**Phụ lục số 28**

**Nội dung Báo cáo hoạt động quản lý quỹ mở của Công ty quản lý quỹ**

*(ban hành kèm theo Thông tư hướng dẫn về việc thành lập và quản lý quỹ mở)*

**BÁO CÁO VỀ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ**

*(Từ ngày 01/01/2020 đến ngày 30/06/2020)*

**1. Thông tin về quỹ**

a) Tên của quỹ:

- Tên quỹ: **Quỹ Đầu tư Trái phiếu Mở rộng Chubb (CBPF)**

- Loại hình quỹ: **Quỹ mở**

b) Mục tiêu đầu tư của quỹ:

Mục tiêu đầu tư của Quỹ là tối đa hóa lợi nhuận đồng thời bảo toàn vốn cho Nhà Đầu tư thông qua việc đầu tư vào các tài sản có thu nhập cố định, an toàn và một phần vào các cổ phiếu cơ bản có hoạt động kinh doanh tốt và được tự do chuyển nhượng với mục đích phân tán rủi ro đầu tư và mang lại cho các Nhà Đầu tư kết quả tốt nhất từ việc quản lý danh mục đầu tư phù hợp với các quyết định của Đại hội Nhà Đầu tư và Pháp luật.

c) Thời hạn hoạt động của quỹ (nếu có): Quỹ không giới hạn về thời gian hoạt động

d) Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio) : Không áp dụng

e) Chính sách phân chia lợi nhuận: Quỹ phân phối lợi nhuận cho nhà đầu tư dựa trên Nghị quyết của Đại hội nhà đầu tư, phù hợp với Điều lệ của Quỹ và quy định của pháp luật chứng khoán hiện hành.

f) Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành: 10.058.831,58 đơn vị quỹ

