

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.: *154* /2018/TB-SSIAM-NVQ

Hà Nội, ngày 30 tháng 03 năm 2018
Ha Noi, 30 March 2018

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

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

Kính gửi/ To:

- Ủy ban Chứng khoán Nhà nước/ *The State Securities
Commission*
- 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 tài chính kiểm toán Quỹ ETF SSIAM VNX50 năm 2017
- Phụ lục 16 - báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ của Công Ty Quản Lý Quỹ cho Quỹ ETF SSIAM VNX50

Thông tin này đã được công bố trên trang thông tin điện tử của công ty/quỹ vào ngày 30/03/2018 tại đường dẫn : <https://www.ssi.com.vn>

*This information was disclosed on Company/Fund's Portal on date 30/03/2018
Available at: <https://www.ssi.com.vn>*

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 tài chính kiểm toán năm Quỹ ETF SSLAM VNX50
- Phụ lục 16 báo cáo tổng kết hoạt động quản lý quỹ của Công Ty Quản Lý Quỹ cho Quỹ ETF SSLAM VNX50

Người công bố thông tin



Tô Thùy Linh
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC



BÁO CÁO TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ CHO NĂM 2017 QUỸ ETF SSIAM VNX50

(thực hiện theo mẫu tại Phụ lục 16, ban hành kèm theo Thông tư Số 229/2012/TT-BTC ngày 27/12/2012 của Bộ Tài Chính hướng dẫn về việc thành lập và quản lý quỹ hoán đổi danh mục)

1. THÔNG TIN VỀ QUỸ

a) Tên của quỹ: Quỹ ETF SSIAM VNX50

Loại hình quỹ: Quỹ hoán đổi danh mục

b) Mục tiêu đầu tư 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.

c) Thời hạn hoạt động của quỹ: Không giới hạn

d) Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio): Chỉ số VNX50

e) Chính sách phân chia lợi nhuận

- 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.

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành (tại thời điểm 31/12/2017): 9.700.000 CCQ

W

g) Nội dung thay đổi tại Điều Lệ Quỹ trong kỳ báo cáo:

Vui lòng xem Tờ trình Sửa Điều lệ Quỹ Đại hội nhà đầu tư bất thường tháng 7 năm 2017 theo đường link sau:

<https://www.ssi.com.vn/layouts/~media/PDFs/SSIAM/Announcement/1%20To%20trinh%20dai%20hoi%20ETF%20final.ashx>

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo:

Vui lòng xem Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư thường niên năm 2017 theo đường link sau

<https://www.ssi.com.vn/layouts/~media/PDFs/SSIAM/Reports/ETF-HNX30/01%20Ngh%20Quy%20ETF%202017.ashx>

và Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư bất thường tháng 7 năm 2017 theo đường link sau

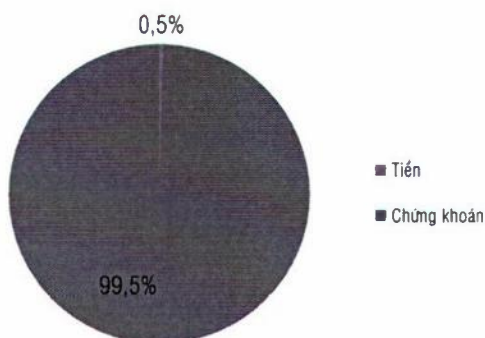
<https://www.ssi.com.vn/layouts/~media/PDFs/SSIAM/Announcement/1%20Ngh%20quyet%20ho%20p%20ETF%201907.ashx>

2. BÁO CÁO VỀ KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ

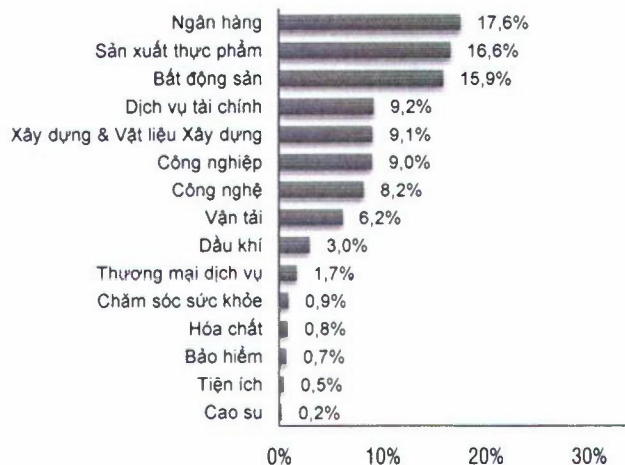
a) Thông tin về danh mục đầu tư và giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12/2017

