**Phụ lục số 25**

*(Ban hành kèm theo Thông tư số 98/2020/TT-BTC ngày 16 tháng 11 năm 2020 của Bộ trưởng BTC)*

|  |  |
| --- | --- |
| **CÔNG TYTNHH MTV QUẢN LÝ QUỸ CHUBB LIFE -------** | **CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM Độc lập - Tự do - Hạnh phúc ---------------** |
| Số: CFMCACEN220025V | *TP.HCM, ngày 29 tháng 03 năm 2022* |

**BÁO CÁO**

**TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ**

**Năm 2021**

**Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước**

**1. Thông tin về quỹ**

1. Tên của quỹ: Quỹ Đầu tư Trái phiếu Mở rộng Chubb (CBPF)
2. 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.

1. Thời hạn hoạt động của quỹ: Quỹ không giới hạn về thời gian hoạt động
2. Danh mục tham chiếu (benchmark portfolio): Không áp dụng
3. 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.
4. Số lượng đơn vị quỹ đang lưu hành: 10.006.127,21 đơn vị quỹ
5. Nội dung thay đổi tại Điều lệ Quỹ trong kỳ báo cáo:

(Các nội dung sửa đổi, bổ sung Điều lệ Quỹ đã được CBTT tại trang thông tin điện tử của Công ty vào ngày 28/04/2021 theo đường dẫn: https://chubblifefund.com.vn/vn-vn/investor-relations/information-disclosure.html)

1. 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 2020 với các nội dung được thông qua như sau:
2. Thông qua Báo cáo kết quả hoạt động của Quỹ năm tài chính 2020.
3. Thông qua Báo cáo tài chính năm 2020 đã kiểm toán của Quỹ.
4. Thông qua Phương án phân phối lợi nhuận năm tài chính 2020 của Quỹ, chi tiết như sau: Quỹ không phân phối lợi nhuận năm tài chính 2021 và sẽ tái đầu tư toàn bộ lợi nhuận.
5. Thông qua Kế hoạch hoạt động của Quỹ năm 2021.
6. Thông qua Báo cáo chi phí hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2020 và ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2021. Trong đó ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2021 là 180.000.000 VNĐ (một trăm tám mươi triệu đồng), chi tiết như sau:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| STT | Loại chi phí | Ngân sách 2021 |
| 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 2021.
2. Thông qua việc sửa đổi, bổ sung Điều lệ Quỹ như nêu tại Phụ lục “Các nội dung sửa đổi, bổ sung Điều lệ Quỹ Đầu tư Trái phiếu Mở rộng CHUBB (CBPF)”
3. Ý kiến nhận xét của Ngân hàng giám sát về các nội dung quy định tại Thông tư hướng dẫn về hoạt động và quản lý các quỹ đầu tư chứng khoán:

Xin xem chi tiết tại Mục 4. Báo cáo về hoạt động giám sát của ngân hàng giám sát.

**2.** **Báo cáo về kết quả hoạt động của quỹ**

1. 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 31/12/2021:

|  |  |
| --- | --- |
| **Tài sản đầu tư** | **Giá trị đến ngày 31/12/2021** |
| Trái phiếu chưa niêm yết | 10.000.000.000 |
| Tiền gửi ngân hàng | 1.111.618.509 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 83.800.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 15.000.000.000 |
| Tài sản khác | 2.630.081.096 |
| **Tổng cộng** | **112.541.699.605** |

Giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 31/12/2021:

|  |  |
| --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **31/12/2021** |
| Giá trị tài sản ròng của quỹ ngày 31/12/2021 | 112.298.730.193 |
| 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 31/12/2021 | 11.223,00 |
| * Số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành tại ngày 31/12/2021 | 10.006,127,21 |
| 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 | 11.223,00 |
| * Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ thấp nhất | 10.805,78 |

