

Bản tin ETF:

Kết quả thay đổi danh mục HOSE-Index kỳ Q1/2023

HOSE đã chính thức công bố kết quả rà soát danh mục các chỉ số cho kỳ Quý 1/2023. Xin lưu ý, các chỉ số mới sẽ có hiệu lực từ ngày 6/2 và các ETF liên quan sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục với hạn cuối là ngày 3/2.

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

1. Chỉ số VNFIN Lead

Chỉ số VNFIN Lead giữ nguyên danh mục như kỳ trước với 22 cổ phiếu thành phần, tuy nhiên tỷ trọng danh mục được tính lại theo số liệu cập nhật. Theo ước tính của chúng tôi, MBB, TCB, EIB, BID và VCB sẽ được tăng tỷ trọng nhiều nhất, trong khi VPB, MSB, SHB, SSI là các cổ phiếu bị giảm tỷ trọng nhiều nhất trong kỳ này. Quỹ SSIAM VNFIN Lead ETF hiện có tổng tài sản 3.700 tỷ đồng. Cụ thể 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	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số cổ phiếu mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	TCB	14,99%	14,05%	0,94%	1.245.434	4.426.595	0,28
2	STB	14,95%	15,22%	-0,27%	-397.454	17.893.550	0,02
3	VPB	14,83%	15,41%	-0,58%	-1.109.278	23.125.440	0,05
4	MBB	11,04%	10,16%	0,89%	1.780.508	8.059.605	0,22
5	ACB	7,15%	7,37%	-0,23%	-336.438	2.320.945	0,14
6	SSI	6,44%	7,17%	-0,73%	-1.406.503	15.589.280	0,09
7	SHB	4,39%	4,82%	-0,42%	-1.473.687	16.758.490	0,09
8	VND	3,88%	3,70%	0,18%	439.894	23.077.200	0,02
9	VCB	3,63%	3,10%	0,53%	227.275	1.311.675	0,17
10	CTG	2,90%	3,15%	-0,25%	-309.395	3.451.830	0,09
11	TPB	2,32%	2,00%	0,32%	537.560	4.417.930	0,12
12	SSB	2,23%	2,66%	-0,42%	-463.846	1.063.735	0,44
13	LPB	2,23%	2,02%	0,22%	547.502	11.728.350	0,05
14	HDB	2,03%	2,35%	-0,31%	-686.911	2.184.505	0,31
15	EIB	1,58%	0,57%	1,01%	1.406.395	3.243.545	0,43
16	MSB	1,32%	2,02%	-0,69%	-1.942.112	2.028.510	0,96
17	VIB	1,28%	1,27%	0,02%	28.141	3.419.085	0,01
18	VCI	1,14%	1,16%	-0,02%	-31.030	5.832.060	0,01
19	HCM	0,55%	0,53%	0,01%	18.493	4.994.005	0,00
20	BID	0,54%	0,00%	0,54%	450.979	1.642.845	0,27
21	OCB	0,37%	0,58%	-0,21%	-445.210	1.035.590	0,43
22	BVH	0,18%	0,00%	0,18%	137.013	456.265	0,30

Nguồn: SSI Research

2. Chỉ số VN30

Chỉ số VN30 sẽ thêm mới **BCM** đồng thời loại **KDH** ra khỏi danh mục. 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 8.950 tỷ đồng. Do có tỷ lệ free -float thấp nên tỷ BCM có tỷ trọng chỉ 0,33%, tương ứng khối lượng được mua là 360k cổ phiếu. Bên cạnh đó, VPB, NVL, POW, PDR và TPB cũng được tăng tỷ trọng. Ngược lại, các quỹ trên sẽ bán ra khối lượng 4 triệu cổ phiếu KDH và đa số các cổ phiếu còn lại trong danh mục. Cập nhật tỷ trọng danh mục chỉ số như sau:

