

Bản tin ETF:

Kết quả thay đổi danh mục ETF kỳ Q1/2024

FTSE Russell và MVIS đã công bố kết quả danh mục các chỉ số mới. Lưu ý rằng danh mục mới sẽ có hiệu lực từ ngày **18/03**, do đó các quỹ ETF liên quan sẽ cần hoàn thành tái cơ cấu danh mục vào ngày **thứ 6 (15/03)** tới đây. Cụ thể thay đổi như sau:

1. FTSE Vietnam Index

- **FTSE Vietnam Index:** thêm **EVF**, không có cổ phiếu nào bị loại
- **FTSE Vietnam All-share Index:** thêm **EVF, OCB**, không có cổ phiếu nào bị loại. Tuy nhiên xin lưu ý rằng hiện tại không có ETF nào trực tiếp sử dụng chỉ số này nên các thay đổi này không ảnh hưởng tới các cổ phiếu.

Quỹ FTSE Vietnam Swap UCITS ETF có tổng giá trị tài sản là 364,6 triệu USD tại ngày 7/3/2024. Cụ thể, tổng giá trị tài sản quỹ đã tăng 4% so với đầu năm, trong đó giá trị vốn rút ròng là 11 triệu USD và NAV tăng 8% so với đầu năm. Chúng tôi ước tính quỹ sẽ mua vào khoảng 5,2 triệu cổ phiếu EVF (tỷ trọng 1,01%).

Chúng tôi ước tính tỷ trọng danh mục chỉ số và giao dịch của quỹ như sau:

FTSE Vietnam Index và FTSE Vietnam Swap UCITS ETF

TT	CP	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng hiện tại	+/-	+/- cổ phiếu	KLGD bình quân phiên	Số phiên giao dịch tương đương
1	HPG	14,22%	14,04%	0,17%	513.823	34.609.330	0,01
2	VHM	9,17%	8,99%	0,18%	382.226	9.536.643	0,04
3	VCB	8,75%	8,68%	0,07%	68.458	1.801.762	0,04
4	VIC	8,75%	8,92%	-0,17%	-334.022	7.089.065	0,05
5	VNM	8,34%	8,28%	0,06%	75.472	5.428.066	0,01
6	MSN	8,32%	8,23%	0,09%	106.210	5.744.586	0,02
7	SSI	6,81%	7,02%	-0,21%	-506.343	27.194.758	0,02
8	VRE	3,80%	3,73%	0,08%	267.540	15.547.179	0,02
9	DGC	3,66%	3,58%	0,08%	61.596	3.911.160	0,02
10	VJC	2,77%	2,68%	0,09%	78.481	775.301	0,10
11	VCI	2,33%	2,30%	0,03%	51.577	7.933.309	0,01
12	VND	2,31%	3,24%	-0,93%	-3.562.071	32.590.477	0,11
13	SHB	2,09%	2,05%	0,04%	291.128	34.271.514	0,01
14	VIX	1,92%	2,04%	-0,11%	-528.754	32.402.932	0,02
15	KBC	1,88%	1,97%	-0,09%	-234.769	10.218.803	0,02
16	NVL	1,80%	2,44%	-0,64%	-3.469.533	28.587.494	0,12
17	PDR	1,67%	1,07%	0,60%	1.919.554	11.735.042	0,16
18	GEX	1,55%	1,56%	-0,01%	-29.870	20.775.720	0,00
19	EIB	1,52%	1,51%	0,01%	69.207	18.915.032	0,00
20	PVD	1,31%	1,37%	-0,06%	-176.900	7.206.471	0,02
21	DIG	1,13%	1,30%	-0,17%	-560.907	22.310.929	0,03
22	VCG	1,05%	0,89%	0,16%	597.639	7.633.274	0,08
23	DXG	1,05%	1,04%	0,01%	42.586	10.763.689	0,00
24	HSG	1,01%	1,10%	-0,09%	-347.623	11.753.938	0,03
25	EVF	1,01%	0,00%	1,01%	5.213.323	15.580.132	0,33
26	POW	0,91%	0,89%	0,02%	153.748	7.926.972	0,02
27	DPM	0,84%	1,08%	-0,24%	-600.520	3.184.278	0,19

Nguồn: SSI Research

2. MarketVector Vietnam Local Index

Chỉ số MarketVector Vietnam Local Index thêm **FTS** và không loại cổ phiếu nào. Danh mục bao gồm 44 cổ phiếu.

Quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF có tổng giá trị tài sản 557,6 triệu USD tại ngày 7/3/2024. Cụ thể, tổng giá trị tài sản quỹ đã tăng 5,8% so với đầu năm, trong đó giá trị vốn rút ròng là 650 nghìn USD và NAV tăng 5,9% so với đầu năm. Chúng tôi ước tính quỹ sẽ mua vào khoảng 3,2 triệu cổ phiếu FTS (tỷ trọng 1,4%).