- Danh mục đầu tư của Quỹ phân bổ theo ngành, lĩnh vực và loại sản phẩm (cổ phiếu, trái phiếu...)

Phân bổ tài sản



Cơ cấu danh mục theo ngành (%NAV)



- Giá trị tài sản ròng của quỹ: VND 124.746.324.328
- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ: VND 12.860,44
- Số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành: 9.700.000 đơn vị quỹ
- Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cao nhất/thấp nhất trong năm: VND 12.860,44/VND 8.161,63

- Tổng lợi nhuận của Quỹ, nêu chi tiết phần lợi nhuận thu được từ sự tăng trưởng giá chứng khoán (giá trị lãi vốn) và phần lợi nhuận thu được từ lợi tức chứng khoán (cổ tức, trái tức, lãi suất tiền gửi...) (giá trị thu nhập):
 - Lãi (lỗ) bán các khoản đầu tư: 11.782.848.823 VND
 - Chênh lệch tăng, giảm đánh giá lại các khoản đầu tư chưa thực hiện: 35.644.502.863 VND
 - Thu nhập từ thu cổ tức: 1.954.124.864 VND
- Chi phí hoạt động của Quỹ trong giai đoạn từ 01/01/2017 đến 31/12/2017: 1.664.793.546 VND
- Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận trong năm 2017.
- Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ và tốc độ quay vòng danh mục giai đoạn năm 2017:
 - Tỷ lệ chi phí hoạt động của Quỹ năm 2017: 2,04%
 - Tốc độ vòng quay danh mục của Quỹ năm 2017: 119,73%

b) Chi tiêu về lợi nhuận của quỹ

- Tổng lợi nhuận bình quân năm của Quỹ tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo: 9.139.923.051 VND

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

3. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ TÀI SẢN CỦA CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ

Quỹ ETF SSIAM HNX30 (tiền thân của Quỹ ETF SSIAM VNX50 "Quỹ") được thành lập ngày 10 tháng 12 năm 2014 theo Giấy chứng nhận đăng ký thành lập số 17/GCN-UBCK ngày 10 tháng 12 năm 2014 do Ủy ban Chứng khoán Nhà nước cấp. Quỹ được tổ chức dưới hình thức quỹ hoán đổi danh mục theo quy định của pháp luật Việt Nam.

Ngày 21 tháng 8 năm 2017, Ủy Ban Chứng Khoán Nhà Nước đã cấp giấy phép chứng nhận sửa đổi số 02/GCN-UBCK đổi tên Quỹ ETF SSIAM HNX30 thành Quỹ ETF SSIAM VNX50. Chứng chỉ quỹ được niêm yết tại Sở Giao Dịch Chứng Khoán Thành phố Hồ Chí Minh ("HOSE") theo Quyết định số 369/QĐ-SGDHCM ngày 17 tháng 10 năm 2017 do HOSE cấp.