Danh mục VN30 và giao dịch các quỹ ETF liên quan

TT	Mã CK	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	VPB	8,84%	8,23%	0,61%	2.808.600	27.616.640	0,10
2	FPT	7,31%	7,33%	-0,02%	-22.477	1.070.470	0,02
3	ACB	6,96%	6,98%	-0,02%	-69.200	3.028.135	0,02
4	VNM	6,44%	6,46%	-0,02%	-20.151	2.218.550	0,01
5	HPG	6,28%	6,30%	-0,02%	-77.090	33.837.080	0,00
6	TCB	6,23%	6,25%	-0,02%	-55.108	7.078.735	0,01
7	MSN	5,90%	5,91%	-0,02%	-15.443	950.875	0,02
8	VHM	5,42%	5,43%	-0,02%	-26.240	3.132.920	0,01
9	VIC	5,07%	5,08%	-0,01%	-22.983	2.988.145	0,01
11	STB	4,66%	4,68%	-0,01%	-45.443	24.371.220	0,00
10	MBB	4,47%	4,49%	-0,01%	-60.110	11.886.590	0,01
12	MWG	4,46%	4,47%	-0,01%	-26.456	2.743.775	0,01
13	VCB	4,41%	4,42%	-0,01%	-12.548	1.463.110	0,01
14	HDB	2,89%	2,89%	-0,01%	-42.441	3.215.810	0,01
15	VJC	2,82%	2,83%	-0,01%	-6.528	425.295	0,02
16	VRE	2,51%	2,52%	-0,01%	-21.909	2.833.005	0,01
17	VIB	2,28%	2,51%	-0,23%	-942.752	4.882.660	0,19
19	CTG	2,10%	2,10%	-0,01%	-17.376	4.286.715	0,00
18	TPB	2,02%	1,86%	0,16%	665.571	8.386.025	0,08
20	SSI	1,96%	1,97%	-0,01%	-25.127	23.151.060	0,00
21	NVL	1,42%	1,04%	0,38%	2.520.453	32.015.270	0,08
22	SAB	1,29%	1,29%	0,00%	-1.700	210.990	0,01
23	GAS	0,96%	0,96%	0,00%	-2.307	336.115	0,01
24	BID	0,88%	0,88%	0,00%	-4.877	1.677.215	0,00
25	POW	0,67%	0,54%	0,13%	1.005.170	7.848.980	0,13
26	PLX	0,45%	0,45%	0,00%	-3.063	748.300	0,00
27	PDR	0,40%	0,36%	0,04%	285.044	17.097.760	0,02
28	BVH	0,35%	0,35%	0,00%	-1.789	731.930	0,00
29	BCM	0,33%	0,00%	0,33%	359.383	101.965	3,52
30	GVR	0,24%	0,24%	0,00%	-3.857	2.199.800	0,00
	KDH	0,00%	1,19%	-1,19%	-4.055.937	2.276.815	1,78

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. Quỹ VFM VNDiamond ETF hiện có tổng tài sản 18.900 tỷ đồng. Với số liệu cập nhật mới, MWG (+18,3 triệu cp), GMD (+8,7 triệu cp), OCB (+6,6 triệu cp), KDH (+2,2 triệu cp) và VIB (+1,9 triệu cp) là các cổ phiếu được tăng tỷ trọng đáng kể trong kỳ này, trong khi hầu hết các cổ phiếu còn lại sẽ bị giảm tỷ trọng. Cập nhật danh mục chỉ số mới như sau:

