

Bản tin ETF:

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VNDiamond, VN30 và VNFIN Lead kỳ Q1/2024

HOSE đã chính thức công bố kết quả rà soát danh mục các chỉ số cho kỳ Quý 1/2024. Xin lưu ý, các chỉ số mới sẽ có hiệu lực từ ngày 5/2/2024 và các ETF liên quan sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục với hạn cuối là ngày 2/2/2024.

Cụ thể các thay đổi chính trong kỳ này như sau:

1. Chỉ số VN30

Chỉ số VN30 không có thay đổi về danh mục trong kỳ này. Trong các ETF trên thị trường, hiện có 4 ETF đang sử dụng chỉ số VN30 làm tham chiếu bao gồm VFM VN30, SSIAM VN30, Mirae Asset VN30, và KIM VN30 với tổng tài sản ước tính là 8.952 tỷ đồng tại ngày 15/1/2024.

Riêng quỹ VFM VN30 hiện có tổng giá trị tài sản khoảng 7.854 tỷ đồng. Cụ thể, tổng giá trị tài sản quỹ đã tăng 4,3% so với đầu năm 2024, NAV tăng 2,6% so với đầu năm, giá trị vốn vào ròng 105 tỷ đồng từ đầu năm.

Chúng tôi ước tính danh mục chỉ số như sau:

Danh mục VN30 và giao dịch các quỹ ETF liên quan

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	GTVH điều chỉnh	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	FPT	95.400	1.269.968.875	85%	100%	102.982	8,64%	8,50%	0,14%	132.648	2.636.598	0,05
2	VPB	19.350	7.933.923.601	60%	100%	92.113	7,73%	8,87%	-1,14%	-5.278.977	19.043.103	0,28
3	ACB	25.300	3.884.050.358	90%	100%	88.440	7,42%	7,30%	0,12%	429.552	11.658.288	0,04
4	HPG	27.100	5.814.785.700	55%	100%	86.669	7,27%	7,16%	0,12%	392.993	23.494.429	0,02
5	TCB	34.300	3.522.510.811	65%	100%	78.534	6,59%	6,48%	0,11%	281.354	8.416.686	0,03
6	MBB	21.450	5.214.084.052	55%	100%	61.513	5,16%	5,08%	0,08%	352.394	19.550.349	0,02
7	STB	29.800	1.885.215.716	100%	100%	56.179	4,72%	4,64%	0,08%	231.659	19.267.742	0,01
8	VNM	67.000	2.089.955.445	40%	100%	56.011	4,70%	4,62%	0,08%	102.727	2.594.651	0,04
9	VCB	90.000	5.589.091.262	11%	100%	55.332	4,64%	4,57%	0,08%	75.548	1.756.240	0,04
10	MWG	42.900	1.462.398.388	80%	100%	50.190	4,21%	4,14%	0,07%	143.762	9.048.359	0,02
11	VIC	43.050	3.823.661.561	30%	100%	49.383	4,14%	4,08%	0,07%	140.958	2.665.356	0,05
12	MSN	65.600	1.430.843.406	50%	100%	46.932	3,94%	3,49%	0,45%	616.678	4.147.910	0,15
13	HDB	21.000	2.892.550.610	75%	100%	45.558	3,82%	3,51%	0,31%	1.335.519	12.473.336	0,11
14	VHM	41.600	4.354.367.488	25%	100%	45.285	3,80%	4,49%	-0,69%	-1.475.382	12.384.117	0,12
15	SHB	12.150	3.618.901.927	80%	100%	35.176	2,95%	2,90%	0,05%	355.758	31.887.963	0,01
16	SSI	33.000	1.499.138.669	70%	100%	34.630	2,91%	2,86%	0,05%	128.952	19.275.546	0,01
17	SSB	23.300	2.495.700.000	55%	100%	31.982	2,68%	2,64%	0,04%	168.672	2.073.499	0,08
18	VJC	105.200	541.611.334	55%	100%	31.338	2,63%	2,59%	0,04%	36.605	1.345.832	0,03
19	VIB	21.200	2.536.807.534	50%	100%	26.890	2,26%	2,44%	-0,19%	-781.609	4.884.073	0,16
20	CTG	31.400	5.369.991.748	15%	100%	25.293	2,12%	2,09%	0,03%	98.981	7.922.587	0,01
21	TPB	18.300	2.201.635.009	60%	100%	24.174	2,03%	2,00%	0,03%	162.325	11.277.231	0,01
22	VRE	22.950	2.272.318.410	40%	100%	20.860	1,75%	1,72%	0,03%	111.691	3.918.978	0,03
23	BID	46.600	5.700.435.900	4%	100%	10.626	0,89%	0,88%	0,01%	28.019	1.595.112	0,02