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** | **31/12/2021** |
| **Tổng thu nhập của Quỹ** | **6.504.911.780** |
| - Lãi suất tiền gửi được nhận trong kỳ | 5.519.185.753 |
| - Lãi suất chứng chỉ tiền gửi trong kỳ | 945.123.287 |
| - Lãi trái phiếu | 40.602.740 |
| **Tổng chi phí của Quỹ** | **2.259.764.640** |
| **Tổng lợi nhuận của Quỹ tại ngày 31/12/2021** | **4.245.147.140** |

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 31/12/2021** | **Tại thời điểm 31/12/2020** |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 2,05% | 2,07% |

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** | **31/12/2021** | **31/12/2020** |
| Tốc độ vòng quay danh mục của quỹ bán niên | 11,32% | 4,72% |

1. Chỉ tiêu về lợi nhuận của quỹ:

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

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 3,84%, trong đó:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tổng lợi nhuận** | **Lợi nhuận đã**  **thực hiện**  **(VNĐ)** | **Lợi nhuận chưa thực hiện**  **(VNĐ)** | **Tổng**  **(VNĐ)** |
| Trong thời hạn từ ngày 31/12/2020 đến ngày 31/12/2021 | 4.245.147.140 | 0 | 4.245.147.140 |

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

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

1. 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.

1. 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:

1. Thuyết minh về việc thay đổi Công ty quản lý quỹ (nếu có): Không có
2. 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)
3. 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 31/12/2020 đến 31/12/2021 chi tiết như sau:

1. 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.

1. 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 năm 2021, 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.

1. 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** | |
| **31/12/2021** | **31/12/2020** |
| Trái phiếu chưa niêm yết | 10.000.000.000 | 0 |
| Tiền gửi ngân hàng | 1.111.618.509 | 2.252.557.622 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 83.800.000.000 | 10.000.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 15.000.000.000 | 92.800.000.000 |
| Tài sản khác | 2.630.081.096 | 3.570.166.576 |
| **Tổng cộng** | **112.541.699.605** | **108.622.724.198** |

1. 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 31/12/2020 là 10.799,18 VNĐ
* NAV/đơn vị quỹ tại thời điểm 31/12/2021 là 11.223,00 VNĐ tăng 3,92%

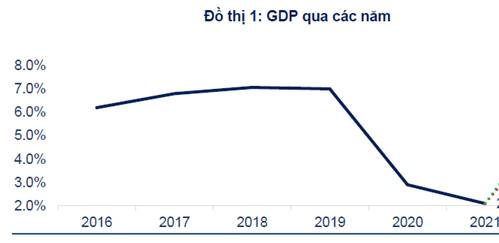
1. Đánh giá biến động của các thị trường trong kỳ báo cáo, kể cả thị trường nước ngoài, mà quỹ đầu tư vào, thông tin về lợi nhuận đầu tư đối với từng loại tài sản: cổ phiếu, cổ phiếu blue-chip, cổ phiếu các công ty có mức vốn hóa thấp (small-cap).

**Kinh tế Vĩ mô:**

**Tổng sản phẩm trong nước (GDP)**

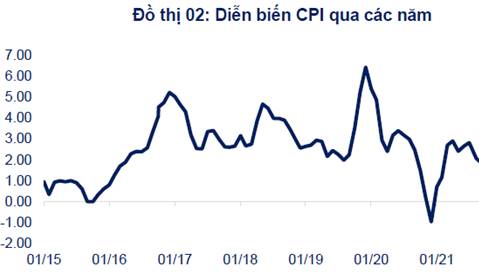
Tổng sản phẩm trong nước (GDP) năm 2021 tăng 2,58% so cùng năm 2020 (quý I tăng 4,72%; quý II tăng 6,73%; quý III giảm 6,02%; quý IV tăng 5,22%).

Trong mức tăng chung của toàn nền kinh tế, khu vực nông, lâm nghiệp và thủy sản tăng 2,9%, đóng góp 13,97% vào tốc độ tăng tổng giá trị tăng thêm của toàn nền kinh tế; khu vực công nghiệp và xây dựng tăng 4,05%, đóng góp 63,80%; khu vực dịch vụ tăng 1,22%, đóng góp 22,23%.