Danh mục VNDiamond và giao dịch quỹ VFM VNDiamond ETF

TT	Mã CK	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD TB	Số phiên GD tương đương
1	FPT	15,05%	16,00%	-0,95%	-2.210.713	934.760	2,37
2	MWG	14,85%	10,79%	4,06%	18.333.768	2.193.375	8,36
3	PNJ	14,19%	15,76%	-1,57%	-3.399.727	228.805	14,86
4	TCB	8,50%	9,07%	-0,57%	-3.845.733	5.719.770	0,67
5	ACB	7,12%	7,45%	-0,33%	-2.490.580	2.461.765	1,01
6	REE	7,01%	8,12%	-1,11%	-2.969.647	403.550	7,36
7	MBB	6,10%	6,67%	-0,57%	-5.795.743	9.720.250	0,60
8	VPB	6,03%	6,75%	-0,72%	-7.015.902	25.529.160	0,27
9	GMD	5,91%	3,74%	2,17%	8.716.092	280.845	31,04
10	VIB	3,11%	2,88%	0,23%	1.938.680	3.595.305	0,54
11	MSB	2,80%	3,50%	-0,70%	-9.921.892	1.828.190	5,43
12	TPB	2,76%	2,92%	-0,16%	-1.357.558	7.014.330	0,19
13	KDH	1,90%	1,59%	0,31%	2.198.033	1.903.895	1,15
14	OCB	1,73%	1,13%	0,60%	6.562.993	1.099.145	5,97
15	CTG	1,43%	1,39%	0,04%	254.376	3.505.570	0,07
16	EIB	0,65%	0,67%	-0,02%	-123.154	3.288.040	0,04
17	NLG	0,51%	0,68%	-0,17%	-1.230.387	1.586.550	0,78
18	DHC	0,34%	0,17%	0,17%	816.841	252.112	3,24

Nguồn: SSI Research

4. Tổng hợp giao dịch của các ETF

Mã CK	VN30 ETFs	VFM VNDiamond	SSIAM VNFIN LEAD	Tổng
MWG	-26.456	18.333.768		18.307.312
GMD		8.716.092		8.716.092
OCB		6.562.993	-445.210	6.117.783
NVL	2.520.453			2.520.453
EIB		-123.154	1.406.395	1.283.241
VIB	-942.752	1.938.680	28.141	1.024.069
POW	1.005.170			1.005.170
DHC		816.841		816.841
LPB			547.502	547.502
BID	-4.877		450.979	446.101
VND			439.894	439.894
BCM	359.383			359.383
PDR	285.044			285.044
VCB	-12.548		227.275	214.727
BVH	-1.789		137.013	135.223
HCM			18.493	18.493
SAB	-1.700			-1.700
GAS	-2.307			-2.307
PLX	-3.063			-3.063
GVR	-3.857			-3.857
VJC	-6.528			-6.528
MSN	-15.443			-15.443
VNM	-20.151			-20.151
VRE	-21.909			-21.909
VIC	-22.983			-22.983
VHM	-26.240			-26.240
VCI			-31.030	-31.030
CTG	-17.376	254.376	-309.395	-72.395
HPG	-77.090			-77.090
TPB	665.571	-1.357.558	537.560	-154.427
STB	-45.443		-397.454	-442.896
SSB			-463.846	-463.846
HDB	-42.441		-686.911	-729.352
NLG		-1.230.387		-1.230.387
SSI	-25.127		-1.406.503	-1.431.630
SHB			-1.473.687	-1.473.687
KDH	-4.055.937	2.198.033		-1.857.904
FPT	-22.477	-2.210.713		-2.233.190
TCB	-55.108	-3.845.733	1.245.434	-2.655.407
ACB	-69.200	-2.490.580	-336.438	-2.896.218
REE		-2.969.647		-2.969.647
PNJ		-3.399.727		-3.399.727
MBB	-60.110	-5.795.743	1.780.508	-4.075.345
VPB	2.808.600	-7.015.902	-1.109.278	-5.316.580
MSB		-9.921.892	-1.942.112	-11.864.004

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

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

Đỗ Nam Tùng

Chuyên viên cao cấp Phân tích Định lượng

tungdn@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8709

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

Lê Huyền Trang

Chuyên viên phân tích cao cấp

tranglh@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8717

Chiến lược thị trường

Nguyễn Trọng Đình Tâm

Phó Giám đốc Chiến lược Đầu tư

tamntd@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8713

Nguyễn Lý Thu Nga

Chuyên viên phân tích cao cấp

nganlt@ssi.com.vn

SĐT: (+84 – 28) 3636 3688 ext. 3051

Dữ liệu

Nguyễn Thị Kim Tân

Chuyên viên hỗ trợ

tanntk@ssi.com.vn

Tel: (+84 – 24) 3936 6321 ext. 8715