- a) Trong năm 2017, Quỹ theo đuổi chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu bám sát tỷ lệ lợi nhuận của chỉ số tham chiếu. Từ 1/1/2017 đến 22/8/2017, chỉ số tham chiếu của Quỹ là HNX30, và từ 23/8/2017 đến 31/12/2017, chỉ số tham chiếu là VNX50. Quỹ 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 ngày 31/12/2017, Quỹ đầu tư 50/50 cổ phiếu trong danh mục rổ VNX50 với tỷ trọng tương ứng nhằm bám sát tỷ lệ sinh lời của chỉ số VNX50.
- b) Chênh lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking error) trong kỳ của chứng chỉ quỹ (CCQ) luôn dưới mức 2,43% đạt tiêu chí đầu tư của quỹ.
- c) Trong năm 2017, danh mục đầu tư của quỹ có thay đổi cơ cấu 5 lần, trong đó, 1 lần tái cơ cấu do thay đổi chỉ số tham chiếu vào tháng 8 và 4 lần tái cơ cấu vào tháng 1, 4, 7 và tháng 12 do Sở giao dịch chứng khoán Hà Nội và Sở giao dịch chứng khoán Tp Hồ Chí Minh tái cơ cấu lại danh mục và thay đổi tỷ lệ tự do chuyển nhượng (freefloat) của chỉ số HNX30 và VNX50 theo kỳ. NAV/CCQ trong kỳ tăng 60%.

d) Năm 2017 vừa qua, nền kinh tế nói chung và thị trường chứng khoán Việt Nam nói riêng gặt hái được những thành công vượt bậc, mức tăng trưởng được ghi nhận ở nhiều chỉ tiêu đánh giá.

- GDP năm 2017 đạt mức tăng trưởng ấn tượng 6,81% so với cùng kỳ năm trước, vượt mục tiêu ban đầu là 6,7% và cao hơn mức tăng trưởng hàng năm từ 2011-2016.
- GDP bình quân đầu người ước đạt 2.385 USD, tăng 170 USD so với năm 2016 và tạo ra mức tăng trưởng cho lĩnh vực bán lẻ +9,46% so với cùng kỳ.
- Tỷ lệ lạm phát được duy trì ở mức thấp (trung bình 3,53% YoY), tỷ giá ổn định, dự trữ ngoại tệ tăng vọt lên mức kỷ lục khoảng 52 tỷ USD
- Tổng xuất nhập khẩu của Việt Nam đạt 425 tỷ USD (193% GDP). Chênh lệch xuất nhập khẩu tạo ra thặng dư thương mại trị giá 2,7 tỷ USD.
- Cán cân thanh toán (BOP) được hỗ trợ mạnh mẽ bởi dòng vốn FDI. Năm 2017, FDI đăng ký và đầu tư FII tăng 44,4% (35,88 tỷ USD), với 29,66 tỷ USD vốn FDI và 6,19 tỷ USD cho đầu tư cổ phần. Việc giải ngân FDI cũng đạt mức cao nhất là 17,5 tỷ USD. Nhờ đó dự trữ ngoại tệ của Việt Nam đã đạt mức cao trong thời gian này là 52 tỷ USD. Đồng tiền Việt Nam (VNĐ) trở thành đồng tiền mạnh và duy trì ổn định nhất tốt nhất trong khu vực nếu so sánh với USD.
- Năm 2017 còn là một năm thành công của NHNN khi có mức tăng trưởng tín dụng cao (+19%) trong điều kiện lạm phát thấp. NHNN đã thành công trong việc duy trì chi phí vay vốn thấp cho doanh nghiệp.
- Do sự bùng nổ của giá cổ phiếu ngân hàng, nhiều ngân hàng đã có thể tăng vốn để phục vụ cho mục tiêu tăng trưởng trong giai đoạn tới. Môi trường kinh doanh thuận lợi cũng giúp ngân hàng giải quyết vấn đề nợ xấu và tăng tính thanh khoản của dòng vốn.
- Nhờ GDP tăng trưởng, thâm hụt ngân sách cũng giảm về mức 3,42% GDP (so với mục tiêu nợ dưới 5%) và tỉ lệ Nợ công/GDP là 63,9% (dưới 65% mục tiêu trần).
- Chính phủ đã thành công trong việc tái cơ cấu sở vay với thời gian đáo hạn trái phiếu Chính phủ trung bình từ năm 2017 đến 12,75 năm (cao hơn 8,7 năm so với năm 2016) và tổng thời gian đáo hạn của danh mục nợ Chính phủ là 6,75 năm so với 5,98 năm cuối năm 2016.