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

*(Các nội dung sửa đổi, bổ sung được gạch chân hoặc gạch bỏ, và in nghiêng)*

|  |  |
| --- | --- |
| **1** | **Mục Căn cứ pháp lý:**  **Bổ sung khoản 10**  *10. Thông tư số 91/2019/TT-BTC sửa đổi, bổ sung một số Thông tư quy định về chế độ báo cáo và thủ tục hành chính áp dụng với công ty quản lý quỹ, quỹ đầu tư chứng khoán và công ty đầu tư chứng khoán* |
| **2** | Chương I – Điều 4 Bổ sung Khoản 4.3:  *4.3*. *Quỹ không bị giới hạn về giá trị vốn góp tối đa của Nhà Đầu tư hoặc số lượng tối đa Đơn vị Quỹ được phát hành trừ khi Đại hội Nhà Đầu tư có quyết định khác.* |
| **3** | **Chương IV – Điều 21**  **Sửa đổi Khoản 21.1, 21.2 & 21.5:**  21.1.Đại hội Nhà Đầu tư là cơ quan có thẩm quyền cao nhất của Quỹ. Tất cả các Nhà Đầu tư có tên trong danh sách đăng ký Nhà Đầu tư trước khi triệu tập cuộc họp Đại hội Nhà Đầu tư đều có quyền tham dự đại hội. Đại hội Nhà Đầu tư thông qua các quyết định thuộc thẩm quyền bằng hình thức biểu quyết tại cuộc họp *~~hoặc~~,* lấy ý kiến bằng văn bản, *bỏ phiếu điện tử E-voting, tham dự hội nghị trực tuyến thông qua điện thoại, internet hoặc các phương tiện truyền tin nghe nhìn khác* theo quy định tại Điều lệ Quỹ *và phù hợp với quy định của pháp luật*. Chubb Life FMC, Ban Đại diện Quỹ có trách nhiệm xem xét đảm bảo rằng mọi quyết định của Đại hội Nhà Đầu tư là phù hợp với quy định của Pháp luật và Điều lệ quỹ. Trường hợp quyết định không phù hợp với quy định của Điều lệ quỹ và Pháp luật, thì phải tổ chức họp lại Đại hội Nhà Đầu tư hoặc lấy ý kiến bằng văn bản để biểu quyết và thông qua.  21.2. Cuộc họp Đại hội Nhà Đầu tư thường niên do Chubb Life FMC triệu tập và được tổ chức trong vòng ba mươi (30) ngày, kể từ ngày có báo cáo tài chính năm đã được kiểm toán bởi tổ chức kiểm toán được chấp thuận. *Tùy thuộc quyết định của Chubb Life FMC, việc họp Đại hội Nhà Đầu tư thường niên có thể được tổ chức theo hình thức họp trực tiếp hoặc theo hình thức lấy ý kiến bằng văn bản theo thể thức quy định tại Điều 24 Điều lệ Quỹ và phù hợp với quy định của pháp luật.*  21.5. Trừ trường hợp buộc phải tổ chức họp để lấy ý kiến của Đại hội Nhà Đầu tư về các vấn đề quy định tại khoản 2, 3 hoặc 4 của Điều 22 dưới đây, tùy thuộc vào quyết định riêng của Chubb Life FMC, Chubb Life FMC có thể lấy ý kiến Nhà Đầu tư bằng văn bản theo thể thức quy định tại Điều lệ quỹ và *phù hợp với các quy định của pháp luật* để thông qua các quyết định thuộc thẩm quyền của Đại hội Nhà Đầu tư.  **Bổ sung Khoản 21.6:**  21.6*. Ban Đại diện Quỹ được thay mặt Nhà Đầu tư xem xét thông qua quy chế của việc tổ chức họp Đại hội Nhà Đầu tư hoặc lấy ý kiến Nhà đầu tư bằng văn bản dưới các hình thức hội nghị trực tuyến, bỏ phiếu điện tử hoặc các hình thức điện tử khác tuân thủ theo các Quy định Pháp luật hiện hành.* |
| **5** | **Chương IV- Điều 24:**  **Sửa đổi Khoản 24.1.c**  24.1 Trường hợp lấy ý kiến bằng văn bản, của các Nhà Đầu tư, Chubb Life FMC phải thực hiện các công việc và tuân thủ các nguyên tắc, trình tự, thủ tục như sau:  **……..**  c) gửi phiếu hỏi ý kiến, dự thảo quyết định của Đại hội Nhà Đầu tư, cùng tài liệu liên quan, kể cả tài liệu giải trình dự thảo quyết định của Đại hội Nhà Đầu tư đến tất cả các Nhà Đầu tư có quyền cho ý kiến bằng văn bản và UBCKNN tối thiểu mười (10) ngày trước thời hạn cuối cùng gửi ý kiến về Chubb Life FMC.  Nhà Đầu tư có thể gửi phiếu lấy ý kiến đã trả lời đến Chubb Life FMC theo một trong các hình thức sau đây:   * gửi thư: Phiếu hỏi ý kiến đã được trả lời phải có chữ ký của Nhà Đầu tư là cá nhân, của người đại diện theo ủy quyền hoặc người đại diện theo pháp luật và con dấu (nếu có) của Nhà Đầu tư là tổ chức. Phiếu hỏi ý kiến phải được đựng trong phong bì dán kín và không ai được quyền mở trước khi kiểm phiếu; * gửi fax hoặc thư điện tử: Phiếu hỏi ý kiến gửi về Chubb Life FMC qua fax hoặc thư điện tử phải được giữ bí mật đến thời điểm kiểm phiếu. * *Bỏ phiếu điện tử (e-voting) hoặc các hình thức điện tử khác tuân theo quy định hiện hành.*   Các phiếu hỏi ý kiến gửi về Chubb Life FMC sau thời hạn đã xác định tại nội dung phiếu hỏi ý kiến hoặc đã bị mở trong trường hợp gửi thư và bị tiết lộ trong trường hợp gửi fax, thư điện tử là không hợp lệ. Phiếu hỏi ý kiến không được gửi về được coi là phiếu không tham gia biểu quyết. |
