

Bản tin ETF:

Kết quả thay đổi danh mục HOSE-Index kỳ Q3/2021

HOSE đã chính thức công bố kết quả rà soát danh mục các chỉ số khá sát với dự báo của chúng tôi. Xin lưu ý, các chỉ số mới sẽ có hiệu lực từ ngày **2/8** và các ETF liên quan sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục với hạn cuối là ngày **30/7**.

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

1. Chỉ số VN30

- Thêm vào **ACB, SAB, GVR**
- Loại ra **TCH, SBT, REE**

Hiện tại có 3 ETF đang sử dụng chỉ số làm tham chiếu bao gồm VFM VN30, SSIAM VN30, Mirae Asset VN30, với tổng tài sản ước tính là 10.200 tỷ đồng. ACB là cổ phiếu được các quỹ mua vào nhiều nhất với khối lượng 19,1 triệu cp, bên cạnh VIC, VHM, VRE, SAB và GVR, trong khi các cổ phiếu còn lại sẽ giảm tỷ trọng để cân đối danh mục.

Ước tính cụ thể 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	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	TCB	48,000	3,504,906,230	65%	100%	8.88%	9.73%	-0.85%	-1,814,633	17,354,860	0.10
2	HPG	44,300	4,472,922,706	55%	100%	8.85%	9.70%	-0.85%	-1,959,536	27,795,790	0.07
3	VIC	102,900	3,382,430,590	35%	80%	7.96%	5.61%	2.35%	2,340,322	2,132,480	1.10
4	VPB	60,000	2,454,748,366	65%	100%	7.78%	8.52%	-0.74%	-1,270,924	30,344,110	0.04
5	ACB	32,150	2,701,948,075	85%	100%	6.00%	0.00%	6.00%	19,102,825	11,485,310	1.66
6	VNM	85,000	2,089,955,445	40%	100%	5.77%	7.91%	-2.13%	-2,570,706	3,570,235	0.72
7	VHM	104,300	3,289,513,918	25%	80%	5.60%	4.61%	1.00%	979,641	4,486,215	0.22
8	FPT	84,700	907,469,273	85%	100%	5.31%	5.47%	-0.17%	-200,856	2,519,115	0.08
9	MBB	27,150	3,778,321,777	55%	100%	4.58%	5.48%	-0.90%	-3,377,057	24,664,400	0.14
10	NVL	103,000	1,473,605,619	35%	100%	4.32%	4.73%	-0.41%	-410,817	2,766,368	0.15
11	MSN	119,400	1,180,534,692	35%	100%	4.01%	4.39%	-0.38%	-329,114	1,297,740	0.25
12	MWG	156,500	475,310,499	65%	100%	3.93%	4.30%	-0.38%	-246,088	713,090	0.35
13	STB	27,500	1,803,653,429	95%	100%	3.83%	4.19%	-0.37%	-1,364,821	27,875,380	0.05
14	VCB	97,000	3,708,877,448	11%	100%	3.21%	3.52%	-0.31%	-324,963	2,082,750	0.16
15	HDB	31,900	1,593,767,296	70%	100%	2.89%	3.17%	-0.28%	-888,632	4,927,305	0.18
16	VJC	114,000	541,611,334	50%	100%	2.51%	2.75%	-0.24%	-215,703	603,635	0.36
17	CTG	32,250	4,805,779,643	15%	100%	1.89%	2.76%	-0.87%	-2,764,229	17,786,980	0.16
18	SSI	49,300	654,914,616	65%	100%	1.70%	1.72%	-0.02%	-40,625	14,990,060	0.00
19	TPB	31,550	1,071,671,722	60%	100%	1.65%	1.81%	-0.16%	-512,168	4,461,985	0.11

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
20	VRE	26,800	2,272,318,410	40%	80%	1.59%	1.31%	0.28%	1,082,740	5,420,435	0.20
21	PDR	87,800	486,771,916	40%	100%	1.39%	1.52%	-0.13%	-155,090	5,280,715	0.03
22	PNJ	91,600	227,366,563	80%	100%	1.35%	1.48%	-0.13%	-144,882	354,780	0.41
23	KDH	37,300	623,086,429	65%	100%	1.23%	1.24%	-0.01%	-38,651	2,865,658	0.01
24	SAB	154,500	641,281,186	11%	100%	0.89%	0.00%	0.89%	586,736	199,900	2.94
25	GAS	86,700	1,913,950,000	5%	100%	0.67%	0.74%	-0.06%	-76,225	1,166,390	0.07
26	PLX	49,000	1,243,813,235	13%	100%	0.64%	0.71%	-0.06%	-128,795	4,024,555	0.03
27	BID	39,650	4,022,018,040	4%	100%	0.52%	0.57%	-0.05%	-128,145	4,168,370	0.03
28	POW	10,100	2,341,871,600	20%	100%	0.38%	0.42%	-0.04%	-373,072	11,849,230	0.03
29	GVR	29,200	4,000,000,000	4%	100%	0.38%	0.00%	0.38%	1,330,827	6,592,775	0.20
30	BVH	48,000	742,322,764	10%	100%	0.29%	0.32%	-0.03%	-59,128	1,520,850	0.04
31	REE	50,800	309,050,926	0%	100%	0.00%	0.63%	-0.63%	-1,267,538	676,180	1.87
32	SBT	18,000	617,158,147	0%	100%	0.00%	0.35%	-0.35%	-1,968,715	4,423,470	0.45
33	TCH	18,050	399,175,744	0%	100%	0.00%	0.35%	-0.35%	-2,000,991	5,548,455	0.36