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	GTVH điều chỉnh	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
24	GAS	75.700	2.296.739.847	5%	100%	8.693	0,73%	0,72%	0,01%	14.111	817.065	0,02
25	SAB	60.400	1.282.562.372	11%	100%	8.521	0,72%	0,70%	0,01%	17.336	842.149	0,02
26	POW	11.400	2.341.871.600	20%	100%	5.339	0,45%	0,44%	0,01%	57.555	4.892.391	0,01
27	PLX	34.650	1.270.592.235	9%	100%	3.962	0,33%	0,36%	-0,03%	-79.857	934.619	0,09
28	GVR	20.550	4.000.000.000	4%	100%	3.288	0,28%	0,27%	0,00%	19.661	2.345.694	0,01
29	BVH	41.000	742.322.764	10%	100%	3.044	0,26%	0,25%	0,00%	9.122	369.647	0,02
30	BCM	59.500	1.035.000.000	4%	100%	2.463	0,21%	0,20%	0,00%	5.087	718.142	0,01

Nguồn: SSI Research

2. Chỉ số VNFIN Lead

Chỉ số VNFIN Lead loại cổ phiếu **SSB** ra khỏi danh mục do không thỏa mãn điều kiện về thanh khoản. Do đó, danh mục chỉ số mới sẽ bao gồm 20 cổ phiếu.

Tại ngày 15/1/2024, Quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF có tổng giá trị tài sản khoảng 2.087 tỷ đồng. Cụ thể, tổng giá trị tài sản quỹ đã giảm 8,8% so với đầu năm 2024, NAV tăng 5,4% so với đầu năm, quỹ bị rút ròng là -334 tỷ đồng từ đầu năm.

Cập nhật tỷ trọng danh mục mới và giao dịch của quỹ như sau:

Danh mục VNFINLead và giao dịch quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Trọng số thanh khoản	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	GTVH điều chỉnh	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số cổ phiếu mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	STB	29.800	1.885.215.716	100%	12%	88%	6.069	15,11%	13,49%	1,62%	1.132.689	19.267.742	0,06
2	VPB	19.350	7.933.923.601	60%	9%	76%	5.996	14,93%	14,79%	0,14%	148.252	19.043.103	0,01
3	SSI	33.000	1.499.138.669	70%	13%	100%	4.623	11,51%	10,01%	1,50%	950.206	19.275.546	0,05
4	TCB	34.300	3.522.510.811	65%	5%	100%	3.801	9,46%	10,24%	-0,78%	-473.810	8.416.686	0,06
5	ACB	25.300	3.884.050.358	90,0%	3,6%	100%	3.210	7,99%	7,88%	0,12%	96.169	11.658.288	0,01
6	MBB	21.450	5.214.084.052	55%	4%	100%	2.651	6,60%	7,85%	-1,25%	-1.216.239	19.550.349	0,06
7	SHB	12.150	3.618.901.927	80%	6%	100%	2.174	5,41%	5,72%	-0,31%	-530.298	31.887.963	0,02
8	VND	21.500	1.217.844.009	75%	11%	100%	2.172	5,41%	5,24%	0,17%	165.752	19.742.368	0,01
9	EIB	19.250	1.740.866.148	90%	6%	100%	1.834	4,57%	4,31%	0,26%	278.817	23.109.822	0,01
10	VCB	90.000	5.589.091.262	11%	2%	100%	1.372	3,42%	3,57%	-0,15%	-34.675	1.756.240	0,02
11	HDB	21.000	2.892.550.610	75%	3%	100%	1.321	3,29%	2,24%	1,05%	1.038.980	12.473.336	0,08
12	LPB	16.600	2.557.616.416	90%	3%	100%	955	2,38%	3,28%	-0,90%	-1.129.924	3.487.317	0,32
13	CTG	31.400	5.369.991.748	15%	3%	100%	784	1,95%	2,28%	-0,33%	-216.761	7.922.587	0,03
14	TPB	18.300	2.201.635.009	60%	3%	100%	749	1,87%	2,13%	-0,26%	-299.511	11.277.231	0,03
15	VIB	21.200	2.536.807.534	50%	2%	100%	621	1,55%	1,91%	-0,37%	-361.610	4.884.073	0,07
16	VCI	41.000	437.500.000	70%	5%	100%	615	1,53%	1,46%	0,08%	38.624	4.658.912	0,01
17	MSB	13.700	2.000.000.000	85%	3%	100%	589	1,47%	1,37%	0,10%	155.369	9.364.139	0,02
18	HCM	24.250	754.397.854	50%	4%	100%	359	0,89%	0,87%	0,02%	21.277	8.202.731	0,00
19	BID	46.600	5.700.435.900	4%	1%	100%	132	0,33%	0,38%	-0,05%	-22.129	1.595.112	0,01
20	OCB	15.300	2.054.824.294	55%	1%	100%	131	0,33%	0,32%	0,01%	9.428	6.201.785	0,00
	SSB	23.300	2.495.700.000				-	0,00%	0,67%	-0,67%	-596.104	2.073.499	0,29