| **6** | **Chương X - Điều 50:**  **Sửa đổi Khoản 50.3**  50.3. Các báo cáo tài chính bán niên/hàng năm sẽ được soát xét/kiểm toán độc lập hàng năm bởi Công ty Kiểm toán được lựa chọn. Công ty Kiểm toán được chỉ định phải cam kết bảo mật *~~mọi~~*thông tin *~~về hoạt động đầu tư, các giao dịch và các thông tin khác của Quỹ và Chubb Life FMC và không được tiết lộ cho bất kỳ bên thứ ba nào, hoặc sử dụng cho bất kỳ mục đích nào ngoài việc thực hiện các nghĩa vụ của Công ty Kiểm toán~~* theo hợp đồng kiểm toán được ký kết giữa Chubb Life FMC và Công ty Kiểm toán *~~và Điều lệ quỹ, bất kỳ thông tin nào liên quan đến tình hình tài chính và hoạt động của Quỹ mà Công ty Kiểm toán nhận được hoặc biết được qua quá trình thực hiện chức năng là Công ty Kiểm toán~~*, trừ trường hợp *phải tiết lộ* theo yêu cầu của Pháp luật và/hoặc cơ quan Nhà nước có thẩm quyền của Việt Nam. |
| **7** | **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 5**  **5. Trái phiếu Chính phủ~~,~~ *~~Trái phiếu được Chính phủ bảo lãnh, Trái phiếu chính quyền địa phương:~~***  *~~là giá yết cuối ngày (hoặc tên gọi khác theo quy chế của Sở giao dịch chứng khoán) của giao dịch thông thường tại ngày có giao dịch gần nhất trước Ngày Định giá cộng lãi lũy kế (nếu giá yết chưa bao gồm lãi lũy kế)~~*.  *Trái phiếu được ưu tiên định giá theo phương pháp giá trị thị trường, tức giá yết (giá clean) trên hệ thống giao dịch của Sở Giao Dịch Chứng Khoán Hà Nội (HNX) của giao dịch thông thường tại ngày có giao dịch gần nhất trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá (nếu giá yết chưa bao gồm lãi lũy kế). Trong đó trái phiếu được xác định dựa vào mã trái phiếu theo quy định của HNX.*  *Trong trường hợp giá trái phiếu có nhiều giao dịch trong một ngày thì sẽ thực hiện định giá trái phiếu bằng giá bình quân gia quyền.*  Trong trường hợp trái phiếu không có giao dịch trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá thì Giá trị của trái phiếu niêm yết được định giá ưu tiên theo thứ tự các nguyên tắc sau:   * *~~Bình quân báo giá tại ngày trước Ngày Định giá của ba (03) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * *~~Bình quân báo giá tại ngày trước Ngày Định giá của hai (02) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * Giá mua (giá sạch) cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá; * Mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá.   Trong trường hợp trái phiếu có giao dịch trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá nhưng giá trái phiếu *(giá sạch)* của kỳ định giá có sự biến động lớn hơn hai phần trăm (2%) so với giá trái phiếu của kỳ định giá gần nhất *hoặc so với giá mua trong trường hợp trái phiếu này mới được mua trong kỳ định giá* thì giá trái phiếu được xác định theo phương pháp chiết khấu dòng tiền (Discount Cashflow).  *Trái phiếu Chính phủ khi đến gần ngày đáo hạn mà trái phiếu này bắt buộc phải hủy niêm yết được định giá bằng mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá.* |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Bổ sung mục 6**  ***6. Trái phiếu được Chính phủ bảo lãnh, Trái phiếu chính quyền địa phương***  *Trái phiếu được ưu tiên định giá theo phương pháp giá trị thị trường, tức giá yết (giá clean) trên hệ thống giao dịch của HNX của giao dịch thông thường, tại ngày có giao dịch gần nhất trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá (nếu giá yết chưa bao gồm lãi lũy kế). Trong đó trái phiếu được xác định dựa vào mã trái phiếu theo quy định của HNX.*  *Trong trường hợp giá trái phiếu có nhiều giao dịch trong một ngày thì sẽ thực hiện định giá trái phiếu bằng giá bình quân gia quyền.*  *Trong trường hợp trái phiếu không có giao dịch trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá hoặc giá trái phiếu (giá sạch) của kỳ định giá có sự biến động lớn hơn hai phần trăm (2%) so với giá trái phiếu của kỳ định giá gần nhất hoặc so với giá mua trong trường hợp trái phiếu này mới được mua trong kỳ định giá thì giá được sử dụng để định giá theo thứ tự ưu tiên sau:*   * *Giá mua (giá sạch) cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá;* * *Mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá.*   *Trái phiếu được Chính phủ bảo lãnh, Trái phiếu chính quyền địa phương khi đến gần ngày đáo hạn mà trái phiếu này bắt buộc phải hủy niêm yết được định giá bằng mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá.* |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 7**  ***~~6.