Với nền tảng vĩ mô và dòng tiền thuận lợi, thị trường chứng khoán Việt Nam năm 2017 được có mức tăng trưởng ấn tượng +48% so với năm 2016. Riêng trong tháng 12/2017, VN-Index chạm mốc 984,24 điểm, tương ứng với mức tăng 3,6%. Nhóm ngành dầu khí tăng mạnh đóng góp vào mức tăng trưởng của VN-Index trong tháng như: PVS (+29,67%), GAS (+22,21%), PVD (+24,53%). Bên cạnh đó, việc thoái vốn thành công tại SAB khiến SAB tăng 11,73%, các mã vốn hóa lớn cũng tăng như MSN (+14,31%), VIC (+11,96%), HPG (+13,71%), VJC (+8,74%). Chỉ số tham chiếu VNX50 cũng tăng ở mức 3,9%, cũng với sự đóng góp của các mã nêu trên.

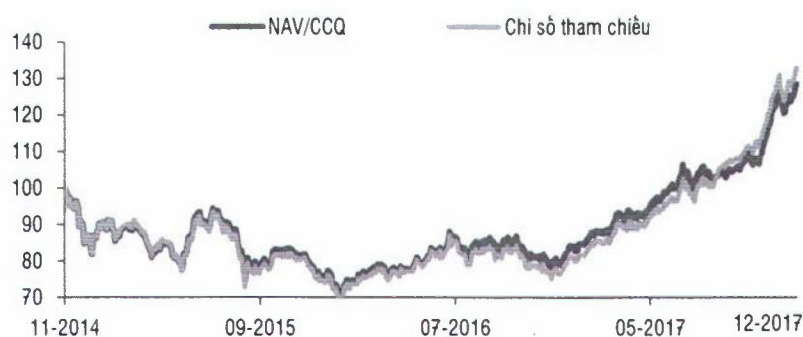
e) Trong năm 2017, Quý có giao dịch hoán đổi mua lại 1 lô CCQ (tương đương 100.000 CCQ), nên tổng số lượng CCQ giảm từ 9.800.000 xuống còn 9.700.000 CCQ

CHỈ TIÊU TÀI CHÍNH TẠI NGÀY 31/12/2017

NAV/CCQ	12.860,44	Tăng trưởng (Từ ngày kết thúc đăng ký góp vốn 17/11/2014)	
Giá đóng cửa của CCQ trên sàn HOSE	12.860		
Sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu	2,43%	Chỉ số tham chiếu (*)	32,88%
Tổng số lượng CCQ lưu hành	9.700.000	NAV/CCQ	28,60%

(*) 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.

BIẾN ĐỘNG NAV VÀ CHỈ SỐ THAM CHIẾU VNX50



LỢI NHUẬN ĐẦU TƯ ĐỐI VỚI CÁC LOẠI TÀI SẢN

Lãi/lỗ theo tài sản	Lãi/lỗ đã thực hiện	Lãi/lỗ chưa thực hiện
Cổ phiếu	11.782.848.823	35.644.502.863
<i>Trong đó:</i>		
Vốn hóa lớn	12.200.668.511	21.938.669.689
Vốn hóa vừa	604.568.537	10.552.842.413
Vốn hóa nhỏ	(1.022.388.225)	3.152.990.761

4. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG GIÁM SÁT CỦA NGÂN HÀNG GIÁM SÁT

Vui lòng xem ý kiến từ Ngân hàng giám sát về sự tuân thủ quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch của Công ty quản lý quỹ trong quá trình vận hành và quản lý quỹ ETF trong kỳ



NHGS_V.pdf

đính kèm :

5. BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG ỦY QUYỀN

Đối với quỹ ETF SSIAM VNX50, các đơn vị nhận ủy quyền bao gồm:

- Ngân hàng Giám sát của Quỹ cho giai đoạn từ ngày 1 tháng 1 năm 2017 đến ngày 22 tháng 8 năm 2017 là Ngân hàng TNHH Một Thành viên Standard Chartered (Việt Nam). Ngân hàng Giám sát của Quỹ cho giai đoạn từ ngày 23 tháng 8 năm 2017 đến 31 tháng 12 năm 2017 là Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam – Chi nhánh Hà Thành.
- Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam cung cấp dịch vụ đại lý chuyển nhượng.
- Sở Giao Dịch Chứng Khoán Hà Nội cung cấp dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu từ 1/1/2017 đến 31/8/2017, Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp Hồ Chí Minh cung cấp dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu từ 24/10/2017 đến 31/12/2017.