Nguồn: SSI Research

2. Chỉ số VNFIN Lead

- Thêm vào **ACB, LPB, MSB, SSB, OCB, VIB**
- Loại ra **HCM**

Danh mục chỉ số mới sẽ có 19 cổ phiếu, bao gồm 16 cổ phiếu thuộc ngành Ngân hàng, 2 cổ phiếu Chứng khoán và 1 cổ phiếu Bảo hiểm. Quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF hiện có giá trị tài sản khoảng 2.700 tỷ đồng. Các cổ phiếu có khối lượng Mua nhiều nhất là ACB (12tr), LPB (3,7tr), MSB (2.2tr), OCB (1.1tr), SSB (1tr), ngược lại HCM sẽ bị bán ra với khối lượng 560k cổ phiếu.

Cụ thể ước tính danh mục 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	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số cổ phiếu mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	TCB	48,000	3,504,906,230	65%	11.89%	44%	14.82%	15.19%	-0.37%	-206,436	24,440,610	0.01
2	VPB	60,000	2,454,748,366	65%	13.26%	45%	14.82%	15.68%	-0.87%	-390,192	20,412,540	0.02
3	STB	27,500	1,803,653,429	95%	11.80%	100%	14.42%	15.92%	-1.50%	-1,468,632	30,460,540	0.05
4	MBB	27,150	3,778,321,777	55%	9.77%	100%	14.30%	15.53%	-1.23%	-1,220,249	29,252,540	0.04
5	ACB	32,150	2,701,948,075	85%	7.44%	100%	14.25%	0.00%	14.25%	11,968,803	9,670,710	1.24
6	CTG	32,250	4,805,779,643	15%	9.41%	100%	5.68%	12.68%	-7.01%	-5,864,774	22,772,200	0.26
7	SSI	49,300	654,914,616	65%	7.59%	100%	4.13%	6.77%	-2.63%	-1,442,184	13,550,330	0.11
8	LPB	25,550	1,074,638,915	90%	5.51%	100%	3.53%	0.00%	3.53%	3,732,833	7,983,415	0.47
9	VCB	97,000	3,708,877,448	11%	3.17%	100%	3.25%	7.75%	-4.50%	-1,251,753	1,974,180	0.63
10	HDB	31,900	1,593,767,296	70%	2.54%	100%	2.35%	4.70%	-2.36%	-1,994,810	4,237,510	0.47
11	MSB	26,850	1,175,000,000	75%	3.61%	100%	2.22%	0.00%	2.22%	2,228,375	11,301,340	0.20
12	SSB	37,000	1,208,744,208	75%	1.64%	100%	1.43%	0.00%	1.43%	1,041,409	2,324,495	0.45

TT	Mã CK	Giá	Khối lượng lưu hành	Tỷ lệ free-float	Trọng số thanh khoản	Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số cổ phiếu mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
13	TPB	31,550	1,071,671,722	60%	2.22%	100%	1.17%	1.68%	-0.51%	-439,079	4,940,820	0.09
14	OCB	26,450	1,095,906,343	55%	2.61%	100%	1.08%	0.00%	1.08%	1,101,941	4,109,695	0.27
15	VIB	41,750	1,553,142,993	45%	1.42%	100%	1.07%	0.00%	1.07%	695,175	2,082,685	0.33
16	EIB	25,950	1,229,432,904	85%	0.70%	100%	0.49%	1.17%	-0.68%	-706,886	558,225	1.27
17	VCI	48,500	333,000,000	65%	1.78%	100%	0.48%	0.85%	-0.37%	-204,961	3,105,230	0.07
18	BID	39,650	4,022,018,040	4%	2.34%	100%	0.39%	0.84%	-0.45%	-307,123	3,538,135	0.09
19	BVH	48,000	742,322,764	10%	1.28%	100%	0.12%	0.31%	-0.19%	-109,506	1,286,630	0.09
20	HCM	44,500	305,041,845	0%			0.00%	0.93%	-0.93%	-561,869	6,095,360	0.09