~~*7. Trái phiếu doanh nghiệp *niêm yết***  ***7.1 Trái phiếu doanh nghiệp thông thường:***  là giá sạch (giá clean) *~~tính từ giá yết (giá dirty) trên hệ thống giao dịch~~* của *~~HOSE~~ Sở Giao Dịch Chứng Khoán*~~,~~ tại ngày có giao dịch gần nhất trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá, cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá.  *Trong trường hợp giá trái phiếu có nhiều giao dịch trong một ngày thì sẽ thực hiện định giá trái phiếu bằng giá bình quân gia quyền.*  Trong trường hợp trái phiếu không có giao dịch trong vòng hai (02) tuần tính đến ngày trước Ngày Định giá hoặc giá trái phiếu *(giá sạch)* của kỳ định giá có sự biến động lớn hơn hai phần trăm (2%) so với giá trái phiếu của kỳ định giá gần nhất *hoặc so với giá mua trong trường hợp trái phiếu này mới được mua trong kỳ định giá* thì giá được sử dụng để định giá theo thứ tự ưu tiên sau:   * *~~Bình quân báo giá (giá sạch) tại ngày trước Ngày Định giá của ba (03) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * *~~Bình quân báo giá (giá sạch) tại ngày trước Ngày Định giá của hai (02) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * Giá mua (giá sạch) cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá; * Mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá. |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 7 (tiếp theo)**  ***~~7~~7.2* Trái phiếu doanh nghiệp khác**  Trái phiếu trong giai đoạn đấu thầu mà chưa có giá niêm yết được định giá bằng giá trúng thầu.  Trái phiếu doanh nghiệp khi đến gần ngày đáo hạn mà trái phiếu này bắt buộc phải hủy niêm yết được định giá bằng mệnh giá cộng với lãi lũy kế tính đến hết ngày trước Ngày Định giá. |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 8**  **8. Trái phiếu *~~doanh nghiệp~~* không niêm yết:**  Trái phiếu không niêm yết được định giá theo thứ tự các nguyên tắc sau:   * *~~Trái phiếu sẽ được tính bình quân báo giá tại ngày trước Ngày Định giá của ba (03) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * *~~Trái phiếu sẽ được tính bình quân báo giá tại ngày trước Ngày Định giá của hai (02) Tổ chức Báo Giá đã được Ban Đại diện Quỹ phê duyệt;~~* * Giá mua (giá sạch) cộng với lãi lũy kế đến ngày trước Ngày Định giá; * Mệnh giá cộng với lãi lũy kế đến hết ngày trước Ngày Định giá. |
| **8** | **Phụ lục 4 - Mục 1**  **Sửa đổi mục 11**  **11. Cổ phiếu *~~đã đăng ký, lưu ký nhưng~~* chưa niêm yết, chưa đăng ký giao dịch**   * Giá trị trung bình dựa trên báo giá (giá trung bình của các giao dịch trong kỳ) của tối thiểu ba (03) tổ chức cung cấp báo giá. * Trường hợp không có đủ báo giá của tối thiểu ba (03) tổ chức cung cấp báo giá, ưu tiên thực hiện theo thứ tự từ trên xuống là một trong các mức giá sau: * Giá trung bình từ hai (02) tổ chức cung cấp báo giá; * Giá của kỳ báo cáo gần nhất nhưng không quá ba (03) tháng tính đến ngày trước Ngày Định giá; * Giá mua (giá cost); * Giá trị sổ sách. |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 13**  **13. Cổ phiếu bị đình chỉ giao dịch, hoặc hủy niêm yết hoặc hủy đăng ký giao dịch**   * Phương pháp định giá được ưu tiên thực hiện theo thứ tự từ trên xuống là một trong các mức giá sau: * *Ủy quyền cho Ban Đại diện Quỹ xác định phương pháp định giá;* * Giá trị sổ sách *~~được chi tiết trong phụ lục của Sổ tay định giá~~*~~;~~ * Mệnh giá. |
| **Phụ lục 4 - Mục 1:**  **Sửa đổi mục 15**  **15. Quyền mua cổ phiếu**  *~~Được xác định theo thứ tự ưu tiên sau:~~*  Giá trị quyền mua = Max{0; (Giá đóng cửa Cổ phiếu tại ngày có giao dịch gần nhất trước Ngày Định giá - Giá phát hành quyền mua) X tỷ lệ chuyển đổi} |
| **9** | **Phụ lục 4 - Mục 1**  **Sửa đổi mục Ghi chú**  Ghi chú:   * Hướng dẫn chi tiết các *~~phương pháp chiết khấu dòng tiền, phương pháp chỉ số định giá so sánh~~* *phương pháp định giá sẽ* được quy định tại sổ tay định giá. * Lãi lũy kế là: khoản lãi tính từ thời điểm trả lãi gần nhất tới thời điểm trước Ngày Định giá. * Giá trị sổ sách (book value) của một cổ phiếu được xác định trên cơ sở báo cáo tài chính gần nhất đã được kiểm toán hoặc soát xét. * Tổ chức định giá được lựa chọn hệ thống báo giá trái phiếu (Reuteurs/Bloomberg/HNX…) để tham khảo. * Tại phần này của Phụ lục, ngày được hiểu là ngày theo lịch. * *Ngày trước Ngày định giá được hiểu là ngày chốt danh mục đầu tư để lập báo cáo xác định Giá trị tài sản ròng của Quỹ.* |

