

QUỸ ETF SSIAM VNX50

CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc
THE SOCIALIST REPUBLIC OF VIETNAM
Independence - Freedom - Happiness

Số/No.: 32/2019/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 18 tháng 01 năm 2019
Ha Noi, 18 January 2019

**CÔNG BỐ THÔNG TIN
TRÊN CÔNG THÔNG TIN ĐIỆN TỬ
CỦA ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ
NƯỚC VÀ SGDCK TP.HCM**

**DISCLOSURE OF INFORMATION ON
THE STATE SECURITIES
COMMISSION'S PORTAL AND
HOCHIMINH STOCK EXCHANGE'S
PORTAL**

Kính gửi/ To:

- Sở Giao dịch chứng khoán TP.HCM/ *Hochiminh Stock
Exchange*

- Tên CTQLQ: Công ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI
- Tên tổ chức / *Organization name*: Quỹ ETF SSIAM VNX50
- Mã chứng khoán/ *Security Symbol*: FUESSV50
- Địa chỉ trụ sở chính/ *Address*: Tầng 5, 1C Ngô Quyền, Quận Hoàn Kiếm, Hà Nội
- Điện thoại/ *Telephone*: 0243.9366321
- Fax: 02439.366337
- Người thực hiện công bố thông tin/ *Submitted by*: Bà Tô Thùy Linh
Chức vụ/ *Position*: Phó Tổng Giám Đốc/ COO

Loại thông tin công bố : định kỳ bất thường 24h theo yêu cầu

Information disclosure type: *Periodic* *Irregular* *24 hours* *On demand*

Nội dung thông tin công bố (*)/ Content of Information disclosure (*):

Báo cáo tổng kết hoạt động của Quỹ ETF SSIAM VNX50 Quý IV/2018

Operation Report of SSIAM VNX50 ETF Q IV/ 2018



Handwritten signature

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của công ty/quỹ vào ngày 18/01/2019 tại đường dẫn : <https://www.ssi.com.vn/AssetManagement.aspx>

This information was disclosed on Company/Fund's Portal on 18 January 2019 Available at: <https://www.ssi.com.vn/AssetManagement.aspx>

Tôi cam kết các thông tin công bố trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu trách nhiệm trước pháp luật về nội dung các thông tin đã công bố./

I declare that all information provided in this paper is true and accurate; I shall be legally responsible for any misrepresentation.

Tài liệu đính kèm/

Attachment:

Báo cáo tổng kết hoạt động Quỹ ETF
SSIAM VNX50 Q IV/2018

Người công bố thông tin 



Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC





BÁO CÁO CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ
QUỸ ETF SSIAM VNX50
QUÝ IV NĂM 2018

I. Thông tin chung về Quỹ

1. Mục tiêu của Quỹ

Mục tiêu đầu tư của Quỹ ETF SSIAM VNX50 là hướng tới đạt hiệu quả đầu tư bám sát mức sinh lời thực tế của Chỉ Số VNX50 trong tất cả các giai đoạn.

2. Hiệu quả hoạt động của Quỹ

Theo Báo cáo tài chính của Quỹ tính đến kỳ báo cáo, thay đổi giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ là -13,45% so với giá trị tài sản ròng tại ngày 30/09/2018; thay đổi giá trị tài sản ròng trên chứng chỉ quỹ (NAV/CCQ) của Quỹ là -13,45% so với NAV/CCQ của quỹ trong cùng kỳ báo cáo. Trong khi giá trị của danh mục chứng khoán cơ cấu thay đổi là -12,51%, thay đổi của chỉ số tham chiếu là -13,51%.

3. Chính sách và chiến lược đầu tư của Quỹ

Quỹ áp dụng chiến lược đầu tư thụ động. Quỹ không chủ động tìm kiếm tăng trưởng cao hơn Chỉ Số Tham Chiếu, cũng như không sử dụng các biện pháp phòng thủ khi thị trường chứng khoán biến động bất lợi.

Với việc đầu tư thụ động, Quỹ có thể duy trì tỷ lệ vòng quay danh mục thấp hơn các quỹ có chiến lược đầu tư chủ động, từ đó giảm chi phí hoạt động cho Quỹ.