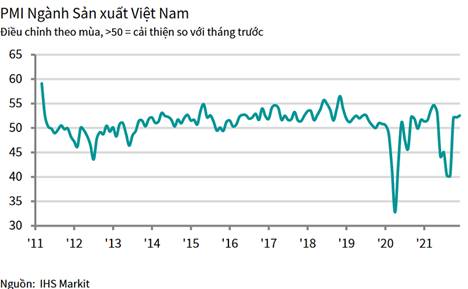
**Lạm phát**

CPI năm 2021 đạt mức 1,81% YoY vào tháng 12/2021, khiến mức CPI trung bình cả năm 2021 đạt mức 1,84%. CPI giảm mạnh vào quý I đạt mức 0,30%, do giá dầu nằm ở mức thấp và giá thịt heo suy giảm mạnh vào quý 1. Tuy nhiên, chỉ số này bắt đầu tăng trở lại vào quý II do giá dầu và giá heo đồng thời hồi phục. Tác động tiêu cực của COVID-19 trong quý III đã làm kiềm hãm lại nhu cầu tiêu dùng kinh tế và từ đó, khiến các nhóm giá cả hàng hóa suy giảm. Xu hướng này tiếp tục trong quý IV khi CPI chỉ còn đạt mức 1,89% do giá cả lương thực, thực phẩm nằm ở mức thấp và giá dầu suy giảm trong tháng 12.



**Hoạt động sản xuất**

Chỉ số PMI tháng 12 tăng về ngưỡng tăng trưởng 52,5 điểm, từ 52,3 điểm trong tháng 11, cao hơn mức trung bình năm là 49,23 điểm. Các cấu phần của chỉ số cho thấy tín hiệu hồi phục được duy trì. Sản lượng và số lượng đơn đặt hàng đều tăng trong tháng 12. Cùng với đó, giá bán hàng tăng, cho thấy cầu hàng hóa cho hoạt động sản xuất hồi phục. Yếu tố duy nhất vẫn ở mức cần theo dõi là lực lượng lao động vẫn đang ở mức khan hiếm. Tuy nhiên, tỷ lệ tiêm chủng Vaccine COVID-19 ở mức cao và chủng Omicron không gây nguy hại như Delta sẽ là các liều thuốc tâm lý giúp nhóm người lao động nhanh chóng quay trở lại việc làm.

****

**Hoạt động xuất nhập khẩu hàng hoá**

Năm 2021, tổng kim ngạch xuất khẩu hàng hóa đạt 336,25 tỷ USD, tăng 19%; nhập khẩu hàng hóa đạt 332,25 tỷ USD. Cán cân thương mại hàng hóa năm 2021 ước tính xuất siêu 4,0 tỷ USD. Bất chấp ảnh hưởng của dịch COVID-19 trong quý III/2021, Việt Nam vẫn duy trì mức tăng trưởng dương chủ yếu nhờ vào hai nhóm hàng hóa: (1) Máy vi tính, sản phẩm điện tử và linh kiện và (2) Máy móc, thiết bị, dụng cụ, phụ tùng khác. Hai nhóm hàng hóa tăng trưởng mạnh chủ yếu do hưởng lợi từ xu hướng chuyển dịch chuỗi sản xuất từ Trung Quốc sang Việt Nam.

Trong năm 2022, mũi nhọn tăng trưởng của kim ngạch xuất nhập khẩu Việt Nam sẽ đến từ ba nhóm hàng hóa: (1) Điện thoại các loại và linh kiện (2) Máy vi tính, sản phẩm điện tử và linh kiện (3) Máy móc, thiết bị, dụng cụ, phụ tùng khác.

