-TRI được tính toán dựa trên phương pháp giá trị vốn hóa thị trường có điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng. Cổ phiếu thành phần của chỉ số VN30-TRI sẽ được xem xét lại 6 tháng/lần vào thứ 2 tuần thứ nhất của tháng Hai và tháng Tám hàng năm. Dữ liệu dùng trong kỳ xem xét được lấy sau khi đóng cửa phiên giao dịch cuối cùng của tháng Sáu và tháng Mười Hai.</p> <p>Để tránh tình trạng một hay một vài cổ phiếu trong chỉ số chiếm tỷ trọng vốn hóa quá lớn, tỷ trọng vốn hóa của các cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số sẽ được giới hạn ở một ngưỡng xác định. Ngưỡng giới hạn tỷ trọng vốn hóa áp dụng cho các cổ phiếu thành phần của chỉ số VN30-TRI là 10%. Việc xem xét và điều chỉnh giới hạn tỷ trọng vốn hoá sẽ được thực hiện định kì 06 tháng/lần vào cùng thời điểm xem xét định kỳ chỉ số hoặc được tính lại khi có thay đổi về cổ phiếu thành phần của rổ chỉ số trong kỳ.</p> <p>Thông tin cập nhật về Chỉ số VN30 và VN30-TRI, vui lòng tham khảo tại trang web www.hsx.vn.</p>	<p>đồng sẽ bị loại.</p> <p>Nếu danh sách không đủ tối thiểu 50 cổ phiếu thì lựa chọn các cổ phiếu theo thứ tự giảm dần về GTGD_KL sao cho đủ tối thiểu 50 cổ phiếu.</p> <p>Tiêu chí về giá trị vốn hoá :</p> <p>Tập hợp các cổ phiếu đáp ứng các tiêu chí về niêm yết, về tỷ lệ tự do chuyển nhượng và về thanh khoản gọi là danh sách sẽ được sắp xếp theo thứ tự giảm dần về giá trị vốn hoá hàng ngày bình quân trong 12 tháng chưa điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng.</p> <p>- Cổ phiếu đứng ở vị trí thứ 20 trở lên luôn được chọn vào rổ chỉ số;</p> <p>- Cổ phiếu đứng ở vị trí 21 đến 40: ưu tiên cổ phiếu đã có trong danh mục cổ phiếu thành phần của rổ chỉ số kỳ trước sau đó mới xét đến cổ phiếu mới sao cho số lượng cổ phiếu trong rổ bằng 30 cổ phiếu.</p> <p>- Chọn 05 cổ phiếu tiếp theo sau 30 cổ phiếu đã chọn vào rổ chỉ số sẽ được đưa vào danh mục cổ phiếu dự phòng, sử dụng để thay thế trong trường hợp một hay nhiều cổ phiếu thành phần của chỉ số bị loại bỏ khỏi rổ chỉ số vào giữa kỳ xem xét.</p> <p>Chỉ số được tính toán dựa trên phương pháp giá trị vốn hóa thị trường có điều chỉnh tỷ lệ tự do chuyển nhượng. Cổ phiếu thành phần của chỉ số sẽ được xem xét lại 6 tháng/lần và thời điểm áp dụng vào thứ Hai tuần thứ nhất của tháng 2 và tháng 8 hàng năm. Thời điểm áp dụng cập nhật về khối lượng lưu hành và tỷ lệ tự do chuyển nhượng định kỳ 03 tháng/lần vào thứ Hai tuần thứ nhất của tháng 2, 5, 8, 11 hàng năm.</p> <p>Để tránh tình trạng một hay một vài cổ phiếu trong chỉ số chiếm tỷ trọng vốn hóa quá lớn, tỷ trọng vốn hóa của các cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số sẽ được giới hạn ở một ngưỡng xác định. Ngưỡng giới hạn tỷ trọng vốn hóa áp dụng cho các cổ phiếu thành phần của chỉ số là 10%. Việc xem xét và điều chỉnh giới hạn tỷ trọng vốn hoá sẽ được thực hiện định kì 03 tháng/lần vào cùng thời điểm xem xét định kỳ chỉ số hoặc được tính lại khi có thay đổi về cổ phiếu thành phần của rổ chỉ số trong kỳ.</p> <p>Thông tin cập nhật về chỉ số, vui lòng tham khảo tại trang web www.hsx.vn</p>	
<p>IV. CÁC THÔNG TIN VỀ QUỸ ETF DCVFMVN30</p>		

