**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: CFMCACEN220078V | *TP.HCM, ngày 05 tháng 08 năm 2022* |

**BÁO CÁO**

**TỔNG KẾT HOẠT ĐỘNG QUẢN LÝ QUỸ**

**Bán niên 2022**

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

**1. Thông tin về quỹ**

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

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: 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: 10.004.219,08 đơn vị quỹ

g) 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 trong Phụ lục đính kèm Nghị quyết Đại hội nhà đầu tư thường niên năm 2021 tại trang thông tin điện tử của Công ty vào ngày 28/04/2022 theo đường dẫn: https://chubblifefund.com.vn/vn-vn/investor-relations/information-disclosure.html.

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 2021 với các nội dung được thông qua như sau:

1. Thông qua Báo cáo kết quả hoạt động của Quỹ năm tài chính 2021.
2. Thông qua Báo cáo tài chính năm 2021 đã kiểm toán của Quỹ.
3. Thông qua Phương án phân phối lợi nhuận năm tài chính 2021 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.
4. Thông qua Kế hoạch hoạt động của Quỹ năm 2022.
5. Thông qua Danh sách thành viên Ban Đại diện Quỹ nhiệm kỳ 2022-2027 như sau:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| STT | Họ và tên | Chức danh |
| 1 | Trịnh Thanh Cần | Chủ tịch Ban đại diện Quỹ |
| 2 | Nguyễn Trọng Đức | Thành viên độc lập |
| 3 | Trần Việt Hương | Thành viên độc lập |

1. Thông qua Báo cáo chi phí hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2021 và ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2022. Trong đó ngân sách hoạt động của Ban đại diện Quỹ năm 2022 là 180.000.000 VNĐ (một trăm tám mươi triệu đồng).
2. Chấp thuận ủy quyền cho Ban Đại diện Quỹ lựa chọn tổ chức kiểm toán cho Quỹ năm tài chính 2022.
3. Thông qua việc sửa đổi, bổ sung Điều lệ Quỹ Đầu tư Trái phiếu Mở rộng Chubb (CBPF)” .

i)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**

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 30/06/2022:

|  |  |
| --- | --- |
| **Tài sản đầu tư** | **Giá trị đến ngày 30/06/2022** |
| Trái phiếu chưa niêm yết | 10.000.000.000 |
| Tiền gửi ngân hàng | 1.167.877.268 |
| Các khoản tương đương tiền | 0 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 100.800.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 0 |
| Khác | 2.625.908.220 |
| **Tổng cộng** | **114.593.785.488** |

- Giá trị tài sản ròng của quỹ tại thời điểm 30/06/2022:

|  |  |
| --- | --- |
| **Chỉ tiêu** | **30/06/2022** |
| Giá trị tài sản ròng của quỹ ngày 30/06/2022 | 114.347.726.661 |
| 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 30/06/2022 | 11.429,95 |
| * Số lượng chứng chỉ quỹ đang lưu hành tại ngày 30/06/2022 | 10.004.219,08 |
| 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 | 11.429,95 |
| * Giá trị tài sản ròng trên một đơn vị quỹ thấp nhất | 11.227,64 |

- 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** | **30/06/2022** |
| **Tổng thu nhập của Quỹ** | **3.210.032.604** |
| - Lãi suất tiền gửi được nhận trong kỳ | 2.625.238.084 |
| - Lãi suất chứng chỉ tiền gửi trong kỳ | 198.000.000 |
| - Lãi trái phiếu | 386.794.520 |
| **Tổng chi phí của Quỹ** | **1.139.370.457** |
| **Tổng lợi nhuận của Quỹ tại ngày 30/06/2022** | **2.070.662.147** |

- 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 30/06/2022** | **Tại thời điểm 30/06/2021** |
| Tỷ lệ chi phí hoạt động trên Giá trị tài sản ròng trung bình trong kỳ (%) | 2,01% | 2,06% |

- 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** | **30/06/2022** | **30/06/2021** |
| Tốc độ vòng quay danh mục của quỹ bán niên | 0,00% | 13,70% |

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 3,59%, trong đó:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tổng lợi nhuận** | **Lợi nhuận đã**  **thực hiện**  **(VNĐ)** | **Lợi nhuận chưa thực hiện**  **(VNĐ)** | **Tổng**  **(VNĐ)** |
| Trong thời hạn từ ngày 30/06/2021 đến ngày 30/06/2022 | 4.071.632.521 | 0 | 4.071.632.521 |