**Hoạt động đầu tư**

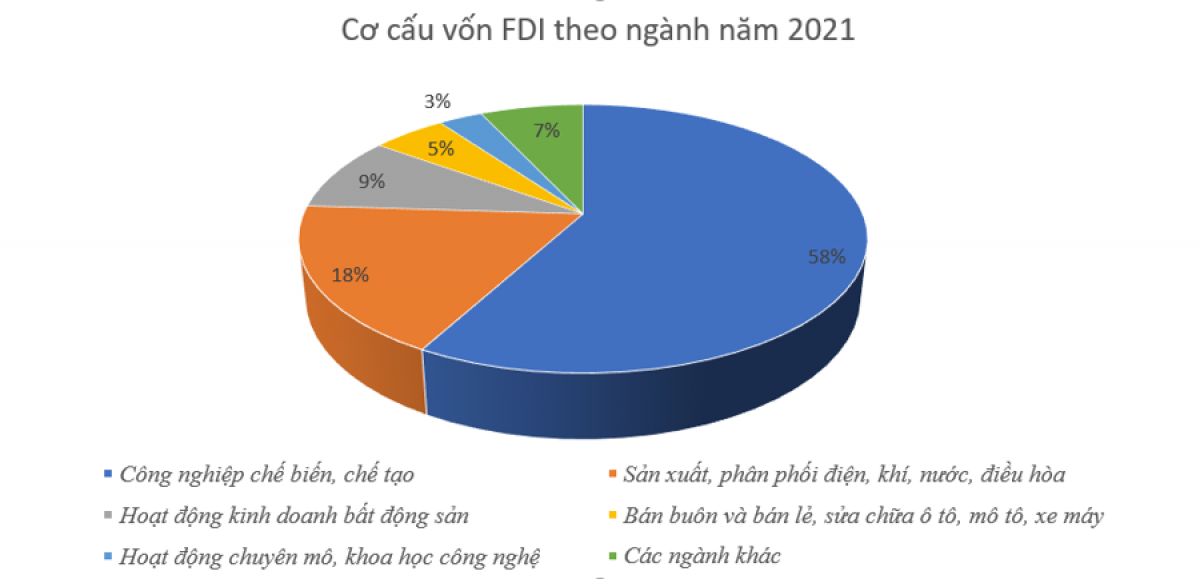
Tổng vốn đầu tư nước ngoài (FDI) đăng ký vào Việt Nam tính đến ngày 20/12/2021 bao gồm vốn đăng ký cấp mới, vốn đăng ký điều chỉnh và giá trị góp vốn, mua cổ phần của nhà đầu tư nước ngoài đạt 31,15 tỷ USD, tăng 9,2% so với năm 2020.

Vốn đầu tư trực tiếp nước ngoài thực hiện tại Việt Nam năm 2021, ước đạt 19,74 tỷ USD, giảm 1,2% so với năm trước.

Về vốn đăng ký cấp mới, có 1.738 dự án được cấp phép với số vốn đăng ký đạt 15,25 tỷ USD, giảm 31,1% về số dự án và tăng 4,1% về số vốn đăng ký so với năm trước.

Về vốn đăng ký góp vốn, mua cổ phần của nhà đầu tư nước ngoài: Có 3.797 lượt với tổng giá trị góp vốn 6,89 tỷ USD, giảm 7,7% so năm trước. Trong đó, có 1.535 lượt góp vốn, mua cổ phần làm tăng vốn điều lệ của doanh nghiệp với giá trị góp vốn là 5,03 tỷ USD và 2.262 lượt nhà đầu tư nước ngoài mua lại cổ phần trong nước mà không làm tăng vốn điều lệ với giá trị 1,86 tỷ USD.

Các nhà đầu tư nước ngoài đã đầu tư vào 18 ngành trong tổng số 21 ngành kinh tế quốc dân. Trong đó, ngành công nghiệp chế biến, chế tạo dẫn đầu với tổng vốn đầu tư đạt trên 18,1 tỷ USD, chiếm 58,2% tổng vốn đầu tư đăng ký. Ngành sản xuất, phân phối điện mặc dù thu hút được số lượng dự án mới, điều chỉnh cũng như góp vốn mua cổ phần không nhiều, song có dự án có quy mô vốn lớn nên đứng thứ 2 với tổng vốn đầu tư trên 5,7 tỷ USD, chiếm 18,3% tổng vốn đầu tư đăng ký. Tiếp theo lần lượt là các ngành kinh doanh bất động sản; bán buôn, bán lẻ với tổng vốn đăng ký đạt lần lượt là trên 2,6 tỷ USD và trên 1,4 tỷ USD...

