

Danh mục cơ cấu ETF VN30 và Diamond kỳ Q4/2023

Mirae Asset Securities (Vietnam) JSC

Nguyễn Khánh Duy, duy.nk@miraeasset.com.vn; Trương Hoàng Tiến Hưng, hung.tht@miraeasset.com.vn;

Kết quả

- Theo đợt cơ cấu mới nhất, **DHC** bị loại khỏi rổ chỉ số **VNDiamond** và đồng thời **VRE và HDB** sẽ thêm vào tương ứng. Hiện tại, có 3 quỹ ETF đang sử dụng chỉ số này tham chiếu VFMVNDiamond, MAFM VNDiamond và BVFVN Diamond. Tuy nhiên, do tỷ trọng của VFMVN Diamond chiếm 95% tỷ trọng giao dịch cho nên chúng tôi chỉ đưa ra dự báo thay đổi cho riêng nhóm quỹ này.
- Còn đối với các quỹ sử dụng VN30 làm chỉ số tham chiếu vẫn giữ nguyên danh sách các mã cổ phiếu thành phần và có một vài thay đổi cơ cấu về khối lượng
- ❖ **Lưu ý, bộ chỉ số VNDiamond và VN30 sẽ có hiệu lực bắt đầu từ 06/11/2023 và các quỹ ETF mô phỏng theo chỉ số này phần lớn sẽ được giao dịch trong tuần sau từ 30/10-3/11 và chốt cơ cấu vào ngày 3/11.**

Tổng hợp giao dịch của các quỹ ETF VN30 và VNDiamond

STT	Mã	Mua/bán dự kiến		
		ETF VN30	ETF VNDiamond	Tổng
1	ACB	979,051	72,827	1,051,878
2	BCM	63,385	0	63,385
3	BID	131,063	0	131,063
4	BVH	43,599	0	43,599
5	CTG	480,457	-558,005	-77,548
6	DHC	0	-599,266	-599,266
7	FPT	753,316	-2,013,294	-1,259,977
8	GAS	3,968	0	3,968
9	GMD	0	6,588,120	6,588,120
10	GVR	41,407	0	41,407
11	HDB	-1,899,394	17,157,466	15,258,071
12	HPG	3,583,428	0	3,583,428
13	KDH	0	1,561,920	1,561,920
14	MBB	1,841,933	-2,903,445	-1,061,512
15	MSB	0	17,051,544	17,051,544
16	MSN	1,425,846	0	1,425,846
17	MWG	2,075,983	7,465,350	9,541,333
18	NLG	0	337,719	337,719
19	OCB	0	5,792,550	5,792,550
20	PLX	145,717	0	145,717
21	PNJ	0	-2,038,241	-2,038,241
22	POW	346,629	0	346,629
23	REE	0	309,743	309,743
24	SAB	-435,914	0	-435,914
25	SHB	-1,582,468	0	-1,582,468
26	SSB	821,561	0	821,561
27	SSI	825,774	0	825,774
28	STB	1,325,865	0	1,325,865
29	TCB	2,761,848	10,967,444	13,729,292
30	TPB	1,234,787	-1,325,225	-90,438
31	VCB	-567,011	0	-567,011
32	VHM	1,473,363	0	1,473,363
33	VIB	854,784	1,610,323	2,465,107
34	VIC	1,295,441	0	1,295,441
35	VJC	50,035	0	50,035
36	VNM	742,350	0	742,350
37	VPB	3,673,929	-2,264,471	1,409,458
38	VRE	1,107,109	11,710,638	12,817,747