Ước tính danh mục chi tiết của quỹ như sau:

MarketVector Vietnam Local Index và VanEck Vectors Vietnam ETF

STT	CP	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng hiện tại	+/-	+/- cổ phiếu	KL đang nắm giữ	KLGD bình quân phiên	Số phiên giao dịch tương đương
1	VIC	8,00%	7,98%	0,02%	46.946	24.056.149	7.089.065	0,01
2	VNM	8,00%	7,88%	0,12%	241.674	15.030.741	5.428.066	0,04
3	VHM	7,00%	7,02%	-0,02%	-76.286	22.271.967	9.536.643	0,01
4	HPG	6,50%	6,86%	-0,36%	-1.625.544	30.309.897	34.609.330	0,05
5	VCB	6,00%	6,27%	-0,27%	-388.557	8.989.605	1.801.762	0,22
6	SSI	5,50%	5,82%	-0,32%	-1.210.952	21.067.008	27.194.758	0,04
7	MSN	4,70%	4,77%	-0,07%	-121.380	8.086.876	5.744.586	0,02
8	VND	4,22%	4,39%	-0,18%	-1.024.016	25.467.580	32.590.477	0,03
9	NVL	3,00%	3,13%	-0,13%	-1.106.576	25.350.258	28.587.494	0,04
10	VCI	2,79%	2,94%	-0,15%	-442.091	8.159.850	7.933.309	0,06
11	DGC	2,53%	2,84%	-0,31%	-357.421	3.219.832	3.911.160	0,09
12	VRE	2,39%	2,19%	0,20%	1.067.130	11.558.622	15.547.179	0,07
13	VIX	2,37%	2,54%	-0,17%	-1.221.283	17.404.717	32.402.932	0,04
14	SHB	2,20%	2,13%	0,06%	753.584	24.544.456	34.271.514	0,02
15	PDR	1,83%	1,62%	0,22%	1.056.581	7.725.000	11.735.042	0,09
16	VHC	1,73%	1,77%	-0,04%	-67.476	3.171.460	1.264.927	0,05
17	EIB	1,73%	1,76%	-0,04%	-286.105	13.282.840	18.915.032	0,02
18	HUT	1,65%	1,65%	-0,01%	-47.332	12.106.600	5.648.880	0,01
19	SAB	1,60%	1,60%	0,00%	-1.433	3.624.600	1.652.236	0,00
20	GEX	1,58%	1,51%	0,07%	436.977	8.903.364	20.775.720	0,02
21	VJC	1,49%	1,39%	0,10%	131.472	1.836.740	775.301	0,17
22	DIG	1,48%	1,48%	0,00%	-9.374	7.410.686	22.310.929	0,00
23	KBC	1,43%	1,41%	0,02%	88.260	5.856.900	10.218.803	0,01
24	FTS	1,40%	0,00%	1,40%	3.235.648	-	1.602.076	2,02
25	VPI	1,29%	1,26%	0,03%	83.450	3.009.060	1.050.984	0,08
26	KDC	1,24%	1,14%	0,10%	222.554	2.471.430	1.454.409	0,15
27	SHS	1,18%	1,09%	0,09%	632.136	8.042.850	23.775.112	0,03
28	POW	1,13%	1,14%	-0,01%	-120.696	13.236.110	7.926.972	0,02
29	HAG	1,12%	1,14%	-0,02%	-246.484	12.055.600	14.868.722	0,02
30	IDC	1,12%	1,28%	-0,17%	-399.250	3.077.510	2.388.097	0,17
31	DPM	1,11%	1,12%	-0,01%	-21.770	4.313.000	3.184.278	0,01
32	PVS	1,09%	1,00%	0,09%	331.239	3.647.000	6.698.611	0,05
33	CEO	0,99%	1,04%	-0,05%	-331.797	6.399.700	11.767.292	0,03
34	VCG	0,99%	1,04%	-0,05%	-283.104	5.739.519	7.633.274	0,04
35	PVD	0,92%	0,94%	-0,02%	-109.243	4.084.288	7.206.471	0,02
36	DCM	0,88%	0,91%	-0,03%	-110.813	3.590.500	5.799.999	0,02
37	TCH	0,85%	0,87%	-0,01%	-150.579	9.064.220	7.727.861	0,02
38	BVH	0,85%	0,89%	-0,04%	-126.152	2.727.196	675.324	0,19
39	SBT	0,84%	0,85%	-0,01%	-114.087	8.788.999	3.039.917	0,04
40	DXG	0,82%	0,76%	0,07%	530.243	5.631.466	10.763.689	0,05
41	HSG	0,75%	0,79%	-0,04%	-237.788	4.700.001	11.753.938	0,02
42	KDH	0,70%	0,72%	-0,02%	-73.525	2.710.524	4.384.611	0,02
43	HDG	0,56%	0,47%	0,10%	451.816	2.246.600	3.008.625	0,15
44	HNG	0,45%	0,45%	0,00%	-136.915	15.037.100	6.982.356	0,02