4. Phân loại Quỹ: Quỹ hoán đổi danh mục

5. Thời gian khuyến cáo đầu tư của Quỹ: Không giới hạn

6. Mức độ rủi ro ngắn hạn (thấp, trung bình, cao): Trung bình

7. Thời điểm bắt đầu hoạt động của Quỹ: 10/12/2014

8. Quy mô Quỹ tại thời điểm báo cáo (Tại ngày 31/12/2018): Giá trị tài sản ròng của Quỹ 115.890.856.890 VNĐ và số lượng 9.700.000 đơn vị CCQ.

9. Chỉ số tham chiếu của Quỹ: chỉ số VNX50 tại thời điểm báo cáo là 1.354,37

10. Chính sách phân phối lợi nhuận của Quỹ

- Quỹ chi trả lợi tức quỹ bảo đảm nguyên tắc:
 - Phù hợp với chính sách phân chia lợi nhuận quy định tại Điều Lệ Quỹ;
 - Thực hiện sau khi Quỹ đã hoàn thành nghĩa vụ thuế và các nghĩa vụ tài chính khác theo quy định của pháp luật và trích lập đầy đủ các quỹ theo quy định tại Điều Lệ Quỹ (nếu có);
 - Sau khi chi trả, Quỹ vẫn phải bảo đảm có nguồn vốn để thanh toán đủ các khoản nợ, nghĩa vụ tài sản khác đến hạn và bảo đảm giá trị tài sản ròng không thấp hơn năm mươi (50) tỷ đồng;
- Trường hợp phân phối lợi tức bằng Chứng Chỉ Quỹ, Quỹ phải có đủ nguồn vốn đối ứng từ lợi nhuận sau thuế chưa phân phối căn cứ trên báo cáo tài chính kỳ gần nhất đã được kiểm toán hoặc soát xét.
- Hình thức phân chia lợi nhuận có thể bằng tiền hoặc bằng Chứng Chỉ Quỹ.
- Việc phân chia lợi nhuận của Quỹ được thực hiện trên cơ sở đề xuất của Công Ty Quản Lý Quỹ và phải được Đại Hội Nhà Đầu Tư hoặc Ban Đại Diện Quỹ (nếu được ủy quyền) chấp thuận.
- Nhà Đầu Tư có trong Danh sách Nhà Đầu Tư tại Ngày Giao dịch được công bố bởi Công Ty Quản Lý Quỹ cho việc phân chia lợi nhuận ("Ngày Chốt Danh Sách") được coi là đủ điều kiện để nhận lợi nhuận được phân chia. Trường hợp Nhà Đầu Tư đã chuyển nhượng số đơn vị quỹ của mình trong thời gian giữa thời điểm Ngày Chốt Danh Sách và thời điểm chi trả thì người chuyển nhượng là người nhận lợi nhuận.

11. Lợi nhuận thuần thực tế phân phối trên một đơn vị Chứng chỉ quỹ Quỹ (tại thời điểm 31/12/2018): Không phân phối

II. Số liệu hoạt động

1. Cơ cấu tài sản quỹ

Cơ cấu tài sản quỹ	31/12/2018 (%)	30/09/2018 (%)	30/06/2018 (%)
1. Danh mục chứng khoán cơ cấu	99,37	99,27	99,45
2. Tài sản khác	0,63	0,73	0,55
Cộng	100,0	100,0	100,0

