

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ
VinaWealth
Số: 160201 /VNW

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

CÔNG BỐ THÔNG TIN TRÊN CÔNG THÔNG TIN ĐIỆN TỬ CỦA ỦY BAN CHỨNG KHOÁN NHÀ NƯỚC

Kính gửi: Ủy ban Chứng khoán Nhà nước

Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ VinaWealth (“VinaWealth”)

Trụ sở chính: Lầu 5, Tòa Nhà Sun Wah, 115 Nguyễn Huệ, Quận 1, TP. Hồ Chí Minh

Điện thoại: (84 - 8) 3827 8535

Fax: (84 - 8) 3827 8536

Người thực hiện công bố thông tin: Vũ Hồng Vân

Địa chỉ: Lầu 5, Tòa nhà Sun Wah, 115 Nguyễn Huệ, Quận 1, TP. Hồ Chí Minh

Điện thoại: (84 - 8) 3827 8535 (số máy nhánh: 403) Fax: (84 - 8) 3827 8536

Điện thoại di động: 090 777 2163

Loại thông tin công bố: 24h 72h Yêu cầu Bất thường Định kỳ


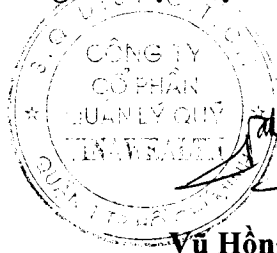
Nội dung thông tin công bố:

Căn cứ vào Quyết định số 160102/VFF ngày 25/01/2016 của Ban Đại diện Quỹ Đầu tư Trái phiếu Bảo Thịnh VinaWealth (“VFF”), VinaWealth xin công bố thông tin về việc thay đổi Sổ tay định giá của Quỹ VFF. Chi tiết xin xem trong hồ sơ đính kèm.

Chúng tôi xin cam kết các thông tin công bố trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu trách nhiệm trước pháp luật về nội dung các thông tin đã công bố.

Ngày 04 tháng 02 năm 2016

Người thực hiện công bố thông tin



Vũ Hồng Vân

PHỤ LỤC 01:
TÓM TẮT SỬA ĐỔI, BỔ SUNG SỔ TAY ĐỊNH GIÁ
(PHỤ LỤC SỐ 4 ĐIỀU LỆ QUỸ)
Quỹ Đầu tư Trái phiếu Bảo Thịnh VinaWealth (“VFF”)

Dựa trên tình hình thực tế hoạt động của Quỹ VFF và đặc thù của tài sản đầu tư, Công ty Quản lý Quỹ VinaWealth xin trình lên Ban Đại diện Quỹ VFF đề xuất sửa đổi, bổ sung Sổ tay định giá với những nội dung sau:

1. Phần II – Mục B. Trái Phiếu được thay thế bằng nội dung như sau:

1. Trái phiếu niêm yết: Giá yết trên hệ thống giao dịch tại Sở Giao dịch Chứng khoán tại ngày có giao dịch gần nhất trước ngày định giá cộng lãi lũy kế. Trường hợp không có giao dịch nhiều hơn hai (02) tuần tính đến (không bao gồm) ngày định giá, thì giá trái phiếu được sử dụng để định giá là một trong các mức giá theo thứ tự ưu tiên sau:

- i. Giá mua (Giá sạch) cộng lãi lũy kế;
ii. Mệnh giá cộng lãi lũy kế;

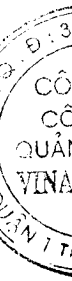
Trường hợp giá trái phiếu của kỳ định giá có sự biến động lớn (*) so với giá trái phiếu của kỳ định giá gần nhất thì giá trái phiếu hợp lý được xác định theo phương pháp đã được ban đại diện quỹ chấp thuận. Phương pháp định giá trái phiếu trong trường hợp này được đề nghị như sau:

Giá trái phiếu được tính trên cơ sở sử dụng lợi suất trái phiếu cùng kỳ hạn xác định theo phương pháp nội suy từ đường cong lợi suất chuẩn cung cấp bởi Bloomberg vào ngày trước ngày định giá.