*Nguồn: GSO*

**Thị trường chứng khoán:**

Chỉ số chứng khoán VN-Index chính thức khép lại năm 2021 với mốc 1.498,28 điểm, tăng gần 395 điểm (+36%) trong vòng 1 năm. Đến nay quy mô thị trường chứng khoán xấp xỉ 123% GDP, với 52 doanh nghiệp niêm yết lọt vào "câu lạc bộ" vốn hóa tỉ USD.

Năm 2021, thị trường chứng khoán Việt Nam đã đạt những thành quả nhất định, tăng trưởng mạnh mẽ về quy mô và thanh khoản, khẳng định vị trí, vai trò là kênh huy động vốn quan trọng của nền kinh tế.

Cụ thể, thị trường cổ phiếu đạt mức vốn hóa hơn 7,7 triệu tỉ đồng (tính đến ngày 28-12), tăng 46% so với cuối năm trước, tương đương 122,8% GDP năm 2020.

Bên cạnh đó, thanh khoản trên thị trường cổ phiếu cũng tiếp tục bùng nổ và tăng mạnh nhờ dòng tiền của các nhà đầu tư trong nước dẫn dắt thị trường. Từ giá trị giao dịch bình quân đạt mức 19.000 tỉ đồng/phiên trong tháng đầu năm, thanh khoản thị trường cổ phiếu đã gia tăng nhanh chóng và liên tục qua các tháng và đến tháng 11 đạt mức 40.000 tỉ đồng/phiên.

**Thị trường trái phiếu**

Năm 2021 tiếp tục là một năm phát hành thành công của Kho Bạc Nhà nước trên thị trường trái phiếu Chính phủ sơ cấp. Khối lượng phát hành tương đương năm trước và gần hoàn thành kế hoạch năm. Trên thị trường thứ cấp, lãi suất tất cả các kỳ hạn dao động trong biên độ hẹp khoảng 20-40bps đối với mỗi kỳ hạn, trước khi giảm mạnh và tạo đáy vào tháng 8/2021. Mặc dù sau đó lãi suất trái phiếu có phục hồi tuy nhiên nhìn chung xu hướng chính vẫn là xu hướng giảm.

***Một số điểm nổi bật trong năm 2021 như sau:***

* Khối lượng phát hành: Tổng khối lượng phát hành TPCP trong năm 2021 đạt 318.213 tỷ đồng, hoàn thành 98,15% so với kế hoạch sau điều chỉnh (324.000 tỷ đồng) và xấp xỉ các năm trước. Tổng khối lượng phát hành trái phiếu VDB và VBS lần lượt là 10.500 tỷ đồng và 11.024 tỷ đồng.
* Trong năm 2021, không có địa phương nào phát hành Trái phiếu Chính quyền địa phương.
* Lãi suất phát hành: Lãi suất phát hành ở tất cả các kỳ hạn nhìn chung dao động trong biên độ hẹp, đặc biệt gần như đi ngang đối với kỳ hạn 20 năm và 30 năm (biên độ khoảng 15bps). Diễn biến lãi suất trúng thầu tương đồng với diễn biến lãi suất giao dịch trên thị trường thứ cấp. Lãi suất phát hành bình quân trong năm 2021 là 2,30% (giảm mạnh khoảng 53bps từ mức 2,83% của năm trước nhưng ít hơn nhiều so với mức giảm của năm 2020 so với năm 2019 là 177bps).
* Lợi suất giao dịch: Biến động lợi suất giao dịch trái phiếu Chính phủ trong năm 2021 chia thành 3 giai đoạn chính. Lợi suất có sự phân hóa sau đà giảm kể từ cuối năm 2020 đến hết quý I năm 2021, trong đó lợi suất các kỳ hạn dài từ 10 năm trở lên chứng kiến sự suy giảm nhẹ trong khi các kỳ hạn ngắn hơn có thời điểm tăng mạnh.
* Thanh khoản: Giá trị giao dịch outright trên thị trường thứ cấp trong năm 2021 đạt 1.877.280 tỷ đồng, tương ứng tăng 11,74% so với năm 2020 (đạt 1.680.034 tỷ đồng). Giá trị bình quân một phiên đạt 7.193 tỷ đồng (năm 2020 là 6.412 tỷ đồng). Tổng khối lượng giao dịch repo trong năm 2021 đạt 866.908 tỷ đồng, giảm 4,53% so với năm 2020 (đạt 908.014 tỷ đồng).
* Quy mô niêm yết ổn định: tổng khối lượng trái phiếu các loại đáo hạn là 193.827 tỷ đồng, tăng 44,21% so với với năm 2020 (134.406 tỷ đồng). Giá trị niêm yết tại 31/12/2021 đạt 1.368 nghìn tỷ đồng tăng 20,4% so với cuối năm 2020 (tương đương ~21,29% GDP).
* Kỳ hạn niêm yết bình quân: Kỳ hạn niêm yết bình quân đạt 13,85 năm (năm 2020 là 12,45 năm).