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) là 3,90%, 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 30/06/2022 | 13.799.482.246 | 0 | 13.799.482.246 |

1. 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 30/06/2021 đến 30/06/2022 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 2022, 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** | |
| **30/06/2022** | **30/06/2021** |
| Trái phiếu chưa NY | 10.000.000.000 |  |
| Tiền gửi ngân hàng | 1.167.877.268 | 1.321.281.100 |
| Các khoản tương đương tiền | 0 | 0 |
| Tiền gửi kỳ hạn trên 3 tháng | 100.800.000.000 | 90.800.000.000 |
| Chứng chỉ tiền gửi | 0 | 15.000.000.000 |
| Tài sản khác | 2.625.908.220 | 3.467.764.384 |
| **Tổng cộng** | **114.593.785.488** | **110.589.045.484** |

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 30/06/2021 là 11.023,02 VNĐ

- NAV/đơn vị quỹ tại thời điểm 30/06/2022 là 11.429,95 VNĐ tăng 3,69%

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).

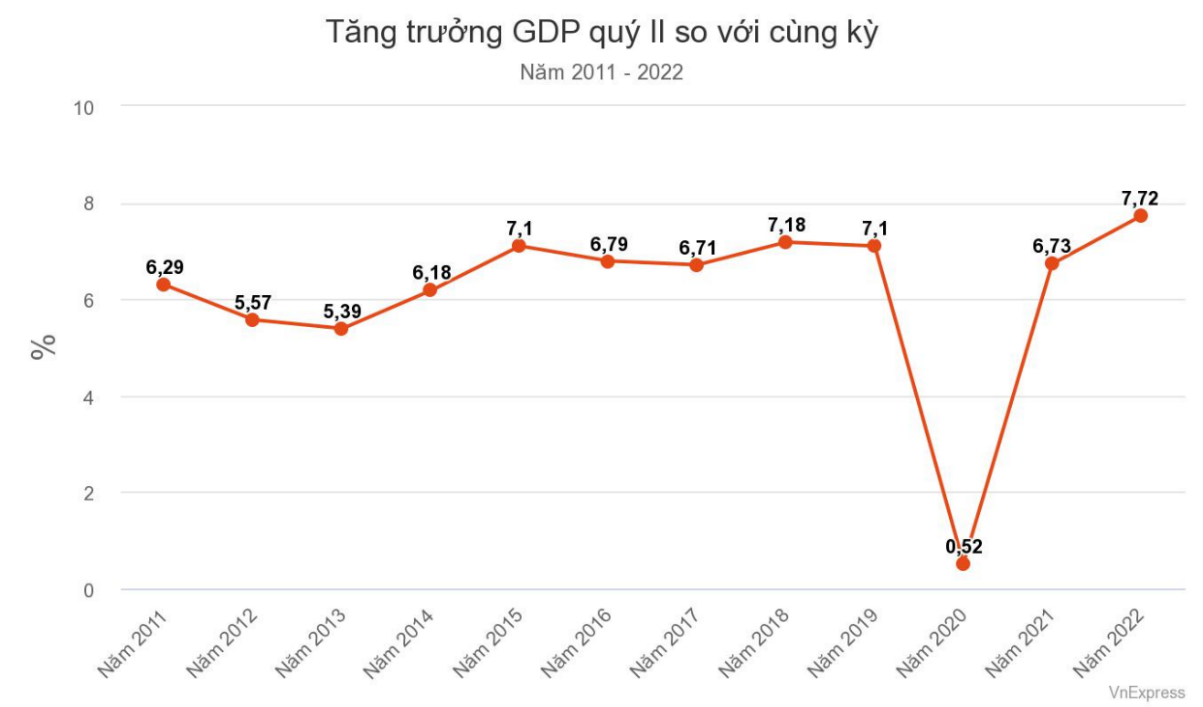
**Kinh tế Vĩ mô:**

**Tổng sản phẩm trong nước (GDP)**

Nền kinh tế Việt Nam đạt mức tăng trưởng cao trong Q2/2022, với GDP Q2/2022 tăng 7,72% so với cùng kỳ năm ngoái, tốc độ tăng trưởng cao nhất kể từ năm 2011 và tăng trưởng GDP 6 tháng đầu năm đạt 6,4%.

