



## QUỸ ETF SSIAM VN30

===

Hà Nội, ngày 01 tháng 04 năm 2021

### BÁO CÁO KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG NĂM 2020 VÀ CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ NĂM 2021 CỦA QUỸ ETF SSIAM VN30

#### I. KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG CỦA QUỸ NĂM 2020

Trong năm 2020, Quỹ ETF SSIAM VN30 (“Quỹ”) đã theo đuổi chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu bám sát tỷ lệ lợi nhuận của chỉ số tham chiếu VN30 (là một chỉ số giá do Sở Giao Dịch Chứng Khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HSX) xây dựng và không chủ động tìm kiếm tăng trưởng cao hơn Chỉ Số Tham Chiếu, cũng như không sử dụng các biện pháp phòng thủ khi thị trường chứng khoán biến động bất lợi.

Tại thời điểm 31/12/2020, mức độ sai lệch so với chỉ số tham chiếu (Tracking Error) của Quỹ là 0,20% thấp hơn nhiều so với quy định của HSX cho phép.

Danh mục đầu tư của Quỹ có thay đổi cơ cấu 2 lần vào tháng 8 và tháng 11 do HSX tái cơ cấu lại danh mục và cập nhật thông tin khối lượng lưu hành, tỷ lệ tự do chuyển nhượng (freefloat) và giới hạn tỷ trọng vốn hóa của chỉ số của chỉ số VN30 định kỳ.

Trong năm, Quỹ ETF SSIAM VN30 đã bám sát khá tốt chỉ số tham chiếu. Tính từ ngày kết thúc đăng ký góp vốn 22/06/2020, chỉ số tham chiếu VN30 tăng +32,20% trong khi giá trị tài sản ròng trên một chứng chỉ Quỹ ETF SSIAM VN30 tăng +32,17%.

Trong năm 2020, thanh khoản dựa trên khớp lệnh liên tục của Quỹ trên HSX đạt gần 9,69 triệu đơn vị (kể từ ngày đầu tiên niêm yết 18/8/2020). Tổng khối lượng giao dịch khớp lệnh bình quân mỗi phiên đạt 99.881 CCQ/phiên.

	NAV/CCQ (đồng)	Tăng trưởng	
		2020	Từ ngày kết thúc đăng ký góp vốn
SSIAM VN30 ETF	13.216,63	32,17%	32,17%
Chỉ số tham chiếu*		32,20%	32,20%

Nguồn: SSIAM; (\*) Từ 22/06/2020 ngày kết thúc đợt góp vốn ETF SSIAM VN30

Tại ngày 31/12/2020, Số chứng chỉ quỹ đang lưu hành là 7,9 triệu đơn vị với quy mô tổng giá trị tài sản ròng tại ngày 31/12/2020 đạt 64,76 tỷ đồng.

Tại thời điểm 31/12/2020, tỷ lệ nắm giữ của nhà đầu tư nước ngoài là 34,59%.



*Handwritten signature*

Về phân phối lợi nhuận, Quỹ đề xuất không thực hiện phân phối lợi nhuận trong năm 2020 để tái đầu tư.

## II. CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ CỦA QUỸ NĂM 2021

Mục tiêu đầu tư của Quỹ ETF SSIAM VN30 năm 2021 là hướng tới đạt hiệu quả đầu tư bám sát mức sinh lời thực tế của chỉ Số VN30 trong tất cả các giai đoạn. Để đạt mục tiêu này, Quỹ ETF SSIAM VN30 áp dụng phương pháp đầu tư mô phỏng toàn bộ rổ cổ phiếu VN30 để giảm thiểu mức sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu.

ĐẠI DIỆN CÔNG TY QUẢN LÝ QUỸ *nhc*



*Trần Thùy Linh*  
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC



*nhc*