7	<p>1. Thông tin chung về Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>....</p> <p>- Mục tiêu đầu tư của quỹ: Mục tiêu của Quỹ ETF DCVFMVN30 là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số tổng thu nhập VN30-TRI. 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.</p> <p>1.2 Tính chất và thời gian hoạt động của Quỹ</p> <p>....</p> <p>Thời gian hoạt động của Quỹ ETF DCVFMVN30 được tính từ ngày hoàn tất việc huy động vốn và chính thức đăng ký lập Quỹ với cơ quan có thẩm quyền, và không giới hạn về thời hạn hoạt động.</p> <p>3. Mục tiêu, chính sách và hạn chế đầu tư của Quỹ</p> <p>3.1 Mục tiêu đầu tư của Quỹ</p> <p>Mục tiêu của Quỹ ETF DCVFMVN30 là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số tổng thu nhập VN30-TRI. 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.</p> <p>3.2 Chiến lược đầu tư của Quỹ</p> <p>Quỹ ETF DCVFMVN30 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 VN30-TRI có sự thay đổi thì Quỹ ETF DCVFMVN30 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.</p> <p>....</p> <p>3.4 Lĩnh vực đầu tư</p> <p>Căn cứ vào chiến lược đầu tư, Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thực hiện đầu tư vào tất cả các ngành nghề của thị trường chứng khoán Việt Nam. Cơ cấu đầu tư theo ngành</p>	<p>1. Thông tin chung về Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>....</p> <p>- Mục tiêu đầu tư của quỹ: Mục tiêu của Quỹ ETF DCVFMVN30 là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập).</p> <p>1.2 Tính chất và thời gian hoạt động của Quỹ</p> <p>....</p> <p>Thời gian hoạt động của Quỹ ETF DCVFMVN30 được tính từ ngày Quỹ được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp giấy phép thành lập Quỹ và không giới hạn về thời hạn hoạt động.</p> <p>3. Mục tiêu, chính sách và hạn chế đầu tư của Quỹ</p> <p>3.1 Mục tiêu đầu tư của Quỹ</p> <p>Mục tiêu của Quỹ ETF DCVFMVN30 là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập).</p> <p>3.2 Chiến lược đầu tư của Quỹ</p> <p>Quỹ ETF DCVFMVN30 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 ETF DCVFMVN30 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.</p> <p>....</p> <p>3.4 Lĩnh vực đầu tư</p> <p>Căn cứ vào chiến lược đầu tư, Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thực hiện đầu tư vào tất cả các ngành nghề của thị trường chứng khoán Việt Nam. Cơ cấu đầu tư theo ngành nghề của Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thay đổi tùy vào sự thay đổi của danh mục của chỉ số tham chiếu và chiến lược đầu tư của Quỹ.</p> <p>3.5 Các hạn chế đầu tư của Quỹ</p>	Cập nhật thông tin
---	--	---	--------------------

<p>nghe của Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thay đổi tùy vào sự thay đổi của danh mục của chỉ số VN30-TRI và chiến lược đầu tư của Quỹ.</p> <p>3.5 Các hạn chế đầu tư của Quỹ</p> <p>...</p> <p>4. Công ty quản lý Quỹ có nghĩa vụ báo cáo, công bố thông tin và điều chỉnh lại cơ cấu đầu tư của quỹ như sau:</p> <p>- Trong thời hạn 03 tháng kể từ ngày có các sai lệch phát sinh do các nguyên nhân quy định tại điểm a, b, c,d và e khoản 3 mục 3.5 Điều này, công ty quản lý quỹ có nghĩa vụ thông báo cho Ủy ban Chứng khoán Nhà nước và điều chỉnh lại cơ cấu danh mục đầu tư cho phù hợp với quy định tại khoản 2 mục 3.5 Điều này.</p> <p>3.7 Phương pháp lựa chọn đầu tư</p> <p>Để mô phỏng chỉ số vn30-tri, về nguyên tắc quỹ phải nắm giữ tất cả các cổ phiếu có trong danh mục chỉ số vn30-tri theo tỷ lệ tương ứng. tuy nhiên, trong một số trường hợp quỹ không thể mua đủ tất cả những cổ phiếu tương ứng với tỷ trọng trong chỉ số tham chiếu. Trong những trường hợp này, quỹ có thể chọn phương pháp nâng tỷ trọng hoặc giảm tỷ trọng của một số cổ phiếu không thuộc chỉ số mà có độ tương quan cao với chỉ số vn30-tri để thay thế cho những cổ phiếu trong chỉ số nhằm mô phỏng gần nhất chỉ số vn30-tri. Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thực hiện bán trước những cổ phiếu trong danh mục khi dự báo khả năng cổ phiếu đó sẽ ra khỏi danh mục của chỉ số vn30-tri hoặc mua trước những cổ phiếu hiện tại chưa thuộc chỉ số vn30-tri khi dự báo khả năng cổ phiếu đó sẽ được đưa vào danh mục chỉ số vn30-tri tại kỳ xem xét tiếp theo.</p> <p>4. Các rủi ro khi đầu tư vào quỹ:</p> <p>4.1 Rủi ro đầu tư tại Việt Nam</p> <p>VN30-TRI là chỉ số tổng thu nhập VN30 bao gồm 30 chứng khoán trên thị trường chứng khoán Việt Nam, nên đầu tư vào Quỹ ETF DCVFMVN30 nhà đầu tư có thể gặp những yếu tố về rủi ro liên quan đến nền kinh tế Việt Nam. Do thị trường chứng khoán Việt Nam đang trong giai đoạn phát triển, vì thế thị trường chứng khoán ở Việt Nam ít tương quan so với các thị trường chứng khoán ở các nước phát triển cũng như thị trường chứng khoán ở Việt Nam ít tương quan so với các thị trường chứng khoán ở các nước phát triển cũng như thị trường chứng khoán thế giới. Khi nền kinh tế Việt Nam biến động bất lợi thì khoản đầu tư vào</p>	<p>...</p> <p>4. Công ty quản lý Quỹ có nghĩa vụ báo cáo, công bố thông tin và điều chỉnh lại cơ cấu đầu tư của quỹ như sau:</p> <p>- Trong thời hạn 03 tháng kể từ ngày có các sai lệch phát sinh do các nguyên nhân quy định tại điểm a, b, c, d, e và f khoản 3 mục 3.5 Điều này, công ty quản lý quỹ có nghĩa vụ thông báo cho Ủy ban Chứng khoán Nhà nước và điều chỉnh lại cơ cấu danh mục đầu tư cho phù hợp với quy định tại khoản 2 mục 3.5 Điều này.</p> <p>3.7 Phương pháp lựa chọn đầu tư</p> <p>Để mô phỏng chỉ số tham chiếu, về nguyên tắc quỹ phải nắm giữ tất cả các cổ phiếu có trong danh mục chỉ số tham chiếu theo tỷ lệ tương ứng. tuy nhiên, trong một số trường hợp quỹ không thể mua đủ tất cả những cổ phiếu tương ứng với tỷ trọng trong chỉ số tham chiếu. Trong những trường hợp này, quỹ có thể chọn phương pháp nâng tỷ trọng hoặc giảm tỷ trọng của một số cổ phiếu trong chỉ số hoặc mua những cổ phiếu không thuộc chỉ số mà có độ tương quan cao với chỉ số tham chiếu để thay thế cho những cổ phiếu trong chỉ số nhằm mô phỏng gần nhất chỉ số tham chiếu. Quỹ ETF DCVFMVN30 có thể thực hiện bán trước những cổ phiếu trong danh mục khi dự báo khả năng cổ phiếu đó sẽ ra khỏi danh mục của chỉ số tham chiếu hoặc mua trước những cổ phiếu hiện tại chưa thuộc chỉ số tham chiếu khi dự báo khả năng cổ phiếu đó sẽ được đưa vào danh mục chỉ số tham chiếu tại kỳ xem xét tiếp theo.</p> <p>4. Các rủi ro khi đầu tư vào quỹ:</p> <p>4.1 Rủi ro đầu tư tại Việt Nam</p> <p>Chỉ số tham chiếu là chỉ số VN30 (theo phương pháp tổng thu nhập) bao gồm 30 chứng khoán trên thị trường chứng khoán Việt Nam, nên đầu tư vào Quỹ ETF DCVFMVN30 nhà đầu tư có thể gặp những yếu tố về rủi ro liên quan đến nền kinh tế Việt Nam. Do thị trường chứng khoán Việt Nam đang trong giai đoạn phát triển, vì thế thị trường chứng khoán ở Việt Nam ít tương quan so với các thị trường chứng khoán ở các nước phát triển cũng như thị trường chứng khoán ở Việt Nam ít tương quan so với các thị trường chứng khoán ở các nước phát triển cũng như thị trường chứng khoán thế giới. Khi nền kinh tế Việt Nam biến động bất lợi thì khoản đầu tư vào</p>	
--	---	--