Nguồn: Mirae Asset research tổng hợp

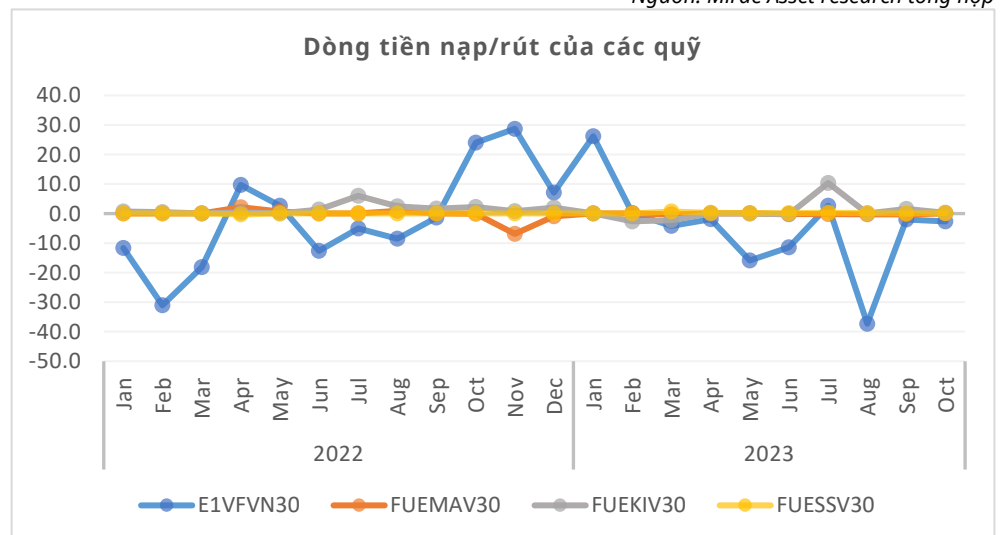
1) CHỈ SỐ VN30

- Hiện tại có 4 quỹ đang sử dụng chỉ số VN30 làm bộ chỉ số tham chiếu bao gồm E1FVN30, FUEMAV30, FUEKIV30, và FUESSV30. Trong đợt cơ cấu này, cả 4 quỹ lần lượt bán ra ở các mã **HDB, SAB, SHB và VCB**. Cụ thể:

Danh mục giao dịch các quỹ ETF VN30

STT	Mã	Thay đổi trong tính toán	Mua/bán dự kiến				Tổng
		Free-float (%)	E1FVN30	FUEMAV30	FUEKIV30	FUESSV30	
1	ACB	5.0%	862,475	37,762	64,921	13,893	979,051
2	BCM	0.0%	60,209	2,864	3,340	-3,028	63,385
3	BID	0.0%	117,002	3,438	8,867	1,756	131,063
4	BVH	0.0%	39,350	1,766	2,605	-122	43,599
5	CTG	0.0%	425,370	15,439	32,822	6,826	480,457
6	FPT	0.0%	661,832	30,283	50,833	10,368	753,316
7	GAS	0.0%	5,777	-1,075	-763	30	3,968
8	GVR	0.0%	35,628	818	4,317	644	41,407
9	HDB	0.0%	-1,703,134	-55,717	-117,439	-23,105	-1,899,394
10	HPG	0.0%	3,153,629	142,006	239,701	48,092	3,583,428
11	MBB	0.0%	1,614,785	73,673	127,809	25,666	1,841,933
12	MSN	0.0%	1,257,199	55,542	94,540	18,565	1,425,846
13	MWG	5.0%	1,828,130	81,966	138,555	27,332	2,075,983
16	PLX	0.0%	127,298	4,859	11,530	2,031	145,717
17	POW	-5.0%	301,027	11,068	29,598	4,936	346,629
18	SAB	0.0%	-383,734	-17,538	-29,097	-5,545	-435,914
31	SHB	0.0%	-1,423,729	-36,470	-103,170	-19,100	-1,582,468
32	SSB	-5.0%	814,081	9,938	-2,872	414	821,561
19	SSI	0.0%	724,264	32,920	57,227	11,362	825,774
20	STB	0.0%	1,162,707	52,942	91,872	18,344	1,325,865
21	TCB	0.0%	2,429,725	109,252	186,047	36,824	2,761,848
22	TPB	0.0%	1,084,180	49,709	83,880	17,017	1,234,787
23	VCB	0.0%	-505,243	-18,035	-36,766	-6,967	-567,011
24	VHM	5.0%	1,296,014	58,128	99,681	19,541	1,473,363
25	VIB	5.0%	749,238	29,356	64,186	12,004	854,784
26	VIC	0.0%	1,140,988	50,434	86,813	17,205	1,295,441
27	VJC	5.0%	46,274	1,211	1,971	579	50,035
28	VNM	0.0%	652,660	29,274	50,394	10,022	742,350
29	VPB	0.0%	3,244,588	140,529	240,406	48,406	3,673,929
30	VRE	0.0%	973,247	43,524	75,583	14,755	1,107,109