Nguồn: SSI Research

3. Chỉ số VNDiamond

Chỉ số VNDiamond không có thay đổi về thành phần trong kỳ này với 18 cổ phiếu trong danh mục.

Trong các ETF trên thị trường, hiện có 3 ETF đang sử dụng chỉ số VNDiamond làm tham chiếu bao gồm VFMVN DIAMOND, MAFM VNDIAMOND và BVFVN DIAMOND với tổng giá trị tài sản ròng khoảng 17 nghìn tỷ đồng tại ngày 15/1/2024. Riêng quỹ VFMVN Diamond hiện có tổng giá trị tài sản ròng khoảng 16,8 nghìn tỷ đồng. Cụ thể, tổng giá trị tài sản quỹ đã giảm 2,5% so với đầu năm 2024, NAV tăng 2,4% so với đầu năm, tuy nhiên quỹ bị rút ròng là -849 tỷ đồng từ đầu năm.

Tỷ trọng danh mục chỉ số và giao dịch của quỹ như sau:

Danh mục VNDiamond và giao dịch quỹ VFM VNDiamond ETF

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Giới hạn trọng số theo FOL	Giới hạn trọng số theo thanh khoản	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	GTVH điều chỉnh	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	MWG	42.900	1.462.398.388	80%	100%	100%	64%	32.342	15,33%	12,75%	2,58%	10.124.079	9.048.359	1,12
2	FPT	95.400	1.269.968.875	85%	100%	50%	62%	31.821	15,08%	14,71%	0,37%	658.991	2.636.598	0,25
3	PNJ	84.500	334.559.621	85%	100%	100%	100%	24.030	11,39%	9,22%	2,17%	4.322.994	1.861.335	2,32
4	GMD	69.200	305.898.557	90%	100%	100%	100%	19.051	9,03%	9,89%	-0,86%	-2.090.746	1.278.785	1,63
5	ACB	25.300	3.884.050.358	90%	100%	75%	23%	15.335	7,27%	5,23%	2,04%	13.566.019	11.658.288	1,16
6	MBB	21.450	5.214.084.052	55%	100%	100%	23%	14.222	6,74%	7,34%	-0,60%	-4.698.600	19.550.349	0,24
7	TCB	34.300	3.522.510.811	65%	100%	75%	23%	13.618	6,45%	9,29%	-2,84%	-13.912.458	8.416.686	1,65
8	VPB	19.350	7.933.923.601	60%	50%	100%	23%	10.648	5,05%	5,46%	-0,41%	-3.589.729	19.043.103	0,19
9	REE	55.200	408.706.345	40%	100%	100%	100%	9.024	4,28%	4,78%	-0,50%	-1.532.149	672.783	2,28
10	VIB	21.200	2.536.807.534	50%	100%	100%	23%	6.217	2,95%	3,51%	-0,56%	-4.470.849	4.884.073	0,92
11	TPB	18.300	2.201.635.009	60%	100%	100%	23%	5.589	2,65%	2,89%	-0,24%	-2.214.606	11.277.231	0,20
12	MSB	13.700	2.000.000.000	85%	100%	100%	23%	5.385	2,55%	2,78%	-0,23%	-2.796.909	9.364.139	0,30
13	HDB	21.000	2.892.550.610	75%	50%	100%	23%	5.266	2,50%	1,90%	0,60%	4.779.758	12.473.336	0,38
14	NLG	36.000	384.777.471	70%	50%	100%	100%	4.848	2,30%	2,30%	0,00%	-9.018	1.868.689	0,00
15	CTG	31.400	5.369.991.748	15%	75%	100%	23%	4.386	2,08%	2,24%	-0,16%	-863.749	7.922.587	0,11
16	KDH	29.850	799.311.971	60%	25%	100%	100%	3.579	1,70%	2,02%	-0,32%	-1.824.582	1.740.505	1,05
17	OCB	15.300	2.054.824.294	55%	100%	75%	23%	2.998	1,42%	1,55%	-0,13%	-1.416.752	6.201.785	0,23
18	VRE	22.950	2.272.318.410	40%	13%	100%	100%	2.607	1,24%	1,38%	-0,14%	-1.056.403	3.918.978	0,27