2. Chi tiết chỉ tiêu hoạt động

Chi tiêu	31/12/2018	30/09/2018	30/06/2018
2.1. Giá trị tài sản ròng của Quỹ	115.890.856.890	133.895.082.672	125.050.988.218
2.2. Tổng số chứng chỉ quỹ đang lưu hành	9.700.000	9.700.000	9.700.000
2.3. Giá trị tài sản ròng của một đơn vị Chứng chỉ quỹ (CCQ)	11.947,51	13.803,61	12.891,85
2.4. Giá trị tài sản ròng cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	13.808,41	13.804,62	15.888,60
2.5. Giá trị tài sản ròng thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	11.944,86	11.912,13	12.212,59
2.6. Giá cuối ngày của 1 đơn vị CCQ tại ngày báo cáo	12.250	13.900	13.000
2.7. Giá cuối ngày cao nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	14.000	13.900	15.900
2.8. Giá cuối ngày thấp nhất của 1 đơn vị CCQ trong kỳ báo cáo	11.900	11.900	12.800
2.9. Tổng tăng trưởng (%) / 1 đơn vị CCQ	-13,45%	7,07%	-16,58%
2.9.1. Tăng trưởng vốn (%) / 1 đơn vị CCQ (Thay đổi do biến động giá)	Không áp dụng	Không áp dụng	Không áp dụng
2.9.2. Tăng trưởng thu nhập (%) / 1 đơn vị CCQ (Tính trên thu nhập đã thực hiện)	Không áp dụng	Không áp dụng	Không áp dụng
2.10. Phân phối gộp trên 1 đơn vị CCQ	0	0	0
2.11. Phân phối ròng trên 1 đơn vị CCQ	0	0	0
2.12. Ngày chốt quyền (Ex-date of distribution)	-	-	-
2.13. Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ (%)	1,36%	1,39%	1,33%
2.14. Tốc độ vòng quay danh mục (%)	81,07%	14,29%	268,01%

3. Tăng trưởng qua các thời kỳ

Giai đoạn	Tổng tăng trưởng của NAV/CCQ	Tăng trưởng NAV/CCQ hàng năm
- 1 năm	-7,08%	-7,08%
- 3 năm	54,42%	15,58%
- Từ khi thành lập*	19,48%	4,55%
- Tăng trưởng của chỉ số tham chiếu**	N/A	N/A

*Thời điểm được tính là thời điểm kết thúc giai đoạn huy động vốn của Quỹ là ngày 17/11/2014

** Từ 17/11/2014 đến 22/8/2017, Chỉ số tham chiếu là chỉ số HNX30, kể từ sau 22/8/2017, Chỉ số tham chiếu là chỉ số VNX50.

4. Tăng trưởng qua từng kỳ báo cáo

Thời kỳ	31/12/2018 (%)	30/09/2018 (%)	30/06/2018 (%)
Tỷ lệ tăng trưởng (%)/01 đơn vị CCQ (Kỳ báo cáo)	-13,45%	7,07%	-16,58%

III. Mô tả thị trường trong kỳ

Trong kỳ, Quỹ ETF SSIAM VNX50 (Quỹ) vẫn tiếp tục theo đuổi chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu bám sát tỷ lệ lợi nhuận của chỉ số tham chiếu là VNX50 và không chủ động lựa chọn cổ phiếu dựa trên các nhận định về tình hình kinh tế vĩ mô, phân tích ngành và phân tích công ty. Tại thời điểm cuối quý IV, danh mục chứng khoán cơ cấu của Quỹ là 50 cổ phiếu với tỷ trọng tương ứng với 50 cổ phiếu của chỉ số VNX50.

Tại thời điểm 27/12/2018, chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking Error) của Quỹ tiếp tục giảm xuống mức 0,08% thấp hơn rất nhiều so với quy định 10% của Sở giao dịch chứng khoán Tp. Hồ Chí Minh cho phép.

Trong kỳ, danh mục và tỷ trọng đầu tư của quỹ có một (01) lần thay đổi vào tháng 10/2018. Quỹ tái cơ cấu danh mục vào giai đoạn 17/10-24/10 năm 2018 do lịch tái cơ cấu định kỳ của chỉ số tham chiếu VNX50, cụ thể trong đợt review này Quỹ đã loại 5 cổ phiếu ASM, BID, DCM, ITA và GTN, thay bằng 5 cổ phiếu mới là EIB, HDB, VCS, VHM, VRE.

Trong kỳ, Quỹ đã bám sát khá tốt chỉ số tham chiếu, giá trị tài sản ròng/ chứng chỉ quỹ (NAV/CCQ) giảm -13,45%, tương tự mức giảm của chỉ số tham chiếu VNX50 Index. Khối lượng giao dịch chứng chỉ quỹ trung bình từ ngày 01/10/2018 tới ngày 31/12/2018 đạt 57,538 CCQ/phiên tăng nhẹ so với 2 quý trước.