h) Nội dung Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư trong kỳ báo cáo: Công ty Quản lý Quỹ thực hiện tổ chức Đại hội Nhà đầu tư năm 2019 với các nội dung được thông qua như sau:

1. Thông qua Báo cáo kết quả hoạt động của Quỹ năm tài chính 2019.
2. Thông qua Báo cáo tài chính năm 2019 đã kiểm toán của Quỹ.
3. Thông qua Phương án phân phối lợi nhuận năm tài chính 2019 của Quỹ, chi tiết như sau:

Quỹ không phân phối lợi nhuận năm tài chính 2019 và sẽ tái đầu tư toàn bộ lợi nhuận.

1. Thông qua Kế hoạch hoạt động của Quỹ năm 2020.
2. Thông qua Báo cáo chi phí hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2019 và ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2020. Trong đó ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2020 là 180.000.000 VNĐ (một trăm tám mươi triệu đồng), chi tiết như sau:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| STT | Loại chi phí | Ngân sách 2020 |
| I | Thù lao | 180.000.000 |
| II | Chi phí đi lại | 0 |
| III | Chi phí khác | 0 |
|  | Tổng cộng | 180.000.000 |

1. Chấp thuận ủy quyền cho Ban Đại diện Quỹ lựa chọn công ty kiểm toán cho Quỹ năm tài chính 2020.
2. Thông qua việc sửa đổi, bổ sung Điều lệ Quỹ.
3. Phê chuẩn Nghị quyết số 03/CBPF-2019/BĐD ngày 12/07/2019 của Ban đại diện Quỹ (“Nghị quyết 03”) về việc sửa đổi bổ sung Sổ tay định giá và chấp thuận ủy quyền cho Ban đại diện Quỹ phê chuẩn Sổ tay định giá sửa đổi theo các nội dung nêu tại Nghị quyết 03 và theo Điều lệ Quỹ sửa đổi.

i) Ý kiến nhận xét của Ngân hàng giám sát về các nội dung quy định tại Điều 45 Thông tư hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ mở:

Căn cứ vào thư xác nhận của Công ty Quản lý Quỹ từ ngày 01 tháng 01 năm 2020 đến ngày 30 tháng 06 năm 2020, Công ty Quản lý Quỹ đã đáp ứng đúng các quy định tại điều 45 Thông tư 183/2011/TT-BTC về hướng dẫn thành lập và quản lý quỹ mở về Chế độ báo cáo, lưu trữ hồ sơ, quản lý thông tin.

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, cụ thể:

- Danh mục đầu tư của quỹ tại thời điểm 30/06/2020:

|  |  |
| --- | --- |
| **Tài sản đầu tư** | **Giá trị đến ngày 30/06/2020** |
| Tiền gửi ngân hàng | 263.828.446 |
| Các khoản tương đương tiền | 12.000.000.000 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 81.000.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 10.000.000.000 |
| Khác | 3.002.750.684 |
| **Tổng cộng** | **106.266.579.130** |

- Giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 30/06/2020:

|  |  |
| --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **30/06/2020** |
| Giá trị tài sản ròng của quỹ ngày 30/06/2020 | 106.012.733.310 |
| Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ, số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành |  |
| * Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ tại ngày 30/06/2020 | 10.539,27 |
| * Số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành tại ngày 30/06/2020 | 10.058.831,58 |
| Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cao nhất/thấp nhất trong kỳ |  |
| * Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ cao nhất | 10.539,27 |
| * Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ thấp nhất | 10.416,29 |

- 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):

|  |  |
| --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **30/06/2020** |
| **Tổng thu nhập của Quỹ** | **3.759.942.465** |
| - Lãi suất tiền gửi được nhận trong kỳ | 3.247.969.862 |
| - Lãi suất chứng chỉ tiền gửi trong kỳ | 511.972.603 |
| **Tổng chi phí của Quỹ** | **1.096.256.419** |
| **Tổng lợi nhuận của Quỹ tại ngày 30/06/2020** | **2.663.686.046** |

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

Trong kỳ báo cáo Quỹ chưa tiến hành phân phối lợi nhuận cho nhà đầu tư

- Tỷ lệ chi phí hoạt động của quỹ và thuyết minh về việc chênh lệch chi phí hoạt động của quỹ:

|  |  |
| --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **Tại thời điểm 30/06/2020** |
| Tỷ lệ phí quản lý trả cho công ty quản lý quỹ trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 0,90% |
| Tỷ lệ phí lưu ký, giám sát trả cho Ngân hàng Giám sát trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 0,33% |
| Tỷ lệ chi phí dịch vụ quản trị quỹ, chi phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng và các chi phí khác mà công ty quản lý quỹ trả cho tổ chức cung cấp dịch vụ có liên quan trên Giá trị tài sản ròng của quỹ trung bình trong kỳ (%) | 0,50% |
| Chi phí kiểm toán trả cho tổ chức kiểm toán trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 0,18% |
| Chi phí dịch vụ tư vấn pháp lý, dịch vụ báo giá và các dịch vụ hợp lý khác, thù lao trả cho ban đại diện quỹ trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 0,17% |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 2,09% |

- Tốc độ vòng quay danh mục và thuyết minh về việc chênh lệch tốc độ vòng quay của danh mục:

|  |  |
| --- | --- |
| **Tốc độ vòng quay danh mục** | **30/06/2020** |
| Tốc độ vòng quay danh mục của quỹ cuối Quý II/2019 | 9,55% |

b) Chỉ tiêu về lợi nhuận của quỹ:

Tổng lợi nhuận bình quân năm của quỹ phát sinh trong kỳ báo cáo xác định:

1. trong thời hạn 12 tháng (1 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 1 năm) là 4,82%, trong đó:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tổng lợi nhuận** | **Lợi nhuận đã**  **thực hiện**  **(VNĐ)** | **Lợi nhuận chưa thực hiện**  **(VNĐ)** | **Tổng**  **(VNĐ)** |
| Trong thời hạn từ ngày 30/06/2019 đến ngày 30/06/2020 | 4.872.145.151 | 0 | 4.872.145.151 |

1. trong thời hạn 36 tháng (3 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 3 năm): Không có
2. trong thời hạn 60 tháng (5 năm), tính tới ngày lập báo cáo (hoặc tính từ thời điểm lập quỹ tới ngày báo cáo nếu quỹ hoạt động dưới 5 năm): Không có

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

- Phương thức, nguyên tắc xác định giá trị tài sản, giá trị lợi nhuận là thống nhất, đã được công bố và được thẩm định bởi một tổ chức độc lập khác: Phương pháp xác định giá trị tài sản được quy định trong Sổ tay định giá lập bởi Công ty Quản lý Quỹ, được Ban Đại diện Quỹ thông qua và kiểm tra rà soát bởi ngân hàng giám sát Standard Chartered bank (Vietnam) Limited.