	<p>Quỹ ETF DCFMVN30 sẽ bị thiệt hại mặc dù kinh tế thế giới tiến triển tốt. Đây là loại rủi ro mà nhà đầu tư gặp phải khi đầu tư vào một đất nước nhất định.</p>	<p>gặp phải khi đầu tư vào một đất nước nhất định.</p>	
V. TÓM TẮT ĐIỀU LỆ QUỸ			
8		Tóm tắt điều lệ quỹ	Bổ sung thông tin
VI. GIAO DỊCH HOÁN ĐỔI CHỨNG CHỈ QUỸ ETF DCFMVN30			
9	<p>1. Giao dịch hoán đổi định kỳ (giao dịch sơ cấp) 1.1 Quy định chung khi thực hiện giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ <i>e. Phương thức giao dịch:</i> ... - Các lệnh giao dịch hoán đổi được chuyển đến sau thời điểm đóng sổ lệnh sẽ được xem là không hợp lệ và tự động huỷ trong cùng kỳ giao dịch. Nếu nhà đầu tư, thành viên lập quỹ muốn thực hiện tiếp các lệnh giao dịch của mình thì nhà đầu tư, thành viên lập quỹ phải đăng ký giao dịch lại tại kỳ giao dịch kế tiếp và quỹ sẽ hoàn trả lại khoản tiền chênh lệch thừa (nếu có) cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ trong 03 (ba) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi. - Việc thanh toán tiền chênh lệch phát sinh trong quá trình thực hiện giao dịch hoán đổi (nếu có) được thực hiện dưới hình thức chuyển khoản trực tiếp từ tài khoản nhà đầu tư, thành viên lập quỹ đến tài khoản của Quỹ tại Ngân hàng giám sát trước 12 giờ ngày T+1, một (01) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi, và ngược lại Quỹ sẽ hoàn trả phần chênh lệch thừa cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ trong ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi. Phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. <i>h. Thời hạn tiếp nhận và hoàn trả tiền cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ:</i> ... - ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi, Quỹ ETF hoàn trả cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư các khoản thanh toán bằng tiền phát sinh chênh lệch giữa giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu và giá phát hành của lô chứng chỉ quỹ ETF. Phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. 1.2 Nguyên tắc xác định giá giao dịch hoán đổi • Giá giao dịch hoán đổi sẽ được xác định</p>	<p>1. Giao dịch hoán đổi định kỳ (giao dịch sơ cấp) 1.1 Quy định chung khi thực hiện giao dịch hoán đổi chứng chỉ quỹ <i>e. Phương thức giao dịch:</i> ... - Các lệnh giao dịch hoán đổi được chuyển đến sau thời điểm đóng sổ lệnh sẽ được xem là không hợp lệ và tự động huỷ trong cùng kỳ giao dịch. Nếu nhà đầu tư, thành viên lập quỹ muốn thực hiện tiếp các lệnh giao dịch của mình thì nhà đầu tư, thành viên lập quỹ phải đăng ký giao dịch lại tại kỳ giao dịch kế tiếp và quỹ sẽ hoàn trả lại khoản tiền chênh lệch thừa (nếu có) cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ trong vòng 03 (ba) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi. - Việc thanh toán tiền chênh lệch phát sinh trong quá trình thực hiện giao dịch hoán đổi (nếu có) được thực hiện dưới hình thức chuyển khoản trực tiếp từ tài khoản nhà đầu tư, thành viên lập quỹ đến tài khoản của Quỹ tại Ngân hàng giám sát trước 12 giờ ngày T+1, một (01) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi, và ngược lại Quỹ sẽ hoàn trả phần chênh lệch thừa cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ trong vòng 03 (ba) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi. Phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. ... <i>h. Thời hạn tiếp nhận và hoàn trả tiền cho nhà đầu tư, thành viên lập quỹ:</i> ... - Trong vòng 03 (ba) ngày làm việc kể từ ngày hoán đổi, Quỹ ETF hoàn trả cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư các khoản thanh toán bằng tiền phát sinh chênh lệch giữa giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu và giá phát hành của lô chứng chỉ quỹ ETF. Phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. 1.2 Nguyên tắc xác định giá giao dịch hoán đổi</p>	Cập nhật thông tin