GDP Q2/2022 tăng trưởng cao chủ yếu nhờ sự phục hồi của ngành dịch vụ:

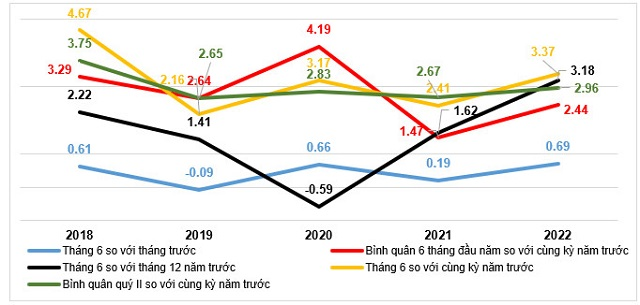
* Ngành nông nghiệp, lâm nghiệp và thủy sản tăng 3,02% yoy trong Q2/2022 ( thấp hơn 4,01% yoy trong Q2/2021);
* Ngành công nghiệp và xây dựng tăng 8,87% yoy trong Q2/2022 (thấp hơn 10,36% yoy trong Q2/2021); và
* Ngành dịch vụ tăng 8,56% yoy trong Q2/2022 ( tăng trưởng cao hơn 4,22% yoy trong Q2/2021).

**

**Lạm phát**

CPI bình quân 6 tháng đầu năm tăng 2,44% chủ yếu là do giá cả (xăng dầu, khí đốt, nguyên vật liệu, logistics và nhu cầu du lịch, ăn uống, đi lại…) đều tăng. Lạm phát cơ bản tăng 1,25% cho thấy lạm phát tăng chủ yếu là do yếu tố giá cả trong điều kiện vòng quay tiền vẫn ở mức thấp (chỉ khoảng 0,4 lần trong 6 tháng đầu năm).

Ba nhóm hàng hóa, dịch vụ khiến CPI tăng nhanh là: giao thông tăng 17,43% so với cùng kỳ năm trước (đóng góp 69,3% vào mức tăng chung), hàng ăn và dịch vụ ăn uống tăng 3,5% (đóng góp 12,3% vào mức tăng chung), nhà ở và vật liệu xây dựng tăng 2% (đóng góp 15,6% vào mức tăng chung); Tuy nhiên, lĩnh vực giáo dục giảm 2,82% (giúp giảm 6,97% mức tăng chung).

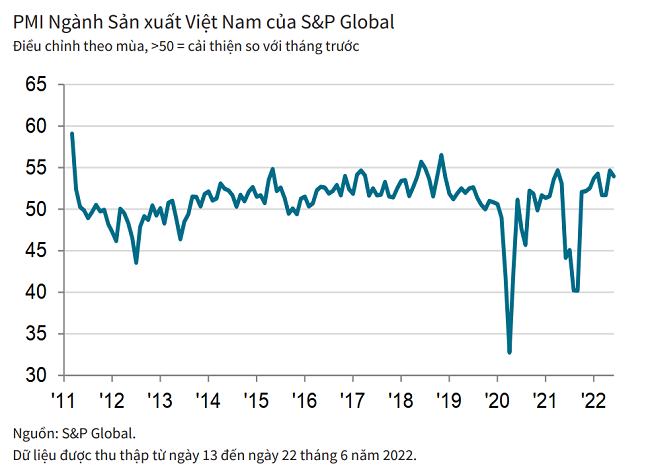
****

**Hoạt động sản xuất**

Chỉ số Nhà Quản trị Mua hàng (PMI) ngành sản xuất Việt Nam đạt 54 điểm trong tháng 6, giảm nhẹ so với mức 54,7 điểm trong tháng 5 nhưng vẫn cho thấy sức khỏe ngành sản xuất cải thiện mạnh mẽ.

Ngành sản xuất của Việt Nam kết thúc nửa đầu năm 2022 trong xu hướng tăng trưởng chắc chắn khi nhu cầu và sản lượng được hỗ trợ trong bối cảnh không bị gián đoạn do đại dịch Covid-19. Các công ty cũng ngày càng tuyển được nhiều nhân viên hơn, và tốc độ tạo việc làm đã nhanh hơn thành mức cao của ba năm rưỡi.

Tuy nhiên, những khó khăn của khâu chuyển hàng trên toàn cầu và những hạn chế do Covid-19 ở Trung Quốc đã khiến thời gian giao hàng của nhà cung cấp bị kéo dài đáng kể, trong khi áp lực lạm phát vẫn tăng.



