



NGÂN HÀNG TMCP ĐẦU TƯ
VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM
CHI NHÁNH HÀ THÀNH
Số: 133 /BIDV.HTH-DVCK
V/v: báo cáo giám sát Quỹ TCFF

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Hà nội, ngày 28 tháng 10 năm 2022

Kính gửi: Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Kỹ Thương

Với vai trò là Ngân hàng Giám sát của Quỹ Đầu tư Trái phiếu Linh hoạt Techcom (Quỹ TCFF), Ngân hàng TMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam - Chi nhánh Hà Thành xin thông báo tới Quý Công ty về sai lệch phát sinh trong cơ cấu danh mục đầu tư của Quỹ TCFF tại kỳ định giá xác định giá trị tài sản ròng tại ngày 27/10/2022.

Theo ghi nhận của Ngân hàng giám sát, tỷ lệ đầu tư vào chứng khoán đang lưu hành vượt quá 20% tổng giá trị tài sản của quỹ, quy định tại khoản 4 Điều 35 Thông tư 98/2020/TT-BTC và tỷ lệ đầu tư vào các loại trái phiếu, công cụ thị trường tiền tệ, tiền gửi có kỳ hạn và các công cụ có thu nhập cố định khác chiếm dưới 80% giá trị tài sản ròng. Cụ thể:

STT	Mã CK	Số lượng	Giá Thị trường (Giá clean)	Tổng thị giá	Lãi dự thu	Tổng thị giá và lãi dự thu	%/NAV	Ghi chú
1	Trái phiếu							
	NPM11907	5,167	100,000.00	516,700,000	22,099,543	538,799,543	0.77%	
	MSN12002	8,368	98,958.87	828,087,824	9,099,340	837,187,164	1.19%	
	MSN12001	16,270	97,252.65	1,582,300,616	10,109,688	1,592,410,304	2.27%	
	CIH120018	115,000	106,348.08	12,230,029,200	94,520,548	12,324,549,748	17.54%	
	HDG121001	150,000	99,512.69	14,926,903,500	425,445,205	15,352,348,705	21.85%	
	NVL122001	110,000	95,485.78	10,503,435,800	22,904,110	10,526,339,910	14.98%	
	MSN12005	16,857	96,722.89	1,630,457,757	53,740,346	1,684,198,103	2.40%	
	MSN12003	1,799	96,682.99	173,932,699	7,267,591	181,200,290	0.26%	
	MSN121015	2,499	100,622.84	251,456,477	7,145,600	258,602,077	0.37%	
	MSN120010	7,272	99,797.22	725,725,384	32,883,884	758,609,268	1.08%	
	MSN120007	985	97,879.93	96,411,731	4,454,156	100,865,887	0.14%	
	MSN120011	1,085	94,534.72	102,570,171	3,820,389	106,390,560	0.15%	
	VIC121005	9,539	96,615.35	921,613,824	11,883,895	933,497,719	1.33%	
	VIC121004	7,353	98,766.01	726,226,472	9,160,528	735,387,000	1.05%	
	VIC121003	1,731	98,490.52	170,487,090	3,257,718	173,744,808	0.25%	
2	Hợp đồng tiền gửi							
	ACB 012010/ACB-TCFF.22			5,000,000,000	5,479,452	5,005,479,452	7.13%	
	ACB 022010/ACB-TCFF.22			5,000,000,000	5,479,452	5,005,479,452	7.13%	
	Tổng					56,115,089,989	79.88%	
Tổng giá trị tài sản ròng						70,250,400,921		

STT	Mã CK	Số lượng	Giá Thị trường (Giá clean)	Tổng thị giá	Lãi dự thu	Tổng thị giá và lãi dự thu	%/TTS	Ghi chú
	HDG121001	150,000	99,512.69	14,926,903,500	425,445,205	15,352,348,705	21.78%	
	Tổng					15,352,348,705	21.78%	
Tổng tài sản						70,477,593,873		

Ngân hàng giám sát kính đề nghị Công ty Quản lý Quỹ điều chỉnh lại danh mục đầu tư Quỹ TCFF trong thời hạn được phép để đáp ứng các hạn mức đầu tư theo quy định của pháp luật và điều lệ Quỹ. Ngân hàng giám sát sẽ tiếp tục theo dõi và thông báo tới Quý Công ty khi danh mục đầu tư của Quỹ khắc phục các sai lệch nêu trên.

Trân trọng!

Nơi nhận (03 b):

- Như trên;
- Lưu DVCK

KT GIÁM ĐỐC
PHÓ GIÁM ĐỐC

PHÓ GIÁM ĐỐC
PHÒNG GIAO DỊCH VÀ DỊCH VỤ CHỨNG KHOÁN
Phan Quỳnh Hoa