<p>tại cuối ngày liền trước ngày giao dịch hoán đổi và công bố đến nhà đầu tư vào ngày giao dịch chứng chỉ quỹ trên trang thông tin điện tử và tại trụ sở của Công ty quản lý quỹ DCVFM và theo các quy định về công bố thông tin.</p> <p>1.3 Thực hiện giao dịch hoán đổi chứng khoán cơ cấu lấy chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>...</p> <ul style="list-style-type: none"> • Trường hợp giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu nhiều hơn giá trị tài sản ròng của các lô chứng chỉ quỹ ETF, phần chênh lệch này được Công ty quản lý quỹ DCVFM, ngân hàng giám sát hoàn trả lại cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư bằng tiền mặt kể từ ngày giao dịch hoán đổi, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. • Vào ngày làm việc thứ nhất kể từ ngày giao dịch hoán đổi (ngày T+1), VSD sẽ thực hiện kiểm tra các lệnh hoán đổi chứng khoán cơ cấu lấy chứng chỉ quỹ ETF của nhà đầu tư và thành viên lập quỹ. Các lệnh không đủ chứng khoán cơ cấu theo danh mục để hoán đổi hoặc không nộp đủ tiền (nếu có) tại thời điểm kiểm tra sẽ xem là giao dịch không hợp lệ và không được thực hiện. Quỹ ETF sẽ hoàn trả số tiền mà thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đã nộp (nếu có) trong vòng 0 () ngày làm việc sau khi có kết quả giao dịch hoán đổi do VSD cung cấp, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. <p>1.4 Thực hiện giao dịch hoán đổi chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30 lấy chứng khoán cơ cấu</p> <p>...</p> <ul style="list-style-type: none"> • Trong trường hợp giá trị các lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30 mà Công ty quản lý quỹ DCVFM tiếp nhận từ thành viên lập quỹ, nhà đầu tư nhiều hơn giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu. Phần chênh lệch này được Công ty quản lý quỹ DCVFM hoàn trả lại cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư bằng tiền kể từ ngày giao dịch hoán đổi, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. <p>1.6 Trường hợp sở hữu chứng khoán cơ cấu vượt quá tỷ lệ theo luật định</p> <p>...</p> <p>1) Trường hợp là pháp nhân, cá nhân nước ngoài, Công ty quản lý quỹ DCVFM sẽ phải bán số chứng khoán cơ cấu vượt tỷ lệ sở</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Giá giao dịch hoán đổi sẽ được xác định tại cuối ngày liền trước ngày giao dịch hoán đổi và công bố đến nhà đầu tư vào ngày giao dịch chứng chỉ quỹ trên trang thông tin điện tử và tại trụ sở của Công ty quản lý quỹ DCVFM và theo các quy định về công bố thông tin. • Giá dịch vụ phát hành được quy định tại Mục 1.1 Chương IX của Bản Cáo Bạch này. • Giá dịch vụ mua lại được quy định tại Mục 1.2 Chương IX của Bản Cáo Bạch này. <p>1.3 Thực hiện giao dịch hoán đổi chứng khoán cơ cấu lấy chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>...</p> <ul style="list-style-type: none"> • Trường hợp giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu nhiều hơn giá trị tài sản ròng của các lô chứng chỉ quỹ ETF, phần chênh lệch này được Công ty quản lý quỹ DCVFM, ngân hàng giám sát hoàn trả lại cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư bằng tiền mặt trong vòng ba (03) ngày làm việc kể từ ngày giao dịch hoán đổi, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. • Vào ngày làm việc thứ nhất kể từ ngày giao dịch hoán đổi (ngày T+1), VSD sẽ thực hiện kiểm tra các lệnh hoán đổi chứng khoán cơ cấu lấy chứng chỉ quỹ ETF của nhà đầu tư và thành viên lập quỹ. Các lệnh không đủ chứng khoán cơ cấu theo danh mục để hoán đổi hoặc không nộp đủ tiền (nếu có) tại thời điểm kiểm tra sẽ xem là giao dịch không hợp lệ và không được thực hiện. Quỹ ETF sẽ hoàn trả số tiền mà thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đã nộp (nếu có) trong vòng 02 (hai) ngày làm việc sau khi có kết quả giao dịch hoán đổi do VSD cung cấp, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu. <p>1.4 Thực hiện giao dịch hoán đổi chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30 lấy chứng khoán cơ cấu</p> <p>...</p> <ul style="list-style-type: none"> • Trong trường hợp giá trị các lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30 mà Công ty quản lý quỹ DCVFM tiếp nhận từ thành viên lập quỹ, nhà đầu tư nhiều hơn giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu. Phần chênh lệch này được Công ty quản lý quỹ DCVFM hoàn trả lại cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư 	
---	---	--