Nguồn: SSI Research

3. Chỉ số VNDiamond

Chỉ số VNDiamond không có thay đổi về thành phần trong kỳ này. Quỹ VFM VNDiamond ETF hiện có tổng tài sản khoảng 13.300 tỷ đồng. Chúng tôi ước tính 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 tỷ trọng vốn hóa	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	FPT	84,700	907,469,273	85%	36%	15.31%	16.07%	-0.75%	-1,182,202	2,778,355	0.43
2	MWG	156,500	475,310,499	65%	46%	14.61%	15.56%	-0.95%	-804,343	935,290	0.86
3	PNJ	91,600	227,366,563	80%	100%	10.93%	9.82%	1.10%	1,603,573	628,440	2.55
4	VPB	60,000	2,454,748,366	65%	12%	7.81%	8.04%	-0.23%	-502,129	20,364,230	0.02
5	TCB	48,000	3,504,906,230	65%	11%	7.81%	8.21%	-0.40%	-1,117,572	23,513,460	0.05
6	GMD	41,700	301,377,957	85%	100%	7.01%	6.30%	0.71%	2,258,409	2,764,815	0.82
7	ACB	32,150	2,701,948,075	85%	13%	6.26%	6.56%	-0.31%	-1,269,636	9,770,425	0.13
8	NLG	37,500	285,270,660	70%	100%	4.91%	4.10%	0.81%	2,878,893	2,272,855	1.27
9	MBB	27,150	3,778,321,777	55%	13%	4.78%	5.17%	-0.39%	-1,893,297	31,775,020	0.06
10	REE	50,800	309,050,926	45%	100%	4.63%	4.17%	0.47%	1,226,069	694,525	1.77
11	VIB	41,750	1,553,142,993	45%	13%	2.47%	2.72%	-0.25%	-794,423	1,847,720	0.43
12	EIB	25,950	1,229,432,904	85%	13%	2.30%	2.28%	0.02%	108,676	578,675	0.19
13	LPB	25,550	1,074,638,915	90%	13%	2.09%	2.07%	0.02%	100,581	8,744,920	0.01
14	MSB	26,850	1,175,000,000	75%	13%	2.00%	1.72%	0.28%	1,403,630	10,479,870	0.13
15	CTG	32,250	4,805,779,643	15%	13%	1.97%	2.60%	-0.63%	-2,608,060	24,073,430	0.11
16	TCM	85,000	71,260,358	45%	100%	1.79%	1.61%	0.18%	282,704	340,150	0.83
17	TPB	31,550	1,071,671,722	60%	13%	1.72%	1.70%	0.02%	66,869	5,054,040	0.01
18	CTD	59,500	74,283,673	55%	100%	1.59%	1.30%	0.29%	651,423	364,700	1.79

Nguồn: SSI Research

KHUYẾN CÁO

Các thông tin, tuyên bố, dự đoán trong bản báo cáo này, bao gồm cả các nhận định cá nhân, là dựa trên các nguồn thông tin tin cậy, tuy nhiên SSI không đảm bảo sự chính xác và đầy đủ của các nguồn thông tin này. Các nhận định trong bản báo cáo này được đưa ra dựa trên cơ sở phân tích chi tiết và cẩn thận, theo đánh giá chủ quan của chúng tôi, là hợp lý trong thời điểm đưa ra báo cáo. Các nhận định trong báo cáo này có thể thay đổi bất kỳ lúc nào mà không báo trước. Báo cáo này không nên được diễn giải như một đề nghị mua hay bán bất cứ một cổ phiếu nào. SSI và các công ty con; cũng như giám đốc, nhân viên của SSI và các công ty con có thể có lợi ích trong các công ty được đề cập tới trong báo cáo này. SSI có thể đã, đang và sẽ tiếp tục cung cấp dịch vụ cho các công ty được đề cập tới trong báo cáo này. SSI sẽ không chịu trách nhiệm đối với tất cả hay bất kỳ thiệt hại nào hay sự kiện bị coi là thiệt hại đối với việc sử dụng toàn bộ hay bất kỳ thông tin hoặc ý kiến nào của báo cáo này.

SSI nghiêm cấm việc sử dụng, và mọi sự in ấn, sao chép hay xuất bản toàn bộ hay từng phần bản Báo cáo này vì bất kỳ mục đích gì mà không có sự chấp thuận của SSI.

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

Chiến lược thị trường

Nguyễn Lý Thu Nga

Chuyên viên phân tích cao cấp

nganlt@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3051

Nguyễn Trọng Đình Tâm

Chuyên viên cao cấp Chiến lược đầu tư

tamntd@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8713

Phân tích kỹ thuật

Lương Biện Nhân Quyền

Trưởng phòng Chiến lược đầu tư

quyenlbn@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321

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

Nguyễn Thị Thanh Tú, CFA

Chuyên viên phân tích cao cấp

tuntt@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8718

Lê Huyền Trang

Chuyên viên phân tích cao cấp

tranglh@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8717

Dữ liệu

Nguyễn Thị Kim Tân

Chuyên viên hỗ trợ

tanntk@ssi.com.vn

Tel: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8715