- + Công thức tính giá trái phiếu được sử dụng là công thức tính giá trái phiếu được áp dụng trên Bloomberg
- + Giá trái phiếu bao gồm giá sạch và lãi lũy kế tính đến ngày trước ngày định giá
- + Lợi suất trái phiếu cùng kỳ hạn theo phương pháp nội suy được xác định như sau:

$$Y = \{LY + (UY - LY) \times (TTM - LTM) / (UTM - LTM)\}$$

Y	Lợi suất nội suy của trái phiếu (%)
LY	Lợi suất trái phiếu chuẩn của kỳ hạn tham chiếu ngắn hơn liền kề được xác định sau 4 giờ chiều của ngày trước ngày định giá theo Bloomberg (%)
TTM	Kỳ hạn còn lại của trái phiếu cần định giá (năm)
LTM	Kỳ hạn tham chiếu ngắn hơn liền kề (năm)
UY	Lợi suất trái phiếu chuẩn của kỳ hạn tham chiếu dài hơn liền kề xác định sau 4 giờ chiều của



	ngày trước ngày định giá theo Bloomberg (%)
UTM	Kỳ hạn tham chiếu dài hơn liền kề (năm)

Kỳ hạn tham chiếu và lợi suất chuẩn sử dụng từ đường cong lợi suất chuẩn theo Bloomberg

Kỳ hạn tham chiếu	Lợi suất trái phiếu chuẩn
10 đến 15 năm	10 năm & 15 năm
7 đến 10 năm	7 năm & 10 năm
5 đến 7 năm	5 năm & 7 năm
3 đến 5 năm	3 năm & 5 năm
2 đến 3 năm	2 năm & 3 năm
1 đến 2 năm	1 năm & 2 năm

2. Trái phiếu không niêm yết: Giá yết (nếu có) trên các hệ thống báo giá cộng lãi suất cuống phiếu tính tới ngày trước ngày định giá; hoặc một trong các mức giá theo thứ tự ưu tiên sau (trong trường hợp không có giá yết trên hệ thống báo giá):

- Giá mua (Giá sạch) cộng lãi lũy kế;
- Mệnh giá cộng lãi lũy kế;

Ghi chú:

- Giá yết trái phiếu: Trong trường hợp tại ngày có giao dịch gần nhất trước ngày định giá có nhiều hơn một giao dịch của trái phiếu cần định giá (dẫn đến có nhiều giá yết), giá sử dụng để định giá là bình quân của các giá yết đã thực hiện trong ngày đó.

(*) Biến động lớn:

- + Trái phiếu Chính phủ: vượt quá +/- 1%
- + Trái phiếu Chính phủ bảo lãnh, trái phiếu địa phương: vượt quá +/- 2%
- + Trái phiếu doanh nghiệp: vượt quá +/- 2%