- Đại lý phân phối kiêm Thành viên lập quỹ
 - Công ty cổ phần chứng khoán Sài Gòn (SSI)
 - Công ty cổ phần chứng khoán Bảo Việt (BVSC)
 - Công ty TNHH chứng khoán Ngân Hàng Ngoại Thương Việt Nam (VCBS)
 - Công ty cổ phần chứng khoán VNDirect (VNDS)

a) Chi phí phải trả cho bên nhận ủy quyền so với lợi nhuận, thu nhập, tổng chi phí hoạt động của Quỹ:

	Tổng chi phí năm 2017 (VNĐ)	Tỷ lệ so với Lợi nhuận	Tỷ lệ so với Thu nhập	Tỷ lệ so với Tổng chi phí hoạt động Quỹ
Phí dịch vụ quản trị quỹ	236.925.806	0,50%	0,48%	14,23%
Phí đại lý chuyển nhượng	66.000.000	0,14%	0,13%	3,96%
Phí dịch vụ quản lý và vận hành chỉ số tham chiếu	16.000.000	0,03%	0,03%	0,96%
Phí dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu	0	0,00%	0,00%	0,00%
Phí dịch vụ Đại lý phân phối	1.211.338	0,003%	0,002%	0,07%
Tổng chi phí cho hoạt động ủy quyền	320.137.144	0,68%	0,65%	19,23%

b) Để quản lý và phòng ngừa rủi ro liên quan đến các hoạt động ủy quyền bao gồm dịch vụ quản trị quỹ, dịch vụ đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu, Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI đã thực hiện các biện pháp cụ thể như sau:

- Ký kết các hợp đồng chi tiết cung cấp dịch vụ, bản ghi nhớ hoạt động trong phạm vi dịch vụ với các bên nhận ủy quyền, trong đó nêu rõ trách nhiệm của bên nhận ủy quyền.
- Nhân viên giám sát hoạt động ủy quyền (theo sự phân công của Công Ty) đã phối hợp chặt chẽ với các bên nhận ủy quyền tuyệt đối tuân thủ các chính sách và quy trình liên quan được quy định trong hợp đồng cung cấp dịch vụ.
- Thường xuyên kiểm tra, giám sát bảo đảm hoạt động đã được ủy quyền được thực hiện thận trọng, an toàn, phù hợp với quy định của pháp luật, quy định tại Điều Lệ Quỹ, bảo đảm chất lượng dịch vụ cung cấp phù hợp với tiêu chí và yêu cầu của Công Ty Quản Lý Quỹ.

c) Đánh giá về hoạt động của các đơn vị nhận ủy quyền

Trong năm 2017, các đơn vị nhận ủy quyền cung cấp dịch vụ quản trị quỹ, đại lý chuyển nhượng, dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu cho Quỹ đã duy trì đủ trang thiết bị cơ sở vật chất, giải pháp kỹ thuật, an ninh hệ thống, hệ thống dự phòng thảm họa, hệ thống dự phòng nóng, quy trình nghiệp vụ, hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, nhân sự có kinh nghiệm và trình độ chuyên môn phù hợp để thực hiện các hoạt động ủy quyền. Các hoạt động ủy quyền trong năm đã được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của Nhà Đầu Tư của Quỹ.