**Hoạt động xuất nhập khẩu hàng hoá**

Theo báo cáo của Bộ Công Thương, trong tháng 6/2022, kim ngạch xuất khẩu ước đạt 32,65 tỷ USD, tăng 5,6% so với tháng trước. Tính chung nửa đầu năm 2022, kim ngạch xuất khẩu hàng hóa ước đạt 185,94 tỷ USD, tăng 17,3% so với cùng kỳ năm trước (cùng kỳ tăng 28,4%).

Điểm nhấn là khu vực kinh tế trong nước đã có sự hồi phục mạnh mẽ sau một thời gian dài chịu tác động của đại dịch COVID-19. Với con số ước đạt 49,26 tỷ USD, khu vực này đóng góp 26,5% tổng kim ngạch xuất khẩu và tăng 20% so với cùng kỳ năm ngoái, trong khi khu vực có vốn đầu tư nước ngoài (kể cả dầu thô) đạt 136,68 tỷ USD, tăng 16,3%, chiếm 73,5%.

Ở chiều ngược lại, kim ngạch nhập khẩu hàng hóa tháng 6/2022 ước đạt 32,37 tỷ USD, giảm 0,8% so với tháng trước. Tính chung 6 tháng đầu năm 2022, kim ngạch nhập khẩu hàng hóa ước đạt 185,23 tỷ USD, tăng 15,5% so với cùng kỳ năm trước, trong đó khu vực kinh tế trong nước đạt 65,23 tỷ USD, tăng 15,2% còn khu vực có vốn đầu tư nước ngoài đạt 120 tỷ USD, tăng 15,6%.

Theo thống kê, chiếm 88,8% tổng kim ngạch hàng hóa nhập khẩu của Việt Nam trong 6 tháng vừa qua là nhóm hàng cần nhập khẩu (nguyên phụ liệu phục vụ sản xuất trong nước) với kim ngạch đạt 164,5 tỷ USD, tăng 16,6% so với cùng kỳ năm 2021 (cùng kỳ tăng 35,6%).

Như vậy, tháng 6/2022, cán cân thương mại của cả nước ước tính xuất siêu 276 triệu USD. Tính chung 6 tháng đầu năm 2022, cán cân thương mại hàng hóa ước tính xuất siêu 710 triệu USD (cùng kỳ năm trước nhập siêu 1,86 tỷ USD).

**Hoạt động đầu tư**

* Vốn đầu tư thực hiện từ nguồn ngân sách Nhà nước 6 tháng đầu năm ước đạt 192,2 nghìn tỷ đồng, bằng 35,3% kế hoạch năm và tăng 10,1% so với cùng kỳ năm trước (cùng kỳ năm 2021 bằng 34,8% và tăng 11,9%).
* Tổng vốn đầu tư nước ngoài đăng ký vào Việt Nam tính đến ngày 20/6/2022 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 gần 14,03 tỷ USD, giảm 8,1% so với cùng kỳ năm trước.
* Vốn đầu tư trực tiếp nước ngoài thực hiện tại Việt Nam 6 tháng đầu năm 2022 ước tính đạt 10,06 tỷ USD, tăng 8,9% so với cùng kỳ năm trước, đây là mức tăng cao nhất của 6 tháng đầu năm trong 5 năm qua.
* Đầu tư của Việt Nam ra nước ngoài trong 6 tháng đầu năm 2022 có 57 dự án được cấp mới giấy chứng nhận đầu tư với tổng số vốn của phía Việt Nam là 300,9 triệu USD, gấp 2,1 lần so với cùng kỳ năm trước; có 14 lượt dự án điều chỉnh vốn với số vốn điều chỉnh tăng 44,9 triệu USD, giảm 88,9%.

**Thị trường chứng khoán:**

Trong Qúy 2/2022 tăng trưởng EPS 17,5% nhưng VN-Index giảm 20% chứng tỏ thị trường đang chiết khấu rất lớn.

Nhà đầu tư cá nhân trong nước đã bán mạnh trong quý 2/2022 với giá trị bán ròng gần 6,5 nghìn tỷ đồng so với mức mua ròng trong quý 1/2022 là hơn 12,5 nghìn tỷ đồng, năm 2021 là 88,8 nghìn tỷ đồng, thể hiện tâm lý bi quan quá mức...

Trái lại, khối ngoại chiếm 8% tổng giá trị giao dịch quay trở lại mua ròng trong quý 2/2022 với giá trị 9,3 nghìn tỷ đồng, sau khi đã bán ròng khoảng 7,3 nghìn tỷ đồng trong quý 1/2022 và 58,4 nghìn tỷ đồng trong năm 2021.