- Dữ liệu được cung cấp bởi một tổ chức độc lập: Giá chứng khoán được HNX cung cấp.

d) Thông tin về kết quả hoạt động của Quỹ trong quá khứ chỉ mang tính chất tham khảo và không có hàm ý hay cam kết việc đầu tư sẽ bảo đảm khả năng sinh lời cho Nhà Đầu Tư trong tương lai.

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

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

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

b) Thuyết minh về việc quỹ có đạt được mục tiêu đầu tư: Quỹ vẫn đang trong quá trình tìm kiếm cơ hội đầu tư nhằm đạt được Mục tiêu đầu tư đề ra trong Bản cáo bạch Quỹ (Mục tiêu của Quỹ là tăng trưởng vốn trung và dài hạn)

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

- Do Quỹ không áp dụng danh mục tham chiếu nên không trình bày phần này

- Chỉ số tham chiếu của Quỹ là Chỉ số Trái phiếu Chính phủ năm (05) năm của HNX. Kết quả so sánh từ ngày 01/01/2020 đến 30/06/2020 chi tiết như sau:

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

- Do Quỹ không áp dụng danh mục tham chiếu nên không trình bày phần này

- Chỉ số tham chiếu của Quỹ là Chỉ số Trái phiếu Chính phủ năm (05) năm của HNX, tuy nhiên do Quỹ mới thành lập từ ngày 03/04/2019 nên chưa đủ số liệu để so sánh cho phần này.

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

Trong 6 tháng đầu năm 2020, Quỹ CBPF vẫn giữ nguyên chiến lược đầu tư đã công bố trong Bản cáo bạch Quỹ và dự kiến sẽ nâng cao tỷ trọng đầu tư vào các Trái phiếu doanh nghiệp có lợi suất cao và các chứng chỉ tiền gửi của các tổ chức tài chính có lãi suất tốt.

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

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Cơ cấu danh mục đầu tư** | **CBPF** | |
| **30/06/2020** | **30/06/2019** |
| Tiền gửi ngân hàng | 263.828.446 | 0 |
| Các khoản tương đương tiền | 12.000.000.000 | 40.691.046.162 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 81.000.000.000 | 40.000.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 10.000.000.000 | 20.000.000.000 |
| Tài sản khác | 3.002.750.684 | 758.246.576 |
| **Tổng cộng** | **106.266.579.130** | **101.449.292.738** |

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

Trong kỳ báo cáo Quỹ chưa phân phối lợi nhuận cho Nhà đầu tư

- NAV/đơn vị quỹ tại ngày định giá tại ngày 01/01/2020 là 10.274,49 VNĐ

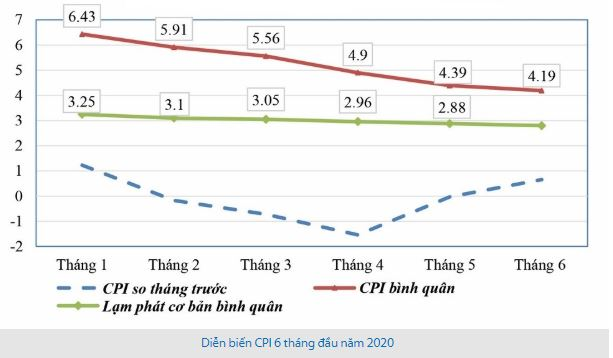
- NAV/đơn vị quỹ tại thời điểm 30/06/2020 là 10.539,27 VNĐ tăng 2,58%

h) Đánh giá biến động của các thị trường trong kỳ báo cáo, kể cả thị trường nước ngoài, mà quỹ đầu tư vào, thông tin về lợi nhuận đầu tư đối với từng loại tài sản: cổ phiếu, cổ phiếu blue-chip, cổ phiếu các công ty có mức vốn hóa thấp (small-cap).