Nguồn: Mirae Asset research tổng hợp



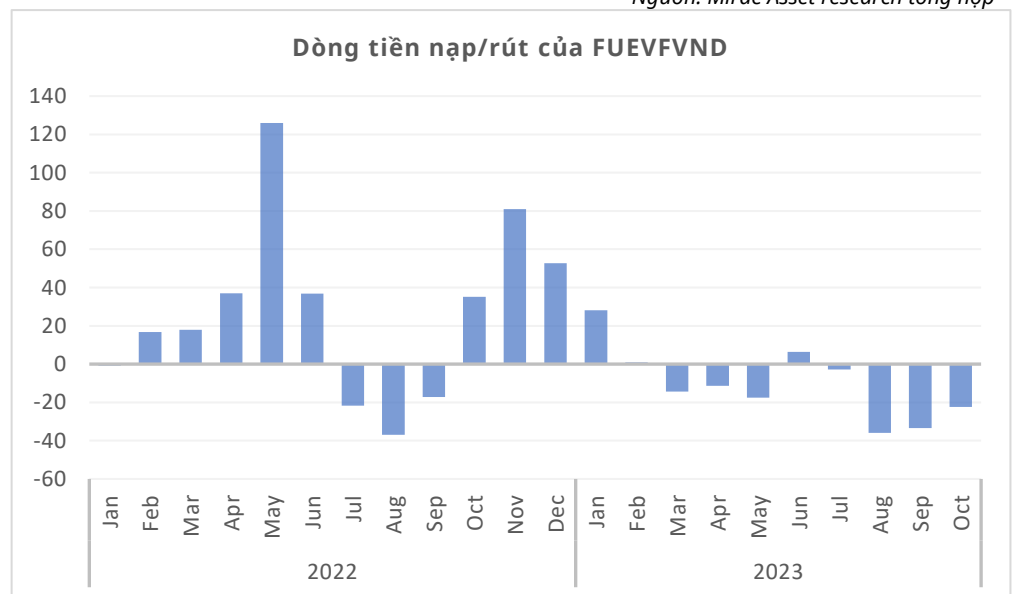
2) CHỈ SỐ VN Diamond

- ❖ Hiện tại, có 3 quỹ ETF đang sử dụng chỉ số này tham chiếu VFMVNDiamond, MAFM VNDiamond và BVFVN Diamond. Tuy nhiên, do tỷ trọng của VFMVNDiamond chiếm 95% tỷ trọng giao dịch cho nên chúng tôi chỉ đưa ra dự báo thay đổi cho riêng nhóm quỹ này.
- ❖ Chỉ số VNDiamond có sự thay đổi danh sách các cổ phiếu thành phần khi loại DHC để thêm vào VRE và HDB. Vì vậy, chúng tôi ước tính quỹ VFMVNDiamond sẽ mua vào hơn 17 tr cổ phiếu HDB và 11,7 triệu cổ phiếu VRE. Ngược lại, sẽ bán ra gần 600,000 cổ phiếu DHC. Cụ thể:

Danh mục giao dịch các quỹ ETF VNDiamond

STT	Mã	Chỉ số tính toán				Mua/bán dự kiến
		Free-float (%)	Giới hạn trọng số FOL	Giới hạn trọng số thanh khoản	Giới hạn trọng số vốn hóa	FUEVFVND
1	ACB	-5.0%	0.0%	0.0%	2.1%	72,827
2	CTG	0.0%	0.0%	0.0%	2.1%	-558,005
3	DHC	N/A	N/A	N/A	N/A	-599,266
4	FPT	0.0%	0.0%	0.0%	6.3%	-2,013,294
5	GMD	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	6,588,120
6	KDH	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1,561,920
7	MBB	0.0%	0.0%	0.0%	2.1%	-2,903,445
8	MSB	5.0%	0.0%	-50.0%	2.1%	17,051,544
9	MWG	-5.0%	0.0%	0.0%	-1.5%	7,465,350
10	NLG	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	337,719
11	OCB	0.0%	0.0%	-25.0%	2.1%	5,792,550
12	PNJ	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-2,038,241
13	REE	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	309,743
14	TCB	0.0%	0.0%	-25.0%	2.1%	10,967,444
15	TPB	0.0%	0.0%	0.0%	2.1%	-1,325,225
16	VIB	-5.0%	0.0%	0.0%	2.1%	1,610,323
17	VPB	0.0%	0.0%	0.0%	2.1%	-2,264,471
18	HDB	N/A	N/A	N/A	N/A	17,157,466
19	VRE	N/A	N/A	N/A	N/A	11,710,638