<p>hữu tối đa và thanh toán bằng tiền cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư bằng hình thức chuyển khoản.</p> <p>2) Trường hợp hoán đổi danh mục chứng khoán cơ cấu cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư dẫn tới thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó sở hữu từ 25% trở lên số cổ phiếu đang lưu hành của một tổ chức, hoặc thành viên lập quỹ, nhà đầu tư sở hữu cổ phiếu phát hành bởi chính thành viên lập quỹ, nhà đầu tư mà thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó chưa thực hiện thủ tục chào mua công khai hoặc giao dịch cổ phiếu quỹ theo quy định của pháp luật liên quan, thì Công ty quản lý quỹ DCVFM có trách nhiệm bán phần chứng khoán vượt trội so với tỷ lệ phải thực hiện chào mua công khai hoặc bán toàn bộ phần chứng khoán phát hành bởi chính thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó và thanh toán bằng tiền cho thành viên lập quỹ, các nhà đầu tư này.</p> <p>Ngay khi phát sinh các trường hợp quy định tại mục 1) và 2) ở trên, số lượng chứng khoán này sẽ được hạch toán theo dõi riêng trong trường hợp Công ty quản lý Quỹ DCVFM chưa bán được cho nhà đầu tư.</p> <p>Việc thanh toán tiền cho các thành viên lập quỹ, nhà đầu tư quy định tại mục 1), 2) nêu trên phụ thuộc vào tiến độ bán thanh lý phần chứng khoán vượt quá các tỷ lệ sở hữu tối đa hoặc tỷ lệ sở hữu phải thực hiện chào mua công khai, giao dịch ký quỹ theo quy định luật hiện hành. Khoản thanh toán cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư là giá trị giao dịch, sau khi khấu trừ thuế, chi phí giao dịch theo quy định của pháp luật liên quan.</p> <p>1.7 Thực hiện tạm ngừng giao dịch hoán đổi lấy các lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30</p> <p>...</p> <p>e. Các trường hợp khác phù hợp với quy định pháp luật và Điều lệ quỹ hoặc UBCKNN xét thấy là cần thiết.</p>	<p>bằng tiền trong vòng ba (03) ngày làm việc kể từ ngày giao dịch hoán đổi, phí ngân hàng trong trường hợp này sẽ do nhà đầu tư, thành viên lập quỹ chịu.</p> <p>1.6 Trường hợp sở hữu chứng khoán cơ cấu vượt quá tỷ lệ theo luật định</p> <p>...</p> <p>1) Trường hợp là tổ chức, cá nhân nước ngoài, Công ty quản lý quỹ DCVFM sẽ phải bán số chứng khoán cơ cấu vượt tỷ lệ sở hữu tối đa và thanh toán bằng tiền cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư bằng hình thức chuyển khoản.</p> <p>2) Trường hợp hoán đổi danh mục chứng khoán cơ cấu cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư dẫn tới thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó sở hữu từ 25% trở lên số cổ phiếu đang lưu hành của một tổ chức, hoặc thành viên lập quỹ, nhà đầu tư sở hữu cổ phiếu phát hành bởi chính thành viên lập quỹ, nhà đầu tư mà thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó chưa thực hiện thủ tục chào mua công khai hoặc giao dịch cổ phiếu quỹ theo quy định của pháp luật liên quan, thì Công ty quản lý quỹ DCVFM có trách nhiệm bán phần chứng khoán vượt trội so với tỷ lệ phải thực hiện chào mua công khai hoặc bán toàn bộ phần chứng khoán phát hành bởi chính thành viên lập quỹ, nhà đầu tư đó và thanh toán bằng tiền cho thành viên lập quỹ, các nhà đầu tư này.</p> <p>Ngay khi phát sinh các trường hợp quy định tại mục 1) và 2) ở trên, số lượng chứng khoán này sẽ được hạch toán theo dõi riêng trong trường hợp Công ty quản lý Quỹ DCVFM chưa bán được cho nhà đầu tư.</p> <p>Việc thanh toán tiền cho các thành viên lập quỹ, nhà đầu tư quy định tại mục 1), 2) nêu trên phụ thuộc vào tiến độ bán thanh lý phần chứng khoán vượt quá các tỷ lệ sở hữu tối đa hoặc tỷ lệ sở hữu phải thực hiện chào mua công khai, giao dịch ký quỹ theo quy định luật hiện hành. Khoản thanh toán cho thành viên lập quỹ, nhà đầu tư là giá trị giao dịch, sau khi khấu trừ thuế, chi phí giao dịch theo quy định của pháp luật liên quan và sẽ được quỹ thực hiện sau hai (02) ngày làm việc kể từ ngày Quỹ ETF nhận tiền do việc hoàn tất bán thành công những chứng khoán này.</p> <p>1.7 Thực hiện tạm ngừng giao dịch hoán đổi lấy các lô chứng chỉ Quỹ ETF DCVFMVN30</p>	
--	--	--