1. 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.

1. Các trường hợp có ảnh hưởng tới quyền lợi của nhà đầu tư nắm giữ chứng chỉ quỹ: Không có
2. Thông tin về các giao dịch với người có quyền lợi liên quan (nếu có): Tại ngày 31/12/2021 tỷ lệ nắm giữ Chứng chỉ quỹ của người có liên quan là 99,57%
3. Các thông tin khác (nếu có): Không có

**4. Báo cáo về hoạt động giám sát của Ngân hàng giám sát:**

Ngân hàng giám sát phải đưa ra ý kiến về sự tuân thủ quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch của Công ty TNHH Một Thành Viên Quản Lý Quỹ Chubb Life trong quá trình vận hành và quản lý Quỹ Đầu tư Trái phiếu Mở rộng Chubb (“CBPF” hoặc “Quỹ”) đối với các nội dung sau:

1. Thuyết minh về việc thay đổi ngân hàng giám sát (nếu có): từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ không thay đổi Ngân hàng giám sát.
2. Việc lưu ký tài sản của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ đã thực hiện lưu ký tài sản theo các quy định pháp luật hiện hành.
3. Việc đầu tư tuân thủ các hạn chế về đầu tư, hạn chế về vay theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch;

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 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, 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, Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch của Quỹ và văn bản pháp luật liên quan.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ không có bất kỳ hợp đồng vay và cho vay.

1. Việc xác định giá trị tài sản ròng theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch: việc xác định giá trị tài sản ròng của Quỹ đã tuân thủ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch và các văn bản pháp luật có liên quan.
2. Việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ theo quy định pháp luật, quy định tại Điều lệ quỹ, Bản cáo bạch: việc phát hành bổ sung chứng chỉ quỹ, mua lại chứng chỉ quỹ được tuân thủ theo quy định pháp luật liên quan hiện hành, quy định tại Điều lệ Quỹ, Bản cáo bạch.

Từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, Quỹ đã thực hiện:

* Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: phát hành thêm 1.768,36 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị phát hành theo mệnh giá là 17.683.600 đồng.
* Mua lại chứng chỉ Quỹ: mua lại 31.862,99 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 318.629.900 đồng.

1. Việc phân chia lợi nhuận của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2021 đến ngày 31 tháng 12 năm 2021, 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 01/01/2021 – 31/12/2021** | **Tỷ lệ so với lợi nhuận** | **Tỷ lệ so với Tổng chi phí hoạt động** |
| 1. Phí dịch vụ quản trị Quỹ mở | 427.350.000 | 10,07% | 18,91% |
| 2. Phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng | 132.000.000 | 3,11% | 5,84% |

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

1. 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: 559.350.000 VNĐ.

|  |  |
| --- | --- |
| Bên nhận ủy quyền | Số tiền |
| Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) | 427.350.000 |
| Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt nam (VSD) | 132.000.000 |
| **Tổng cộng (VND)** | **559.350.000** |

1. 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 29 tháng 03 năm 2022**  **Chủ tịch Công ty**  **Bùi Thanh Hiệp** |