Nguồn: Mirae Asset research tổng hợp



Nguồn: Mirae Asset research tổng hợp

KHUYẾN CÁO

Báo cáo này được công bố bởi Công ty Cổ phần Chứng khoán Mirae Asset (Việt Nam) (MAS), công ty chứng khoán được phép thực hiện môi giới chứng khoán tại nước Cộng hòa xã hội chủ nghĩa Việt Nam và là thành viên của Sở giao dịch chứng khoán Việt Nam. Thông tin và ý kiến trong báo cáo này đã được tổng hợp một cách thiện chí và từ các nguồn được cho là đáng tin cậy, nhưng những thông tin đó chưa được xác minh một cách độc lập và MAS không cam đoan, đại diện hoặc bảo đảm, rõ ràng hay ngụ ý, về tính công bằng, chính xác, đầy đủ hoặc tính đúng đắn của thông tin và ý kiến trong báo cáo này hoặc của bất kỳ bản dịch nào từ tiếng Anh sang tiếng Việt. Trong trường hợp bản dịch tiếng Anh của báo cáo được chuẩn bị bằng tiếng Việt, bản gốc của báo cáo bằng tiếng Việt có thể đã được cung cấp cho nhà đầu tư trước khi thực hiện báo cáo này. Đối tượng dự kiến của báo cáo này là các nhà đầu tư tổ chức chuyên nghiệp, có kiến thức cơ bản về môi trường kinh doanh địa phương, các thông lệ chung, luật và nguyên tắc kế toán và không có đối tượng nào nhận hoặc sử dụng báo cáo này vi phạm bất kỳ luật và quy định nào hoặc quy định của MAS và các bên liên kết, chi nhánh đối với các yêu cầu đăng ký hoặc cấp phép ở bất kỳ khu vực tài phán nào sẽ nhận được hoặc sử dụng bất kỳ thông tin nào từ đây. Báo cáo này chỉ dành cho mục đích thông tin chung, không phải và sẽ không được hiểu là một lời đề nghị hoặc một lời mời chào để thực hiện bất cứ giao dịch chứng khoán hoặc công cụ tài chính nào khác. Báo cáo này không phải là lời khuyên đầu tư cho bất kỳ đối tượng nào và đối tượng đó sẽ không được coi là khách hàng của MAS khi nhận được báo cáo này. Báo cáo này không tính đến các mục tiêu đầu tư, tình hình tài chính hoặc nhu cầu cụ thể của các khách hàng cá nhân. Không được dựa vào báo cáo này để thực hiện quyết định độc lập. Thông tin và ý kiến có trong báo cáo này có giá trị kể từ ngày công bố và có thể thay đổi mà không cần thông báo trước. Giá và giá trị của các khoản đầu tư được đề cập trong báo cáo này và thu nhập từ các khoản đầu tư đó có thể giảm giá hoặc tăng giá, và các nhà đầu tư có thể phải chịu thua lỗ cho các khoản đầu tư. Hiệu suất trong quá khứ không phải là hướng dẫn cho hiệu suất trong tương lai. Lợi nhuận trong tương lai không được đảm bảo và có thể xảy ra mất vốn ban đầu. MAS, các chi nhánh và giám đốc, cán bộ nhân viên và đại diện của họ không chịu bất kỳ trách nhiệm pháp lý nào đối với bất kỳ tổn thất nào phát sinh từ việc sử dụng báo cáo này. MAS có thể đã đưa ra các báo cáo khác không nhất quán và đưa ra kết luận khác với các ý kiến được trình bày trong báo cáo này. Các báo cáo có thể phản ánh các giả định, quan điểm và phương pháp phân tích khác nhau của các nhà phân tích. MAS có thể đưa ra các quyết định đầu tư không phù hợp với các ý kiến và quan điểm được trình bày trong báo cáo nghiên cứu này. MAS, các chi nhánh và giám đốc, cán bộ nhân viên và đại diện có thể mua hoặc bán bất kỳ chứng khoán vào bất kỳ lúc nào và có thể thực hiện mua hoặc bán, hoặc đề nghị mua hoặc bán bất kỳ chứng khoán nào như vậy hoặc các công cụ tài chính khác tùy từng thời điểm trên thị trường hoặc theo cách khác, trong từng trường hợp, với tư cách là bên tự doanh hoặc môi giới. MAS và các chi nhánh có thể đã có, hoặc có thể tham gia vào các mối quan hệ kinh doanh với các công ty để cung cấp các dịch vụ ngân hàng đầu tư, tạo lập thị trường hoặc các dịch vụ tài chính khác được cho phép theo luật và quy định hiện hành. Không một phần nào của báo cáo này có thể được sao chép hoặc soạn thảo lại theo bất kỳ cách thức hoặc hình thức nào hoặc được phân phối lại hoặc xuất bản, toàn bộ hoặc một phần, mà không có sự đồng ý trước bằng văn bản của MAS.