		<p>...</p> <p>e. Công ty quản lý quỹ có quyền tạm ngừng nhận, thực hiện lệnh giao dịch hoán đổi danh mục chứng khoán cơ cấu lấy các lô chứng chỉ quỹ ETF DCVFMVN30 từ nhà đầu tư và thành viên lập quỹ khi nhận thấy việc nhận, thực hiện các lệnh giao dịch hoán đổi có thể sẽ dẫn đến danh mục đầu tư của quỹ vi phạm quy định hạn chế đầu tư theo quy định tại điểm a khoản 3 Điều 45 của Thông tư 98/2020/TT-BTC và quy định sửa đổi bổ sung (nếu có) của Thông tư 98/2020/TT-BTC;</p> <p>f. Các trường hợp khác phù hợp với quy định pháp luật và Điều lệ quỹ và công bố tại Bản cáo bạch, Bản cáo bạch tóm tắt hoặc UBCKNN xét thấy là cần thiết.</p>	
--	--	---	--

VII. THÔNG TIN VỀ CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ, NGÂN HÀNG GIÁM SÁT, VÀ CÁC ĐƠN VỊ LIÊN QUAN KHÁC

8	<p>1. Giới thiệu về Công ty Quản lý Quỹ DCVFM</p> <p>2. Thành viên lập quỹ</p> <p>4. Ngân Hàng Giám Sát Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) Văn phòng chính: Tầng 3, Tháp 1 và Tháp 2, Phòng CP1.L01 và Phòng CP2.L01, Tòa nhà Capital Place, số 29 Liễu Giai, phường Ngọc Khánh, quận Ba Đình, Hà Nội. Điện thoại: (84-24) 3936 8000 Fax: (84-24)</p> <p>Là một ngân hàng thương mại được thành lập hợp pháp theo pháp luật Việt Nam, theo Giấy phép thành lập Giấy Phép Thành Lập và Hoạt Động số 236/GP-NHNN do Ngân Hàng Nhà Nước Việt Nam cấp ngày 8 tháng 9 năm 2008 (như được sửa đổi vào từng thời điểm) và được cấp Giấy chứng nhận đăng ký hoạt động lưu ký chứng khoán 08/GCN-UBCK do Ủy Ban Chứng khoán Nhà nước cấp ngày 07 tháng 05 năm 2015, cung cấp những dịch vụ như sau cho những quỹ đầu tư chứng khoán thành lập tại Việt Nam: dịch vụ lưu ký, dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ ngân hàng giám sát và những dịch vụ khác có liên quan đến lưu ký. Ngân hàng Giám sát chịu trách nhiệm trong phạm vi liên quan đến hoạt động của ngân hàng giám sát theo quy định tại Điều lệ Quỹ và Hợp đồng Giám sát.</p> <p>6. Tổ Chức Được Ủy Quyền Thực Hiện</p>	<p>1. Giới thiệu về Công ty Quản lý Quỹ DCVFM Cập nhật số liệu tình hình hoạt động tới năm 2022</p> <p>1.3.1 Giới thiệu Ban đại diện Quỹ - Bà Nguyễn Bội Hồng Lê: Chủ tịch Ban đại diện Quỹ. - Bà Lê Thị Thu Hương: Thành viên Ban đại diện Quỹ. - Bà Phạm Thị Thanh Thúy: Thành viên Ban đại diện Quỹ. Chi tiết của Ban đại diện Quỹ ETF DCVFMVN30 của Công ty DCVFM được trình bày ở website Công ty DCVFM tại địa chỉ www.dragoncapital.com.vn.</p> <p>2. Thành viên lập quỹ Cập nhật danh sách thành viên lập quỹ</p> <p>4. Ngân Hàng Giám Sát Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) Văn phòng chính: Tầng 3, Phòng CP1.L01 & CP2.L01, Capital Place, 29 Liễu Giai, Phường Ngọc Khánh, Quận Ba Đình, Thành phố Hà Nội, Việt Nam Điện thoại: (84-24) 3936 8000 Fax: (84-24) 38378356 Ngân hàng Giám sát chịu trách nhiệm trong phạm vi liên quan đến hoạt động của ngân hàng giám sát theo quy định tại Điều lệ Quỹ và Hợp đồng Giám sát.</p> <p>6. Tổ Chức Được Ủy Quyền Thực Hiện</p>	Cập nhật thông tin
----------	--	---	--------------------