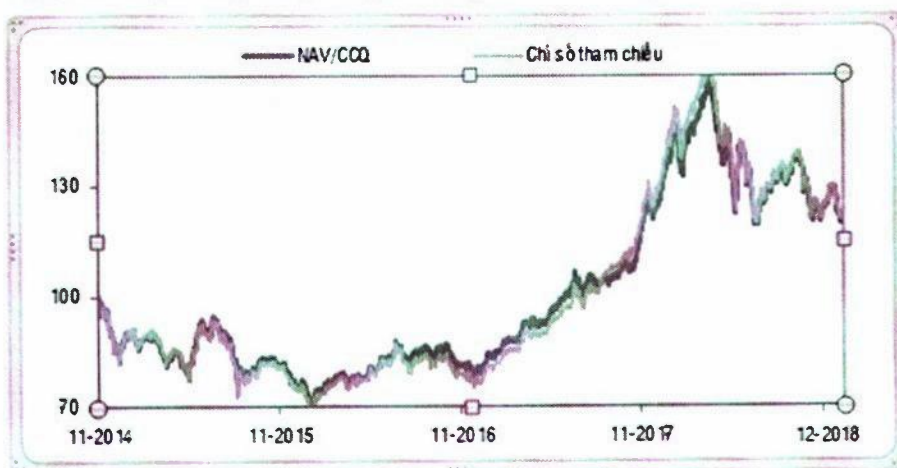
IV. Chi tiết các chỉ tiêu hoạt động của quỹ

4.1. 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 (%)
A	2	3	4
Tăng trưởng thu nhập/1 đơn vị CCQ (thu nhập đã thực hiện)	Không áp dụng	Không áp dụng	Không áp dụng
Tăng trưởng Vốn/1 đơn vị CCQ	Không áp dụng	Không áp dụng	Không áp dụng

Tổng tăng trưởng/1 đơn vị CCQ	-7,08%	54,42%	19,48%
Tăng trưởng hàng năm(%)/1 đơn vị CCQ	-7,08%	15,58%	4,55%
Tăng trưởng của danh mục cơ cấu	-5,58%	56,18%	20,45%
Thay đổi giá trị thị trường của 1 đơn vị CCQ	-4,74%	22,50%	22,50%

- **Vốn, Tổng tăng trưởng, Tăng trưởng hàng năm:** Dựa trên tăng trưởng của giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị chứng chỉ quỹ;
- **Chỉ số tham chiếu:** Dựa trên giá công bố giao dịch cuối cùng ở thời điểm gần nhất.
- **Biểu đồ tăng trưởng hàng tháng của Quỹ** từ khi thành lập đến thời điểm báo cáo



- **Thay đổi giá trị tài sản ròng**

Chỉ tiêu	31/12/2018	30/09/2018	Tỷ lệ thay đổi
A	1	2	$3 = \frac{(1)-(2)}{(2)}$
Giá trị tài sản ròng (NAV) của Quỹ	115.890.856.890	133.895.082.672	-13,45%
Giá trị tài sản ròng (NAV) trên 1 đơn vị CCQ	11.947,51	13.803,61	-13,45%

4.2. Thống kê về Nhà đầu tư nắm giữ Chứng chỉ quỹ tại thời điểm báo cáo (tại thời điểm gần nhất):

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
A	1	2	3
Dưới 5000	138	117.420	1,21%
Từ 5000 - 10.000	18	109.660	1,13%
Từ 10.000 đến 50.000	22	433.780	4,47%
Từ 50.000 đến 500.000	7	763.530	7,87%

Trên 500.000	6	8275.610	85,32%
Tổng cộng	191	9.700.000	100,00%

Ghi chú: Số liệu chốt tại ngày 09/04/2018

5. Chi phí ngầm và giảm giá

Công ty Quản lý quỹ SSI cam kết không có chi phí ngầm, giảm giá trong suốt quá trình hoạt động của Quỹ ETF SSIAM VNX50 và luôn bảo đảm tính độc lập trong quản lý Quỹ ETF.