Mirae Asset Securities International Network

Mirae Asset Securities Co., Ltd. (Seoul)

One-Asia Equity Sales Team
Mirae Asset Center 1 Building
26 Eulji-ro 5-gil, Jung-gu, Seoul 04539
Korea

Tel: 82-2-3774-2124

Mirae Asset Securities (USA) Inc.

810 Seventh Avenue, 37th Floor
New York, NY 10019
USA

Tel: 1-212-407-1000

PT. Mirae Asset Sekuritas Indonesia

Equity Tower Building Lt. 50
Sudirman Central Business District
Jl. Jend. Sudirman, Kav. 52-53
Jakarta Selatan 12190
Indonesia
Tel: 62-21-515-3281

Mirae Asset Securities Mongolia UTsK LLC

#406, Blue Sky Tower, Peace Avenue 17
1 Khoroo, Sukhbaatar District
Ulaanbaatar 14240
Mongolia

Tel: 976-7011-0806

Shanghai Representative Office

38T31, 38F, Shanghai World Financial Center
100 Century Avenue, Pudong New Area
Shanghai 200120
China

Tel: 86-21-5013-6392

Mirae Asset Securities (HK) Ltd.

Units 8501, 8507-8508, 85/F
International Commerce Centre
1 Austin Road West
Kowloon
Hong Kong
Tel: 852-2845-6332

Mirae Asset Wealth Management (USA) Inc.

555 S. Flower Street, Suite 4410,
Los Angeles, California 90071
USA

Tel: 1-213-262-3807

Mirae Asset Securities (Singapore) Pte. Ltd.

6 Battery Road, #11-01
Singapore 049909
Republic of Singapore

Tel: 65-6671-9845

Mirae Asset Investment Advisory (Beijing) Co., Ltd

2401B, 24th Floor, East Tower, Twin Towers
B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District
Beijing 100022
China

Tel: 86-10-6567-9699

Ho Chi Minh Representative Office

7F, Saigon Royal Building
91 Pasteur St.
District 1, Ben Nghe Ward, Ho Chi Minh City
Vietnam

Tel: 84-8-3910-7715

Mirae Asset Securities (UK) Ltd.

41st Floor, Tower 42
25 Old Broad Street,
London EC2N 1HQ
United Kingdom

Tel: 44-20-7982-8000

Mirae Asset Wealth Management (Brazil) CCTVM

Rua Funchal, 418, 18th Floor, E-Tower Building
Vila Olimpia
Sao Paulo - SP
04551-060
Brazil
Tel: 55-11-2789-2100

Mirae Asset Securities (Vietnam) JSC

7F, Le Meridien Building
3C Ton Duc Thang St.
District 1, Ben Nghe Ward, Ho Chi Minh City
Vietnam

Tel: 84-8-3911-0633 (ext.110)

Beijing Representative Office

2401A, 24th Floor, East Tower, Twin Towers
B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District
Beijing 100022
China

Tel: 86-10-6567-9699 (ext. 3300)

Mirae Asset Capital Markets (India) Private Limited

Unit No. 506, 5th Floor, Windsor Bldg., Off CST
Road, Kalina, Santacruz (East), Mumbai - 400098
India

Tel: 91-22-62661336