**Kinh tế Vĩ mô:**

**Nền kinh tế quý 2/2020 chịu ảnh hưởng nặng nề bởi dịch bệnh Covid-19:** Tổng sản phẩm trong nước (GDP) quý 2/2020 ước tính tăng 0,36% so với cùng kỳ năm trước, là mức tăng thấp nhất của quý 2 các năm trong giai đoạn 2011 - 2020. Theo đó, GDP 6 tháng đầu năm 2020 tăng 1,81% cũng là mức tăng thấp nhất của 6 tháng các năm trong giai đoạn 2011-2020. Quý 2/2020 chịu ảnh hưởng nặng nề nhất của dịch Covid-19 khi Chính phủ chỉ đạo thực hiện mạnh mẽ các giải pháp nhằm giãn cách xã hội, trong đó khu vực nông, lâm nghiệp và thủy sản tăng 1,72%; khu vực công nghiệp và xây dựng tăng 1,38%; khu vực dịch vụ giảm 1,76%. GDP được dự báo có thể được cải thiện trong Quý 3 ở mức khoảng 5% khi hoạt động sản xuất kinh doanh trong nước dần được phục hồi.

**Chỉ số giá tiêu dùng bình quân 6 tháng đầu năm 2020 tăng 4,19%** so với bình quân cùng kỳ năm 2019, mức cao nhất từ năm 2016 trở lại. Rủi ro lạm phát trong quý 2 đến từ giá lương thực, đặc biệt là giá gạo có xu hướng tăng mạnh trong ngắn hạn do làn sóng tích trữ lương thực và sản lượng suy giảm do hạn hán và xâm nhập mặn ở đồng bằng sông Cửu Long. Đặc biệt, các biện pháp giảm nhiệt giá thịt lợn của chính phủ cũng không mang lại hiệu quả. Trước tình hình Trung Quốc tăng cường nhập khẩu lương thực do nền nông nghiệp bị ảnh hưởng bởi thiên tai, dự báo giá lương thực, thực phẩm trong nước sẽ khó lòng giảm trong cả năm 2020.



**Về hoạt động sản xuất:** theo IHS Markit, Chỉ số Nhà Quản trị Mua hàng (Purchasing Managers’ Index - PMI) của Việt Nam đạt 51,1 trong tháng 6, so với 42,7 trong tháng 5 và nằm trên ngưỡng trung tính 50 điểm lần đầu tiên trong năm tháng. Kết quả chỉ số thể hiện tình trạng tiếp tục phục hồi kể từ khi PMI đạt mức thấp kỷ lục vào tháng 4. Lĩnh vực sản xuất Việt Nam trong tháng 6 tăng trưởng trở lại nhờ Covid-19 được kiểm soát, kéo theo đó là nhu cầu khách hàng ở Việt Nam cải thiện. Rào cản lớn nhất cho việc phục hồi mạnh mẽ sắp tới là kết quả hoạt động của nền kinh tế thế giới, khi ảnh hưởng của virus vẫn đang lan rộng. Số lượng đơn đặt hàng xuất khẩu mới tiếp tục giảm, trong khi các công ty tiếp tục nêu khó khăn trong việc mua hàng hóa đầu vào từ nước ngoài.

**Hoạt động xuất nhập khẩu vẫn là điểm sáng trong lĩnh vực kinh tế trong 6 tháng đầu năm 2020,** tổng trị giá xuất nhập khẩu hàng hóa cả nước vẫn đạt 238,38 tỉ USD, duy trì mức cao qua các năm. Cán cân thương mại hàng hóa tháng 6 ước tính xuất siêu 500 triệu USD. Tính chung 6 tháng đầu năm 2020, cán cân thương mại hàng hóa tiếp tục xuất siêu 4 tỷ USD (cùng kỳ năm trước xuất siêu 1,7 tỷ USD). Tuy vậy, dự báo sẽ chịu tác động nặng nề bởi dịch Covid-19 trong giai đoạn sắp tới khi số đơn hàng trong các quý tới từ các thị trường lớn như Mỹ, EU, Trung Quốc không ngừng giảm dần.

**Chính sách tiền tệ**:

Tại 19/6/2020, huy động vốn của các tổ chức tín dụng tăng 4,35% (cùng thời điểm năm 2019 tăng 6,09%); tăng trưởng tín dụng của nền kinh tế đạt 2,45% (cùng thời điểm năm 2019 tăng 6,22%) và đây là mức tăng trưởng tín dụng thấp nhất trong các năm 2016-2020. Lãi suất huy động của 4 ngân hàng lớn (Vietcombank, Vietinbank, BIDV, Agribank) đã giảm về mức 6% với kỳ hạn 12 tháng từ tháng 6/2020. Với thanh khoản hệ thống tiếp tục dư thừa, không có giao dịch nào được thực hiện qua kênh OMO cũng như phát hành tín phiếu, lãi suất huy động được dự báo sẽ tiếp tục duy trì mức thấp trong thời gian sắp tới.