CÔNG TY
PHÂN
LY Q
NEAL
HỒ C

W
N
D
U
Y
/

2. Phần còn lại của Sổ tay định giá được sửa đổi, bổ sung như sau:

STT	Điều khoản	Nội dung của Điều lệ mới	Nội dung của Điều lệ cũ	Lý do sửa đổi, bổ sung
1	Phần II – Mục C. Cổ phiếu	<p>1. Cổ phiếu niêm yết, đăng ký giao dịch: giá đóng cửa tại ngày có giao dịch gần nhất trước ngày định giá. Trường hợp không có giao dịch nhiều hơn hai (02) tuần tính đến (nhưng không bao gồm) ngày định giá, thì sử dụng phương pháp định giá của cổ phiếu tại khoản C.2 của Sổ tay định giá này được quy định chi tiết dưới đây:</p> <p>2. Cổ phiếu đã đăng ký, lưu ký nhưng chưa niêm yết, chưa đăng ký giao dịch:</p> <p>Giá trị trung bình dựa trên báo giá (giá trung bình của các giao dịch trong kỳ) của tối thiểu ba (03) tổ chức báo giá không phải là người có liên quan tại ngày giao dịch gần nhất trước ngày định giá.</p> <p>Trường hợp không có đủ báo giá của tối thiểu ba (03) tổ chức báo giá, <u>giá cổ phiếu được xác định</u> là một trong các mức giá theo thứ tự ưu tiên sau:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Giá trung bình từ hai (02) tổ chức báo giá; - Giá của kỳ báo cáo gần nhất nhưng không quá ba (03) tháng tính đến (nhưng không bao gồm) ngày định giá; - Giá trị sổ sách; - Giá mua; - Giá xác định theo phương pháp đã được ban đại diện quỹ chấp thuận. 	<p>1. Cổ phiếu niêm yết, đăng ký giao dịch: giá đóng cửa tại ngày có giao dịch gần nhất trước ngày định giá. Trường hợp không có giao dịch nhiều hơn hai (02) tuần tính đến (nhưng không bao gồm) ngày định giá (<u>từ ngày T-14 đến hết ngày T-1</u>), thì sử dụng phương pháp định giá của cổ phiếu tại khoản C.2 của Sổ tay định giá này được quy định chi tiết dưới đây:</p> <p>2. Cổ phiếu đã đăng ký, lưu ký nhưng chưa niêm yết, chưa đăng ký giao dịch:</p> <p>Giá trị trung bình dựa trên báo giá (giá trung bình của các giao dịch trong kỳ) của tối thiểu 03 tổ chức báo giá không phải là người có liên quan tại ngày giao dịch gần nhất trước ngày định giá.</p> <p>Trường hợp không có đủ báo giá của tối thiểu 03 tổ chức báo giá, là một trong các mức giá theo thứ tự ưu tiên sau:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Giá trung bình từ 2 tổ chức báo giá; - Giá của kỳ báo cáo gần nhất nhưng không quá ba (03) tháng tính đến ngày định giá; - Giá trị sổ sách; - Giá mua; hoặc - Giá xác định theo phương pháp đã được ban đại diện quỹ chấp thuận. 	Chính lý, làm rõ

2	Phần III – Ghi chú	<ul style="list-style-type: none"> - Lãi lũy kế là: khoản lãi tính từ thời điểm trả lãi gần nhất tới <u>ngày</u> 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. - <u>Tổ chức định giá được lựa chọn hệ thống báo giá trái phiếu (Sở Giao Dịch Chứng Khoán Hà Nội/ Sở Giao Dịch Chứng Khoán Tp. Hồ Chí Minh/ Bloomberg/ Reuters/ VNBF) để tham khảo;</u> - Tổ chức báo giá đối với cổ phiếu là các công ty chứng khoán độc lập với Công ty Quản lý Quỹ và ngân hàng giám sát; - Tại phần này của Sổ tay định giá, ngày được hiểu là <u>ngày làm việc</u>. - T: ngày giao dịch là ngày thứ Ba hàng tuần. 	<ul style="list-style-type: none"> - Lãi lũy kế là: khoản lãi tính từ thời điểm trả lãi gần nhất tới <u>thời điểm</u> 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. - <u>Tổ chức định giá được lựa chọn hệ thống báo giá trái phiếu (Reuters/Bloomberg/VNBF...) để tham khảo;</u> - Tổ chức báo giá đối với cổ phiếu là các công ty chứng khoán độc lập với Công ty quản lý quỹ và Ngân hàng giám sát; - Tại phần này của Sổ tay định giá, ngày được hiểu là ngày <u>theo lịch</u>. - T: ngày giao dịch là ngày thứ Ba hàng tuần. 	Chỉnh lý, làm rõ
---	--------------------	---	---	------------------