Nguồn: SSI Research

Tổng hợp thay đổi về số lượng cổ phiếu mua bán của các quỹ ETF liên quan đến VN30, quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF và quỹ VFM VNDiamond ETF sau (dữ liệu tính đến ngày 15/1/2024):

Mã CK	Số lượng CP mua/bán				Số phiên giao dịch tương đương
	VFM VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, Mirae Assets VN30 ETF và the KIM VN30 ETF	SSIAM VNFIN Lead ETF	VFM VNDiamond	Tổng	
ACB	429.552	96.169	13.566.019	14.091.740	1,21
MWG	143.762	0	10.124.079	10.267.841	1,13
HDB	1.335.519	1.038.980	4.779.758	7.154.256	0,57
PNJ	0	0	4.322.994	4.322.994	2,32
STB	231.659	1.132.689	0	1.364.348	0,07
SSI	128.952	950.206	0	1.079.158	0,06
FPT	132.648	0	658.991	791.638	0,30
MSN	616.678	0	0	616.678	0,15
HPG	392.993	0	0	392.993	0,02
EIB	0	278.817	0	278.817	0,01
VND	0	165.752	0	165.752	0,01
VIC	140.958	0	0	140.958	0,05
VNM	102.727	0	0	102.727	0,04
POW	57.555	0	0	57.555	0,01
VCB	75.548	-34.675	0	40.873	0,06
VCI	0	38.624	0	38.624	0,01
VJC	36.605	0	0	36.605	0,03
HCM	0	21.277	0	21.277	0,00
GVR	19.661	0	0	19.661	0,01
SAB	17.336	0	0	17.336	0,02
GAS	14.111	0	0	14.111	0,02
BVH	9.122	0	0	9.122	0,02
BID	28.019	-22.129	0	5.890	0,03
BCM	5.087	0	0	5.087	0,01
NLG	0	0	-9.018	-9.018	0,00
PLX	-79.857	0	0	-79.857	0,09
SHB	355.758	-530.298	0	-174.540	0,03
SSB	168.672	-596.104	0	-427.432	0,37
VRE	111.691	0	-1.056.403	-944.712	0,30
CTG	98.981	-216.761	-863.749	-981.530	0,15
LPB	0	-1.129.924	0	-1.129.924	0,32
OCB	0	9.428	-1.416.752	-1.407.324	0,23
VHM	-1.475.382	0	0	-1.475.382	0,12
REE	0	0	-1.532.149	-1.532.149	2,28
KDH	0	0	-1.824.582	-1.824.582	1,05
GMD	0	0	-2.090.746	-2.090.746	1,63
TPB	162.325	-299.511	-2.214.606	-2.351.793	0,24
MSB	0	155.369	-2.796.909	-2.641.541	0,32
MBB	352.394	-1.216.239	-4.698.600	-5.562.444	0,32
VIB	-781.609	-361.610	-4.470.849	-5.614.068	1,15
VPB	-5.278.977	148.252	-3.589.729	-8.720.454	0,47
TCB	281.354	-473.810	-13.912.458	-14.104.914	1,74

Nguồn: SSI Research

CAM KẾT PHÂN TÍCH

Chuyên viên phân tích trong báo cáo này cam kết rằng (1) quan điểm thể hiện trong báo cáo phân tích này phản ánh chính xác quan điểm cá nhân đối với chứng khoán và/hoặc tổ chức phát hành và (2) chuyên viên phân tích đã/ đang/sẽ được miễn trách nhiệm bồi thường trực tiếp hoặc gián tiếp liên quan đến khuyến nghị cụ thể hoặc quan điểm trong báo cáo phân tích này.