Nhìn chung, thanh khoản thị trường sụt giảm mạnh, với giá trị giao dịch hàng ngày đang ở mức thấp nhất trong vòng 1 năm qua, phản ánh tâm lý e dè của nhà đầu tư sau nhiều tháng thị trường sụt giảm mạnh. Kể từ tháng 11/2021, giá trị giao dịch bình quân hàng ngày đã liên tục giảm từ mốc hơn 30 nghìn tỷ/ngày xuống còn khoảng 13 nghìn tỷ đồng vào tháng 6/2022.

**Thị trường trái phiếu**

Trong tháng 6, Kho bạc Nhà nước chỉ huy động thành công 15,275 tỷ đồng/22,500 tỷ đồng gọi thầu. Tính chung cả quý 2, Kho bạc Nhà nước hoàn thành 23.17% kế hoạch. Kết thúc 6 tháng đầu năm, Kho bạc Nhà nước chỉ hoàn thành 17.27% kế hoạch năm, tương đương với khối lượng phát hành 69,087 tỷ đồng.

Giá trị giao dịch outright toàn thị trường trong tháng 6 đạt 103,962 tỷ đồng, tăng 31.70% so với tháng 5 (78,937 tỷ đồng). Giá trị giao dịch bình quân trong tháng đạt 4,726 tỷ đồng/phiên, tăng 31.82% so với tháng 5 (3,588 tỷ đồng/phiên).

Lợi suất trái phiếu các kỳ hạn tăng nhẹ trước khi giảm không đáng kể vào tuần cuối tháng.

Tổng giá trị giao dịch của nhà đầu tư nước ngoài tăng trong tháng 6, trong đó, giá trị giao dịch mua đạt 415 tỷ đồng và giá trị giao dịch bán đạt 1,463 tỷ đồng. Tổng giá trị giao dịch của nhà đầu tư nước ngoài chiếm 0.89% giá trị giao dịch toàn thị trường.

Trong tháng 6, khối lượng giao dịch HĐTL TPCP tiếp tục tăng. Tổng giá trị giao dịch toàn thị trường lên tới hơn 33,485 tỷ đồng.

Về Trái phiếu doanh nghiệp, trong 6 tháng đầu năm 2022, có khoảng 276 đợt phát hành riêng lẻ với tổng giá trị phát hành đạt 192.792 tỷ đồng (trong đó gồm 2 đợt phát hành trái phiếu quốc tế với tổng giá trị phát hành 625 triệu USD của tập đoàn Vingroup). Ngoài ra, có 17 đợt phát hành ra công chúng với tổng giá trị phát hành 8.996 tỷ đồng (chiếm 5.47% tổng giá trị phát hành)



**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 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ không thay đổi Ngân hàng giám sát.
2. Việc lưu ký tài sản của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, 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 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, 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 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, 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 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, Quỹ đã thực hiện:

• Phát hành thêm chứng chỉ Quỹ: Quỹ không phát hành thêm Chứng chỉ Quỹ.

• Mua lại chứng chỉ Quỹ: mua lại 1.908,13 chứng chỉ Quỹ tương ứng với tổng giá trị mua lại theo mệnh giá là 19.081.300 đồng.

1. Việc phân chia lợi nhuận của quỹ: từ ngày 01 tháng 01 năm 2022 đến ngày 30 tháng 06 năm 2022, 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 01/01/2022 – 30/06/2022** | **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 | 69.300.000 | 3,35% | 6,08% |
| 2. Phí dịch vụ giám sát | 105.600.000 | 5,10% | 9,27% |
| 3. Phí dịch vụ quản trị Quỹ mở | 213.675.000 | 10,32% | 18,75% |
| 4. Phí dịch vụ đại lý chuyển nhượng | 66.000.000 | 3,19% | 5,79% |

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: 454.575.000 VNĐ

|  |  |
| --- | --- |
| **Bên nhận ủy quyền** | **Số tiền** |
| Ngân hàng TNHH một thành viên Standard Chartered (Việt Nam) | 388.575.000 |
| Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt nam (VSD) | 66.000.000 |
| **Tổng cộng (VND)** | **454.575.000** |

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 05 tháng 08 năm 2022**  **Chủ tịch Công ty quản lý quỹ**  **Bùi Thanh Hiệp** |