<p>Dịch Vụ Quản Trị Quỹ Tổ Chức Được Ủy Quyền Thực Hiện Dịch Vụ Đại Lý Chuyên Nhượng</p> <p>7. Tổ Chức Được Ủy Quyền Thực Hiện Dịch Vụ Đại Lý Chuyên Nhượng</p> <p>TRUNG TÂM LƯU KÝ CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM (VSD)</p>	<p>Dịch Vụ Quản Trị Quỹ ... Tổ chức cung cấp dịch vụ quản trị quỹ chịu trách nhiệm trong phạm vi liên quan đến dịch vụ cung cấp theo quy định tại hợp đồng dịch vụ ký kết giữa Công ty Quản Lý Quỹ và tổ chức cung cấp dịch vụ quản trị quỹ.</p> <p>7. Tổ Chức Được Ủy Quyền Thực Hiện Dịch Vụ Đại Lý Chuyên Nhượng Cập nhật tên gọi mới của VSD thành TỔNG CÔNG TY LƯU KÝ VÀ BÙ TRỪ CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM (VSDC)</p>	
---	--	--

IX. GIÁ DỊCH VỤ, PHÍ VÀ CÁC CHI PHÍ HOẠT ĐỘNG

<p>9</p> <p>2. Các loại giá dịch vụ, phí do Quỹ trả: d. Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng Giá đại lý chuyên nhượng là mức giá do Quỹ chi trả cho tổ chức cung cấp dịch vụ đại lý chuyên nhượng. Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng được công bố tại Bản cáo bạch, Bản cáo bạch tóm tắt, trên trang thông tin điện tử của Công ty quản lý quỹ, hoặc dưới các hình thức khác.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Công thức tính giá đại lý chuyên nhượng vào mỗi kỳ định giá trong tháng được xác định như sau: Giá đại lý chuyên nhượng cho kỳ định giá = Giá đại lý chuyên nhượng hàng tháng/ số ngày thực tế của tháng x số ngày theo lịch thực tế của chu kỳ định giá. • Mức giá dịch vụ và phương pháp thanh toán giá dịch vụ được quy định cụ thể trong Hợp đồng giữa Công ty quản lý quỹ và Tổ chức cung cấp dịch vụ Đại lý chuyên nhượng. Ngoài ra, Quỹ sẽ trả các chi phí liên quan đến việc thực hiện quyền cho VSD theo thỏa thuận trong hợp đồng. <p>3. Các chỉ tiêu hoạt động</p> <p>3.1 Tỷ lệ chi phí của quỹ <small>Chi phí của quỹ là các khoản chi phí sau thuế nếu tại mức 2 trên.</small></p> <p>a. Trong thời hạn bốn mươi lăm (45) ngày, kể từ ngày kết thúc quý II và kết thúc năm, Công ty quản lý quỹ DCVFM phải công bố thông tin về tỷ lệ chi phí trên các trang thông tin điện tử của Công ty quản lý quỹ DCVFM, thành viên lập quỹ, đại lý phân phối, bảo đảm tính chính xác theo công thức sau:</p> $\text{Tỷ lệ chi phí (\%)} = \frac{\text{Tổng chi phí của quỹ} \times 100\%}{\text{Giá trị tài sản ròng trung bình trong năm}}$ <p>b. Trường hợp quỹ thành lập và hoạt động dưới một năm, tỷ lệ chi phí được xác định theo công thức sau:</p> $\text{Tỷ lệ chi phí (\%)} = \frac{\text{Tổng chi phí} \times 365 \text{ ngày} \times 100\%}{\text{Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ báo cáo} \times \text{Thời gian quỹ đã hoạt động (tính theo ngày từ thời điểm cấp phép)}}$ <p>3.2 Tốc độ vòng quay danh mục của Quỹ Tốc độ vòng quay danh mục của quỹ ETF DCVFMVN30 xác định theo công thức sau:</p>	<p>2. Các loại giá dịch vụ, phí do Quỹ trả: d. Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng • Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng là mức giá do Quỹ chi trả cho tổ chức cung cấp dịch vụ đại lý chuyên nhượng. Mức giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng là 5 triệu đồng mỗi tháng (chưa bao gồm thuế giá trị tăng (nếu có)).</p> <ul style="list-style-type: none"> • Công thức tính giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng vào mỗi kỳ định giá trong tháng được xác định như sau: Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng cho kỳ định giá = Giá dịch vụ đại lý chuyên nhượng hàng tháng/ số ngày thực tế của tháng x số ngày theo lịch thực tế của chu kỳ định giá. • Mức giá dịch vụ và phương pháp thanh toán giá dịch vụ được quy định cụ thể trong Hợp đồng giữa Công ty quản lý quỹ và Tổ chức cung cấp dịch vụ Đại lý chuyên nhượng. Ngoài ra, Quỹ sẽ trả các chi phí liên quan đến việc thực hiện quyền cho VSD theo thỏa thuận trong hợp đồng. <p>h. Các loại phí và lệ phí khác ... • Công ty quản lý quỹ, Thành viên lập quỹ, Đại lý phân phối chịu trách nhiệm thanh toán chi phí in ấn, phát hành các ấn phẩm quảng cáo, thông tin về sản phẩm quỹ.</p> <p>3. Các chỉ tiêu hoạt động</p> <p>3.1 Tốc độ vòng quay danh mục của Quỹ Tốc độ vòng quay danh mục của quỹ ETF DCVFMVN30 xác định theo công thức sau:</p> $\text{Tốc độ vòng quay danh mục} = \frac{(\text{Tổng giá trị mua vào trong kỳ} + \text{Tổng giá trị bán ra trong kỳ}) \times 100\%}{2 \times \text{Giá trị tài sản ròng}}$	<p>Cập nhật thông tin</p>
---	--	---------------------------