Đánh giá dịch vụ Quản trị Quỹ

Ngân hàng BIDV- chi nhánh Hà Thành hiện đang là đơn vị được ủy quyền hoạt động dịch vụ Quản trị Quỹ. Các hệ thống hiện có để cung cấp dịch vụ Quản trị Quỹ có nhiều ưu điểm, được áp dụng rộng rãi trên toàn cầu và được thiết lập cơ chế bảo mật do mỗi hệ thống khi thiết lập quyền truy cập đều có các nguyên tắc thiết lập mang tính bảo mật cao. Hệ thống kế toán và định giá chứng chỉ quỹ của Ngân hàng đã đáp ứng được yêu cầu của Công ty Quản Lý Quỹ. Hệ thống này được cập nhật hai năm một lần bao gồm phát triển các tính năng mới và phát triển theo nhu cầu riêng của từng thị trường nên đã đáp ứng được các yêu cầu về hạch toán tại Việt Nam. Các hệ thống đều được lưu trữ dữ liệu hàng kỳ và có chương trình dự phòng thảm họa. Quy trình dự phòng thảm họa của Ngân hàng được thiết lập chi tiết, bài bản để khắc phục các thảm họa trong khoảng thời gian phù hợp nhất để đảm bảo hoạt động ít bị ảnh hưởng và các tổn thất là tối thiểu.

Dữ liệu được lưu trữ đúng theo quy định hiện hành của Pháp luật Việt Nam. Hệ thống lưu trữ thông tin của khách hàng luôn được bảo mật cao với cơ chế bảo mật tối đa. Ngoài dữ liệu dạng cứng, ngân hàng còn thiết lập quy trình đảm bảo bảo mật thông tin một cách hiệu quả qua dữ liệu gửi qua email với các phương thức bảo mật như: tường lửa, yêu cầu xác nhận, thẩm quyền trong quá trình tương tác thông tin.

Hệ thống quản trị rủi ro của Ngân hàng đảm bảo tất cả nhân viên của Ngân hàng tại các vị trí đều có trách nhiệm kiểm soát và tuân theo chính sách quản trị rủi ro. Các báo cáo chỉ số đánh giá hoạt động chính và báo cáo tiêu chuẩn kiểm soát chính được thực hiện hàng tháng và được xem xét bởi Ủy Ban Quản lý rủi ro tại các cuộc họp về rủi ro quản trị. Ngân hàng xây dựng các phương pháp nhằm hạn chế các rủi ro về hoạt động, rủi ro công nghệ, và rủi ro con người.

Đánh giá dịch vụ Đại Lý Chuyển Nhượng

Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam đang là nhà cung cấp dịch vụ Đại lý chuyển nhượng cho Quỹ.

Về cơ sở vật chất kỹ thuật, hệ thống cung cấp dịch vụ Đại lý chuyển nhượng quỹ hoán đổi danh mục của VSD có các tính năng đáp ứng các nhu cầu dịch vụ của Đại Lý Chuyển Nhượng. Hệ thống có chức năng phân quyền linh hoạt, có thiết kế mở cho phép kết nối với các hệ thống thành viên khác. Hệ thống đáp ứng đầy đủ nhu cầu về nghiệp vụ Đại lý Chuyển Nhượng về việc Quản lý sổ nhà đầu tư, quản lý dữ liệu, phân bổ giao dịch và các hoạt động khác đáp ứng nhu cầu của Công Ty Quản Lý Quỹ, Đại lý phân phối, và Ngân hàng giám sát, tổ chức cung cấp dịch vụ quản trị quỹ....

Quy trình lưu trữ dữ liệu và kế hoạch dự phòng dữ liệu đảm bảo được quy trình được diễn ra thông suốt. Hệ thống máy chủ của dịch vụ được đặt tại Trụ sở chính Hà Nội. Hệ thống dự phòng được đặt tại chi nhánh của VSD tại Hồ Chí Minh, đồng thời dữ liệu được sao lưu hàng ngày ra băng từ và được lưu trữ tại VSD và lưu trữ từ xa. Dữ liệu hàng ngày được đồng bộ từ hệ thống chính vào hệ thống dự phòng và được khởi động trong vòng 30 phút kể từ khi có sự cố xảy ra.

Đánh giá dịch vụ tính Giá Trị Tài Sản Ròng tham chiếu (iNAV) và dịch vụ Quản Lý Và Vận Hành Chỉ Số Tham Chiếu

Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp Hồ Chí Minh hiện đang là tổ chức cung cấp dịch vụ tính giá trị tài sản ròng tham chiếu và dịch vụ Quản lý và Vận hành chỉ số tham chiếu cho Quỹ.

Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp Hồ Chí Minh đã đáp ứng được các yêu cầu về cơ sở vật chất kỹ thuật. Quy trình nghiệp vụ được thực hiện chính xác, giá trị Tài sản ròng tham chiếu trên một chứng chỉ quỹ (iNAV) được công bố mười lăm giây một lần và được công bố trên các trang thông tin điện tử

của Sở Giao Dịch Chứng Khoán. Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp Hồ Chí Minh đã tính toán mức sai lệch đúng theo công thức quy định tại Thông tư 229/2012/TT-BTC.

Đánh giá dịch vụ Đại Lý Phân Phối

Các Đại lý phân phối đều đáp ứng được yêu cầu về việc kết nối với Trung Tâm Lưu Ký Chứng Khoán Việt Nam, đảm bảo quy trình nghiệp vụ của Đại lý phân phối diễn ra thông suốt không bị gián đoạn. Đại lý phân phối đã đáp ứng được yêu cầu về Quy trình ngân giao dịch mượn, các quy trình về lưu trữ thông tin và bảo mật thông tin khách hàng.

Công Ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI



TỔNG GIÁM ĐỐC
Lê Thị Lệ Hằng



Quỹ ETF SSIAM VNX50

BÁO CÁO CỦA NGÂN HÀNG GIÁM SÁT

Chúng tôi là Ngân hàng giám sát Quỹ ETF SSIAM VNX50 tại ngày 31 tháng 12 năm 2017, với sự hiểu biết của chúng tôi thì trong năm tài chính 2017 Quỹ ETF SSIAM VNX50 đã hoạt động và được quản lý với các nội dung dưới đây:

1. Giai đoạn từ 01/07/2017 đến ngày 23/08/2017: Ngân hàng Giám sát Quỹ là Ngân hàng TNHH Standard Chartered Bank Việt Nam

Theo dữ liệu nhận bàn giao từ Ngân hàng TNHH Standard Chartered Bank Việt Nam thì:

- Tại các kỳ định giá từ ngày 18/08/2017 đến ngày 22/08/2017, cơ cấu danh mục đầu tư của Quỹ phát sinh sai lệch so với danh mục của chỉ số tham chiếu HNX30 theo quy định tại Thông tư 229/2012/TT-BTC và Điều lệ Quỹ

- Tại kỳ định giá ngày 23/08/2017, Quỹ được UBCKNN chấp thuận chuyển đổi chỉ số tham chiếu từ chỉ số HNX30 sang chỉ số VNX50 dẫn đến cơ cấu danh mục đầu tư của Quỹ phát sinh sai lệch so với danh mục của chỉ số tham chiếu VNX50 theo quy định tại Thông tư 229/2012/TT-BTC và Điều lệ Quỹ.

2. Giai đoạn từ ngày 25/08/2017: Ngân hàng Giám sát Quỹ là Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành.

Theo ghi nhận của Ngân hàng chúng tôi, từ ngày 29/08/2017 Quỹ đã thực hiện giải ngân vào các cổ phiếu thuộc danh mục chỉ số tham chiếu VNX50 theo quy định tại Thông tư 229/2012/TT-BTC và Điều lệ Quỹ.

a) Công ty quản lý quỹ SSI 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 ETF, Điều lệ và Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan. Tuy nhiên:

- Tại kỳ định giá xác định giá trị tài sản ròng ngày 13-14/12/2017, giá trị danh mục chứng khoán cơ cấu của Quỹ chưa đảm bảo 95% giá trị của danh mục chứng khoán tương ứng. Quỹ đã tạm dừng giao dịch hoán đổi từ ngày 19/12 – 21/12/2017 để cơ cấu danh mục đầu tư.

b) Việc định giá, đánh giá tài sản của Quỹ ETF SSIAM VNX50 đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.

c) Phát hành và mua lại Chứng chỉ quỹ đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.

d) Trong kỳ, quỹ ETF SSIAM VNX50 không phát sinh hoạt động phân phối lợi nhuận

ĐẠI DIỆN NGÂN HÀNG GIÁM SÁT



Bà Lê Mỹ Linh
Phó Giám đốc

NHÂN VIÊN GIÁM SÁT

Ông Dương Thanh Dũng