V. Thông tin về triển vọng thị trường

Trong năm 2019, thị trường sẽ gặp nhiều khó khăn trong giai đoạn đầu năm do những tác động tiêu cực từ cuộc chiến tranh thương mại Mỹ - Trung và sẽ tiếp tục bị ảnh hưởng trong thời gian tới. Mặc dù triển vọng kinh tế Việt Nam tương đối sáng sủa và tốt hơn đáng kể so với các nước trong khu vực nhưng các lo ngại trên thị trường kinh tế thế giới vẫn tác động rất lớn đến tâm lý nhà đầu tư Việt Nam do đó sẽ dẫn đến hiện tượng trì trệ giao dịch. Thị trường sẽ khó có sự đột phá nào về giao dịch hay điểm số. Tuy nhiên, thị trường chứng khoán vẫn thể hiện tiềm năng tăng trưởng dài hạn cho nền kinh tế Việt Nam trong tương lai.

VI. 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

Người điều hành Quỹ

Ông Nguyễn Minh Hạnh - Giám đốc Đầu tư

- Ông Hạnh có nhiều năm kinh nghiệm trong lĩnh vực tài chính bao gồm phụ trách tài chính tại một số công ty sản xuất, trưởng phòng phân tích kiểm tra phòng phát triển chỉ số chứng khoán Công ty CP Chứng khoán Dầu khí (PSI) và tư vấn tái cấu trúc nhiều doanh nghiệp lớn tại Việt Nam như Mobifone, Tổng công ty Vàng Agribank, CTCP Thép Nam Kim,.... Ông Minh hiện là Thành Viên Hội Đồng Quản Trị của Công Ty Cổ Phần Transimex Sài Gòn.
- Ông Hạnh có bằng cử nhân kinh tế trường Đại học Kinh Tế Quốc Dân, Hà Nội.

Ông Nguyễn Bá Huy - Phó giám đốc Đầu Tư

- Ông Huy có trên 10 năm kinh nghiệm trong lĩnh vực phân tích, đầu tư, bao gồm các vị trí Phó giám đốc đầu tư (SSIAM); Giám đốc Phân tích (VNDIRECT); Giám đốc tư vấn đầu tư (KIS); và Chuyên viên phân tích (TVSI).
- Ông có bằng Cử nhân Tiếng Anh thương mại của trường Đại học Ngoại Thương Hà Nội.

Ban Đại diện Quỹ

Bà Trần Thị Thanh Y – Thành viên độc lập, Chủ tịch Ban Đại Diện Quỹ

Giám Đốc Hành Chính Và Kế Toán của Regus Center (Vietnam) Limited.

- Bà Trần Thanh Y có nhiều năm kinh nghiệm trong lĩnh vực kế toán, kiểm toán. Bà hiện đang là Giám Đốc Hành Chính Và Kế Toán của Regus Center (Vietnam) Limited. Trước đó Bà là Trưởng Phòng Hành Chính Và Kế Toán của Keppel Land và Kiểm Toán Viên Cao Cấp của Công Ty TNHH KPMG, một chi nhánh của KPMG toàn cầu, công ty chuyên về dịch vụ kiểm toán, thuế và tư vấn tài chính.
- Bà Trần Thanh Y có bằng Cử Nhân Tài Chính Và Ngân Hàng, trường Đại học Kinh tế Quốc, Chứng Chỉ Kiểm Toán Viên (CPA) của Bộ Tài Chính, Chứng Chỉ Kế Toán Trưởng của trường Đại Học Kinh Tế Quốc Dân, Chứng Chỉ Tài Chính Và Ngân Hàng của ING Bank, Sonny, Cambridge University Press.

Ông Nguyễn Thanh Phương – Thành viên độc lập

Chủ nhiệm khoa tài chính kiêm chủ nhiệm bộ môn kinh doanh chứng khoán, Học viên Ngân hàng.

- Ông Nguyễn Thanh Phương có nhiều năm kinh nghiệm trong lĩnh vực kinh doanh chứng khoán. Ông hiện là Chủ nhiệm khoa tài chính kiêm chủ nhiệm bộ môn kinh doanh chứng khoán của Học viện Ngân hàng. Trước đó Ông quản lý và giảng dạy tại bộ môn Kinh doanh chứng khoán thuộc Khoa tài chính, Học viện ngân hàng.
- Ông Nguyễn Thanh Phương có bằng Tiến Sĩ và Cao Học chuyên ngành Kinh tế tài chính – ngân hàng của Học viện ngân hàng, và bằng cử nhân ngành Tài chính-ngân hàng của Đại Học Kinh Tế Quốc Dân, Việt Nam.