<p>Tốc độ vòng quay danh mục (%) = $\frac{\text{(Tổng giá trị mua vào trong kỳ + Tổng giá trị bán ra trong kỳ)} \times 100\%}{2 \times \text{Giá trị tài sản ròng trung bình trong năm}}$</p> <p>Trường hợp quỹ thành lập và hoạt động dưới một năm, tốc độ vòng quay danh mục được xác định theo công thức sau:</p> <p>Tốc độ vòng quay danh mục (%) = $\frac{\text{(Tổng giá trị mua vào trong kỳ + Tổng giá trị bán ra trong kỳ)} \times 365 \times 100\%}{2 \times \text{Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ báo cáo} \times \text{Thời gian Quỹ đã hoạt động (tính theo ngày từ thời điểm cấp phép)}}$</p> <p>3.3 Mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking Error-TE)</p> <p>Mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu của tuần hiện tại (t) được xác định theo công thức sau:</p> $TE_t = \sqrt{n} \sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=-n}^{-1} (R_i - \bar{R})^2}$ <p>Trong đó: R_i là mức chênh lệch giữa biến động giá trị tài sản ròng của 1 lô chứng chỉ quỹ ETF (NAV/CU) và biến động của chỉ số tham chiếu của tuần thứ i trở về trước, kể từ tuần hiện tại (t), được xác định theo công thức sau:</p> $R_i = \ln \left[\frac{(\text{NAV/CU})_i}{(\text{NAV/CU})_{i-1}} \right] - \ln \left[\frac{(\text{Chỉ số tham chiếu})_i}{(\text{Chỉ số tham chiếu})_{i-1}} \right],$ $\bar{R} = \frac{1}{n} \sum_{i=-n}^{-1} R_i$ <p>Index: chỉ số tham chiếu VN30-TRI của Quỹ ETF DCFMNVN30.</p> <p>Trường hợp thời gian hoạt động của quỹ chưa tới sáu (06) tháng, n là số tuần, kể từ tuần giấy chứng nhận đăng ký thành lập quỹ có hiệu lực.</p>	<p>mục (%) trung bình trong năm</p> <p>Trường hợp quỹ thành lập và hoạt động dưới một năm, tốc độ vòng quay danh mục được xác định theo công thức sau:</p> <p>Tốc độ vòng quay danh mục (%) = $\frac{\text{(Tổng giá trị mua vào trong kỳ + Tổng giá trị bán ra trong kỳ)} \times 365 \times 100\%}{2 \times \text{Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ báo cáo} \times \text{Thời gian Quỹ đã hoạt động (tính theo ngày từ thời điểm cấp phép)}}$</p> <p>3.2 Mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking Error-TE)</p> <p>Mức sai lệch so với chỉ số tham chiếu của tuần hiện tại (t) được xác định theo công thức sau:</p> $TE_t = \sqrt{n} \sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=-n}^{-1} (R_i - \bar{R})^2}$ <p>Trong đó: R_i là mức chênh lệch giữa biến động giá trị tài sản ròng của 1 lô chứng chỉ quỹ ETF (NAV/CU) và biến động của chỉ số tham chiếu của tuần thứ i trở về trước, kể từ tuần hiện tại (t), được xác định theo công thức sau:</p> $R_i = \ln \left[\frac{(\text{NAV/CU})_i}{(\text{NAV/CU})_{i-1}} \right] - \ln \left[\frac{(\text{Chỉ số tham chiếu})_i}{(\text{Chỉ số tham chiếu})_{i-1}} \right],$ $\bar{R} = \frac{1}{n} \sum_{i=-n}^{-1} R_i$ <p>Trường hợp thời gian hoạt động của quỹ chưa tới sáu (06) tháng, n là số tuần, kể từ tuần giấy chứng nhận đăng ký thành lập quỹ có hiệu lực.</p>	
---	--	--

Ngày bắt đầu có hiệu lực: 29/09/2023

Công ty cam kết sẽ hoàn tất các thủ tục liên quan và chịu trách nhiệm trước pháp luật về tính chính xác, trung thực của công văn này và hồ sơ kèm theo.

Nơi nhận:

Hồ sơ kèm theo:

- Điều Lệ/Bản cáo bạch sửa đổi, bổ sung.

CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ

(Đã ký và đóng dấu)

LÊ HOÀNG ANH

Giám đốc chi nhánh Hà Nội kiêm

Quyền Giám đốc, Nghiệp vụ hỗ trợ đầu tư