

- Các quỹ ETF nội dự kiến sẽ thực hiện cơ cấu quý 1 vào ngày 02/02/2024.
- Chúng tôi dự báo VN30 & VNFIN Lead sẽ không thay đổi danh mục trong kỳ cơ cấu định kỳ lần này.
- Do đây không phải là kỳ thay đổi định kỳ, chỉ số VN Diamond sẽ không thay đổi danh mục trong lần này mà chỉ cập nhật lại dữ liệu liên quan của các cổ phiếu thành phần.

Chỉ số	Ngày thông báo	Ngày cơ cấu của quỹ	Ngày hiệu lực của chỉ số	Dự báo của PHS
VN30	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	Không thay đổi
VNFIN Lead	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	Không thay đổi

1. VN30 và cơ cấu quỹ DCVFMVN30 ETF

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 28/12, chúng tôi dự báo chỉ số VN30 sẽ giữ nguyên danh mục cổ phiếu thành phần trong kỳ cơ cấu lần này. Các quỹ ETF mô phỏng bộ chỉ số VN30 sẽ thực hiện tái cơ cấu trước khi bộ chỉ số có hiệu lực. Hiện có 4 quỹ ETF nội mô phỏng bộ chỉ số VN30 (bao gồm DCVFMVN30 ETF, KIM GROWTH VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF) với tổng quy mô tài sản khoảng 8,600 tỷ đồng. Trong đó, DCVFMVN30 ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với khoảng 7,500 tỷ đồng. Chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ DCVFMVN30 ETF như sau:

MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
	Hiện tại	Mới	Thay đổi		
VPB	7.66%	8.87%	1.21%	4,822,599	
FPT	9.00%	8.86%	-0.14%	(107,090)	
HPG	7.71%	7.59%	-0.12%	(313,854)	
ACB	7.16%	7.05%	-0.11%	(343,370)	
TCB	6.28%	6.13%	-0.15%	(367,055)	
VNM	4.94%	4.87%	-0.08%	(83,358)	
VHM	4.89%	4.85%	-0.04%	(73,986)	
MBB	4.59%	4.52%	-0.07%	(286,118)	
STB	4.49%	4.42%	-0.07%	(182,469)	
VIC	4.39%	4.33%	-0.06%	(93,931)	
VCB	4.39%	4.32%	-0.07%	(58,909)	
MWG	4.34%	4.28%	-0.06%	(111,035)	
MSN	3.73%	3.67%	-0.06%	(66,917)	
HDB	3.38%	3.33%	-0.05%	(203,645)	
SSI	2.99%	2.94%	-0.04%	(98,931)	
SSB	2.75%	2.76%	0.01%	18,183	
VJC	2.77%	2.73%	-0.04%	(28,864)	
SHB	2.70%	2.66%	-0.04%	(284,866)	
VIB	2.18%	2.33%	0.14%	551,653	
TPB	1.97%	1.94%	-0.03%	(131,099)	
CTG	1.88%	1.85%	-0.03%	(79,367)	
VRE	1.86%	1.81%	-0.05%	(157,650)	
BID	0.84%	0.83%	-0.01%	(17,924)	
SAB	0.75%	0.75%	-0.01%	(9,945)	
GAS	0.75%	0.74%	-0.01%	(11,879)	
POW	0.45%	0.45%	-0.01%	(48,343)	
PLX	0.38%	0.37%	-0.01%	(11,867)	
GVR	0.28%	0.28%	-0.01%	(19,063)	
BVH	0.25%	0.25%	0.00%	(4,822)	
BCM	0.22%	0.22%	0.00%	(2,497)	

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

Nguồn: PHS

2. VNFIN Lead và cơ cấu quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 28/12, chúng tôi dự báo chỉ số VNFIN Lead cũng sẽ không thay đổi danh mục cổ phiếu thành phần trong kỳ. Tuy nhiên, chúng tôi cũng lưu ý đến trường hợp của cổ phiếu SSB. Cổ phiếu này hiện có tỷ suất vòng quay thấp hơn 0.1% (tương tự như trong kỳ cơ cấu 7/2023). Tuy nhiên, do cổ phiếu này không bị loại ra trong kỳ tháng 7/2023 nên chúng tôi cũng kỳ vọng sẽ tiếp tục được giữ lại trong lần cơ cấu này. Quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF – mô phỏng bộ chỉ số VNFIN Lead sẽ thực hiện tái cơ cấu trước khi bộ chỉ số mới có hiệu lực. Chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ như sau:

MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
	Hiện tại	Mới	Thay đổi		
STB	13.28%	15.00%	1.72%	1,422,830	
VPB	15.28%	15.00%	-0.28%	(335,896)	
SSI	10.64%	12.17%	1.53%	1,061,240	
TCB	9.98%	9.22%	-0.76%	(551,959)	
ACB	7.86%	7.90%	0.04%	34,141	
MBB	7.22%	5.98%	-1.23%	(1,521,733)	
VND	5.73%	5.88%	0.14%	148,583	
SHB	5.41%	5.08%	-0.33%	(691,963)	
EIB	4.37%	4.60%	0.24%	297,923	
VCB	3.49%	3.29%	-0.20%	(54,749)	
HDB	2.20%	2.98%	0.79%	929,599	
LPB	3.32%	2.40%	-0.92%	(1,332,078)	
TPB	2.14%	1.85%	-0.28%	(376,043)	
CTG	2.09%	1.77%	-0.32%	(266,389)	
VCI	1.61%	1.68%	0.07%	38,462	
VIB	1.89%	1.66%	-0.23%	(267,444)	
MSB	1.36%	1.44%	0.08%	151,039	
HCM	0.78%	0.80%	0.01%	9,681	
SSB	0.71%	0.67%	-0.03%	(31,979)	
BID	0.37%	0.32%	-0.05%	(26,380)	
OCB	0.30%	0.30%	0.00%	7,007	

(Nguồn: PHS)

Đảm bảo phân tích

Báo cáo được thực hiện bởi Phạm Quang Chương, Chuyên viên phân tích – Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng. Mỗi nhân viên phụ trách về phân tích, chiến lược hay nghiên cứu chịu trách nhiệm cho sự chuẩn bị và nội dung của tất cả các phần có trong bản báo cáo nghiên cứu này đảm bảo rằng, tất cả các ý kiến của những người phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đều phản ánh trung thực và chính xác ý kiến cá nhân của họ về những vấn đề trong bản báo cáo. Mỗi nhân viên phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đảm bảo rằng họ không được hưởng bất cứ khoản chi trả nào trong quá khứ, hiện tại cũng như tương lai liên quan đến các khuyến cáo hay ý kiến thể hiện trong bản báo cáo này.

Miễn trừ trách nhiệm

Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng không chịu trách nhiệm về sự hoàn chỉnh hay tính chính xác của báo cáo. Đây không phải là bản chào hàng hay sự nài khẩn mua của bất cứ cổ phiếu nào. Chứng khoán Phú Hưng và các chi nhánh và văn phòng và nhân viên của mình có thể có hoặc không có vị trí liên quan đến các cổ phiếu được nhắc tới ở đây. Chứng khoán Phú Hưng (hoặc chi nhánh) đôi khi có thể có đầu tư hoặc các dịch vụ khác hay thu hút đầu tư hoặc các hoạt động kinh doanh khác cho bất kỳ công ty nào được nhắc đến trong báo cáo này. Tất cả các ý kiến và dự đoán có trong báo cáo này được tạo thành từ các đánh giá của Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng vào ngày này và có thể thay đổi không cần báo trước.

© Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng

Tầng 21, Phú Mỹ Hưng Tower,
8 Hoàng Văn Thái, Phường Tân Phú, Quận 7, Tp.HCM

Điện thoại: (84-28) 5 413 5479

Customer Service: 1900 25 23 58

E-mail: info@phs.vn / support@phs.vn

Fax: (84-28) 5 413 5472

Call Center: (84-28) 5 413 5488

Web: www.phs.vn

PGD Phú Mỹ Hưng

Tòa nhà CR2-08,
107 Tôn Dật Tiên, Phường Tân Phú, Quận 7,
Tp.HCM

Điện thoại: (+84-28) 5 413 5478

Fax: (+84-28) 5 413 5473

Chi nhánh Quận 1

Phòng 1003A, Tầng 10, Tòa nhà Ruby
81-83-83B-85 Hàm Nghi,
Phường Nguyễn Thái Bình, Quận 1, Tp.HCM Điện
thoại: (+84-28) 3 535 6060
Fax: (+84-28) 3 535 2912

Chi nhánh Quận 3

Tầng 4 và 5, D&D Tower,
458 Nguyễn Thị Minh Khai, Phường 2, Quận 3,
Tp.HCM
Điện thoại: (+84-28) 3 820 8068
Fax: (+84-28) 3 820 8206

Chi nhánh Tân Bình

Tòa nhà Park Legend,
251 Hoàng Văn Thụ, Phường 2, Quận Tân Bình,
Tp.HCM.
Điện thoại: (+84-28) 3 813 2401
Fax: (+84-28) 3 813 2415

Chi Nhánh Thanh Xuân

Tầng 5, Tòa nhà UDIC Complex,
N04 Hoàng Đạo Thúy, Phường Trung Hòa, Quận
Cầu Giấy, Hà Nội
Điện thoại: (+84-24) 6 250 9999
Fax: (+84-24) 6 250 6666

Chi Nhánh Hà Nội

Tầng 5, Tòa nhà Vinafor,
Số 127 Lò Đúc, Phường Đồng Mác, Quận Hai Bà
Trung, Hà Nội
Điện thoại: (+84-24) 3 933 4566
Fax: (+84-24) 3 933 4820

Chi nhánh Hải Phòng

Tầng 2, Tòa nhà Eliteco,
18 Trần Hưng Đạo, Quận Hồng Bàng,
Hải Phòng
Điện thoại: (+84-22) 384 1810
Fax: (+84-22) 384 1801