Nguồn: SSI Research

Tổng hợp thay đổi về số lượng cổ phiếu mua bán của quỹ FTSE Vietnam Swap UCITS ETF và VanEck Vectors Vietnam ETF như sau (dữ liệu tính đến ngày 8/3/2024):

Mã CK	Số lượng CP mua/bán			Số phiên giao dịch tương đương
	FTSE Vietnam Swap UCITS ETF	VanEck Vectors Vietnam ETF	Tổng	
EVF	5.213.323	0	5.213.323	0,33
FTS	0	3.235.648	3.235.648	2,02
PDR	1.919.554	1.056.581	2.976.135	0,25
VRE	267.540	1.067.130	1.334.670	0,09
SHB	291.128	753.584	1.044.713	0,03
SHS	0	632.136	632.136	0,03
DXG	42.586	530.243	572.829	0,05
HDG	0	451.816	451.816	0,15
GEX	-29.870	436.977	407.108	0,02
PVS	0	331.239	331.239	0,05
VNM	75.472	241.674	317.145	0,06
VCG	597.639	-283.104	314.534	0,12
VHM	382.226	-76.286	305.940	0,05
KDC	0	222.554	222.554	0,15
VJC	78.481	131.472	209.953	0,27
VPI	0	83.450	83.450	0,08
POW	153.748	-120.696	33.052	0,03
SAB	0	-1.433	-1.433	0,00
MSN	106.210	-121.380	-15.170	0,04
HUT	0	-47.332	-47.332	0,01
VHC	0	-67.476	-67.476	0,05
KDH	0	-73.525	-73.525	0,02
DCM	0	-110.813	-110.813	0,02
SBT	0	-114.087	-114.087	0,04
BVH	0	-126.152	-126.152	0,19
HNG	0	-136.915	-136.915	0,02
KBC	-234.769	88.260	-146.510	0,03
TCH	0	-150.579	-150.579	0,02
EIB	69.207	-286.105	-216.898	0,02
HAG	0	-246.484	-246.484	0,02
PVD	-176.900	-109.243	-286.143	0,04
VIC	-334.022	46.946	-287.077	0,05
DGC	61.596	-357.421	-295.826	0,11
VCB	68.458	-388.557	-320.098	0,25
CEO	0	-331.797	-331.797	0,03
VCI	51.577	-442.091	-390.514	0,06
IDC	0	-399.250	-399.250	0,17
DIG	-560.907	-9.374	-570.281	0,03
HSG	-347.623	-237.788	-585.412	0,05
DPM	-600.520	-21.770	-622.290	0,20
HPG	513.823	-1.625.544	-1.111.721	0,06
SSI	-506.343	-1.210.952	-1.717.295	0,06
VIX	-528.754	-1.221.283	-1.750.037	0,05

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.

Báo cáo này không được sử dụng dưới bất kỳ mục đích thương mại nào, và không được công bố công khai trên báo chí hay bất kỳ phương tiện nào khác nếu không được sự đồng ý của SSI. Người dùng có thể trích dẫn hoặc trình chiếu báo cáo cho các mục đích phi thương mại. SSI có thể có thỏa thuận cho phép sử dụng cho mục đích thương mại hoặc phân phối lại báo cáo với điều kiện người dùng trả phí cho SSI. 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

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8729

Vĩ mô

Phạm Lưu Hưng

Kinh tế trưởng

hungpl@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8711

Thái Thị Việt Trinh

Chuyên viên phân tích Vĩ mô

trinhhtt@ssi.com.vn

SĐT: (+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

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321

Nguyễn Bùi Minh Châu

Chuyên viên Phân tích dữ liệu

chaunbm@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8706

Phân tích cổ phiếu KHCN

Ngô Thị Kim Thanh

Chuyên viên phân tích cao cấp

thanhntk@ssi.com.vn

SĐT: (+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

SĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3051

Nguyễn Quốc Bảo

Chuyên viên cao cấp Chiến lược đầu tư

baonq1@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3059

Hồ Hữu Tuấn Hiếu, CFA

Chuyên gia Chiến lược đầu tư

hieuhht1@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8704

Trần Thị Bảo Châu

Chuyên viên Chiến lược đầu tư

chauttb@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3043