KHUYẾN NGHỊ

Mua: Ước tính tiềm năng tăng giá lớn hơn hoặc bằng 10 điểm phần trăm so với mức tăng chung của thị trường trong 12 tháng tới.

Khả quan: Ước tính tiềm năng tăng giá dưới 10 điểm phần trăm so với mức tăng chung của thị trường trong 12 tháng tới.

Trung lập: Ước tính tiềm năng tăng giá tương đương so với mức tăng chung của thị trường trong 12 tháng tới.

Kém khả quan: Ước tính tiềm năng giảm giá dưới 10 điểm phần trăm so với mức tăng chung của thị trường trong 12 tháng tới.

Bán: Ước tính tiềm năng giảm giá lớn hơn hoặc bằng 10 điểm phần trăm so với mức tăng chung của thị trường trong 12 tháng tới.

TUYÊN BỐ MIỄN TRỪ

Các thông tin, tuyên bố, dự báo và dự đoán trong báo cáo này, bao gồm cả các ý kiến đã thể hiện, được dựa trên các nguồn thông tin mà SSI cho là đáng tin cậy, tuy nhiên SSI không đảm bảo sự chính xác và đầy đủ của các thông tin này. Báo cáo không có bất kỳ thông tin nhạy cảm về giá chưa công bố nào. Các ý kiến thể hiện trong báo cáo này được đưa ra sau khi đã được xem xét kỹ càng và cẩn thận và dựa trên thông tin tốt nhất chúng tôi được biết, và theo ý kiến cá nhân của chúng tôi là hợp lý trong các trường hợp tại thời điểm đưa ra báo cáo. Các ý kiến thể hiện trong báo cáo này có thể thay đổi bất kỳ lúc nào mà không cần thông báo. Báo cáo này không và không nên được giải thích như một lời đề nghị hay lời kéo để đề nghị mua hay bán bất cứ chứng khoán nào. SSI và các công ty con và/ hoặc các chuyên viên, giám đốc, nhân viên của SSI và công ty con có thể có vị thế hoặc có thể ảnh hưởng đến giao dịch chứng khoán của các công ty được đề cập trong báo cáo này và có thể cung cấp dịch vụ hoặc tìm kiếm để cung cấp dịch vụ ngân hàng đầu tư cho các công ty đó.

Tài liệu này chỉ được lưu hành nội bộ và không được công bố công khai trên báo chí hay bất kỳ phương tiện nào khác. SSI không chịu trách nhiệm đối với bất kỳ thiệt hại trực tiếp hay thiệt hại do hậu quả phát sinh từ việc sử dụng báo cáo này hay nội dung báo cáo này. Việc sử dụng bất kỳ thông tin, tuyên bố, dự báo, và dự đoán nào trong báo cáo này sẽ do người dùng tự quyết định và tự chịu rủi ro.

THÔNG TIN LIÊN HỆ

Trung tâm phân tích và tư vấn đầu tư

Hoàng Việt Phương

Giám đốc Trung Tâm phân tích và tư vấn đầu tư
phuonghv@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8729

Vĩ mô

Phạm Lưu Hưng

Kinh tế trưởng
hungpl@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8711

Thái Thị Việt Trinh

Chuyên viên phân tích Vĩ mô
trinhhtt@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8720

Phân tích Định lượng

Lê Huyền Trang

Chuyên viên cao cấp Phân tích dữ liệu
tranglh1@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321

Nguyễn Bùi Minh Châu

Chuyên viên Phân tích dữ liệu
chaunbm@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8706

Phân tích cổ phiếu KHCN

Ngô Thị Kim Thanh

Chuyên viên phân tích cao cấp
thanhtk@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3053

Dữ liệu

Nguyễn Thị Kim Tân

Chuyên viên hỗ trợ
tanntk@ssi.com.vn
Tel: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8715

Nguyễn Thị Anh Thư

Chuyên viên hỗ trợ
thunta2@ssi.com.vn
Tel: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8702

Chiến lược thị trường

Nguyễn Lý Thu Nga

Chuyên viên cao cấp Chiến lược đầu tư
nganlt@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3051

Nguyễn Quốc Bảo

Chuyên viên cao cấp Chiến lược đầu tư
baonq1@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3059

Hồ Hữu Tuấn Hiệu, CFA

Chuyên gia Chiến lược đầu tư
hieuhht1@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8704

Trần Thị Bảo Châu

Chuyên viên Chiến lược đầu tư
chauttb@ssi.com.vn
SốĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3043