Ông Nguyễn Khắc Hải – Thành viên

Phó Tổng Giám Đốc – The Pan Group

- Ông Hải hiện là Phó Tổng Giám đốc, Công Ty Cổ Phần Tập Đoàn PAN (“The Pan Group”)
- Trước khi gia nhập The Pan Group, ông là Phó Tổng giám đốc phụ trách luật và kiểm soát tuân thủ, phát triển kinh doanh, phát triển sản phẩm, vận hành, nhân sự và công nghệ thông tin của SSIAM. Ông Hải có nhiều năm kinh nghiệm tư vấn luật trong ngành công nghệ thông tin và tài chính cho HiPT, Vietcombank và SSIAM.
- Ông Hải là thành viên HĐQT của một số công ty niêm yết.
- Ông Hải có bằng Cử nhân Quản Trị Kinh Doanh chuyên ngành Luật Kinh Doanh của trường Đại Học Kinh Tế Quốc Dân Hà Nội, và bằng Thạc sỹ Luật tại trường Nagoya University, Nhật Bản.

Ban Điều hành SSIAM

Bà Lê Thị Lệ Hằng - Tổng Giám Đốc

- Bà Lê Thị Lệ Hằng được bổ nhiệm là Tổng Giám Đốc SSIAM từ năm 2010. Bà có trên 13 năm kinh nghiệm trong lĩnh vực phân tích và quản lý đầu tư (bao gồm hơn 8 năm kinh nghiệm làm việc tại Công Ty Quản Lý Quỹ W.P. Stewart tại New York, Hoa Kỳ, và 3 năm là Giám Đốc Khối Phân Tích và Tư Vấn Đầu Tư, Trợ Lý cho Chủ Tịch HĐQT và Giám Đốc Khối Phát Triển Khách Hàng Tổ Chức của Công ty CP Chứng Khoán Sài Gòn).
- Bà Hằng hiện là Phó Chủ Tịch Câu Lạc Bộ Các Công Ty Quản Lý Quỹ.
- Bà là thành viên HĐQT của một số công ty niêm yết
- Bà Hằng có bằng Thạc Sĩ Tài Chính và Cử Nhân Kế Toán của trường American University, Hoa Kỳ.

Ông Nguyễn Phan Dũng - Phó Tổng Giám Đốc

- Gia nhập SSIAM từ năm 2007, ông Dũng hiện là Phó Tổng Giám Đốc phụ trách mảng tư vấn đầu tư của SSIAM. Ông Dũng có nhiều kinh nghiệm trong lĩnh vực phân tích với các định chế tài chính như Chicaco Board of Trade, National Securities Corporation và Ngân hàng ABN AMRO ở Chicago, Hoa Kỳ.
- Ông Dũng là thành viên HĐQT của một số công ty niêm yết.
- Ông có bằng Cử nhân Kinh tế của trường Knox College, và MBA của trường Loyola University, Chicago, Hoa Kỳ, nơi ông là thành viên của chương trình Beta Gamma Sigma và cũng là thành viên của Hiệp hội Quản lý Rủi ro Quốc tế.

Bà Tô Thùy Linh – Phó Tổng Giám Đốc

- Gia nhập SSIAM từ năm 2011, Bà Linh hiện là Phó Tổng Giám Đốc phụ trách các lĩnh vực phát triển kinh doanh, phát triển sản phẩm, vận hành, luật và kiểm soát tuân thủ, nhân sự và công nghệ thông tin của SSIAM. Trước đó, Bà là Giám Đốc phát triển sản phẩm của SSIAM.

- Bà Linh có bằng Thạc Sĩ chuyên ngành Ngân hàng của trường New South Wales University và Cử Nhân chuyên ngành Tài chính và Kế toán của trường Sydney University, Úc. Bà là thành viên của chương trình Beta Gamma Sigma, Hoa Kỳ.

Hà Nội, ngày 18 tháng 01 năm 2019

Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI *ml*



Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