**Thị trường chứng khoán:**

Quý 2 của năm 2020 diễn ra không mấy êm ả với thị trường chứng khoán Việt Nam. Đầu tháng 4/2020 VNIndex chứng kiến sự giảm mạnh (-25,87%) với tình dịch bệnh Covid-19 đang gia tăng, chính phủ phải thực hiện việc giãn cách xã hội. Tuy vậy, chỉ số đã hồi phục đáng kể trong giai đọan cuối quý 2, quay về mốc 825 điểm phản ánh tình hình kiểm soát dịch bệnh của Việt Nam thành công, các doanh nghiệp bắt đầu hoạt động trở lại và một phần chính sách hỗ trợ, hiệp định EVFTA của nhà nước. Căng thẳng chính trị Mỹ - Trung và đặc biệt biến cố dịch bệnh Covid-19 bùng phát trên toàn cầu sẽ tiếp tục ảnh hưởng tiêu cực tới thị trường tài chính toàn cầu và Việt Nam.

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

Quỹ không thực hiện việc chia, tách đơn vị quỹ trong kỳ.

k) Các trường hợp có ảnh hưởng tới quyền lợi của nhà đầu tư nắm giữ chứng chỉ quỹ: Không có

l) Thông tin về các giao dịch với người có quyền lợi liên quan (nếu có): Tại ngày 30/06/2020 tỷ lệ nắm giữ Chứng chỉ quỹ của người có liên quan là 99,05%

m) Các thông tin khác (nếu có): Không có

4. Báo cáo về hoạt động giám sát của Ngân hàng giám sát: Nội dung như trình bày trong báo cáo giám sát của Ngân hàng Standard Chartered bank Vietnam Limited.

Thời gian giám sát hoạt động Quỹ: Từ 01/01/2020 đến ngày 30/06/2020

Trong báo cáo này, Ngân hàng giám sát đưa ra ý kiến 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 Đầu tư Trái phiếu Mở rộng Chubb (CBPF) gồm các nội dung sau:

1. Trong quá trình giám sát hoạt động đầu tư và các giao dịch tài sản của Quỹ cho giai đoạn từ ngày 01 tháng 01 năm 2020 đến ngày 30 tháng 06 năm 2020, Quỹ đã tuân thủ các giới hạn về hạn mức đầu tư được quy định tại các văn bản pháp luật chứng khoán hiện hành về quỹ mở, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan.
2. Việc định giá, đánh giá tài sản của Quỹ đã phù hợp với Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và các văn bản pháp luật liên quan.
3. 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.
4. Trong giai đoạn từ ngày 01 tháng 01 năm 2020 đến ngày 30 tháng 06 năm 2020, Quỹ không thực hiện phân phối lợi nhuận cho nhà đầu tư.

5. Báo cáo về hoạt động ủy quyền

Các dịch vụ Lưu ký tài sản của Quỹ, dịch vụ Giám sát, dịch vụ Quản trị Quỹ được ủy quyền cho Ngân hàng TNHH MTV Standard Chartered Ban Vietnam Limited. Dịch vụ Đại lý chuyển nhượng được ủy quyền cho Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt Nam (VSD). Chi tiết chi phí như sau:

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

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Chi phí hoạt động Quỹ mở** | **Kỳ báo cáo 01/01/2020 – 30/06/2020** | **Tỷ lệ so với lợi nhuận** | **Tỷ lệ so với Tổng chi phí hoạt động** |
| 1. Phí dịch vụ lưu ký tài sản Quỹ mở | 69.690.000 | 2,62% | 6,36% |
| 2. Phí dịch vụ giám sát | 105.600.000 | 3,96% | 9,63% |
| 3. Phí dịch vụ quản trị Quỹ mở | 194.287.500 | 7,29% | 17,72% |
| 4. Phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng | 66.000.000 | 2,48% | 6,02% |

b) Các hoạt động ủy quyền này không ảnh hưởng tới lợi nhuận và mức độ rủi ro của quỹ

c) Tổng chi phí các hoạt động ủy quyền phải trả cho bên nhận ủy quyền (trường hợp bên nhận ủy quyền cung cấp nhiều dịch vụ cho công ty quản lý quỹ):

Tổng chi phí trả cho Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) và Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt nam (VSD) cho dịch vụ ủy quyền là: 435.577.500 VNĐ

|  |  |
| --- | --- |
| **Bên nhận ủy quyền** | **Số tiền** |
| Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) | 369.577.500 |
| Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt nam (VSD) | 66.000.000 |
| **Tổng cộng (VND)** | **435.577.500** |

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

Theo ghi nhận của Công ty Quản lý quỹ, bên nhận Ủy quyền đáp ứng được yêu cầu về khả năng duy trì hệ thống kiểm soát nội bộ, quản trị rủi ro, tính bảo mật, hạ tầng cơ sở vật chất kỹ thuật, hệ thống dự phòng nóng, hệ thống dư phòng thảm họa...bảo đảm hoạt động ủy quyền được thực hiện thông suốt, không gây ảnh hưởng tới hoạt động đầu tư của Nhà đầu tư.

|  |  |
| --- | --- |
|  | **TP.HCM, ngày 30 tháng 7 năm 2020**  **Phó Chũ tịch Công ty quản lý quỹ**  **Bùi Thanh Hiệp** |