

Bản tin ETF:

Dự báo thay đổi danh mục VNDiamond Index kỳ Q2.2023

Bộ chỉ số HOSE-Index, VNX-Index cùng các chỉ số đầu tư bao gồm VNDiamond, VNFIN Lead và VNFIN Select sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục cho kỳ Q2.2023 với một số mốc thời gian đáng chú ý sau:

Ngày chốt số liệu	31/03/2023
Ngày công bố	17/04/2023
Ngày hoàn thành cơ cấu danh mục	28/04/2023
Ngày chỉ số mới có hiệu lực	04/05/2023

Trong đó, chỉ số **VNDiamond** sẽ thực hiện rà soát thay đổi về danh mục thành phần, trong khi các chỉ số còn lại bao gồm VN30 và VNFIN Lead chỉ cập nhật số liệu và tính toán lại tỷ trọng danh mục.

Với số liệu ước tính vào ngày 24/3, chúng tôi dự báo chỉ số VNDiamond sẽ có các thay đổi như sau:

- **EIB** có thể bị loại khỏi chỉ số do không thỏa mãn yêu cầu về tỷ lệ FOL sau khi nhà đầu tư nước ngoài giảm sở hữu cổ phiếu
- **FPT, ACB** và **MSB** có thể bị giảm tỷ trọng đáng kể do thanh khoản giảm trong thời gian gần đây
- **GMD, NLG, CTG** có thể được nâng tỷ trọng nhờ tỷ lệ sở hữu của khối ngoại tăng giúp hệ số điều chỉnh FOL (wFOL) tăng

Giả định với các thay đổi như trên, danh mục chỉ số mới sẽ bao gồm 17 cổ phiếu, trong đó 9 cổ phiếu thuộc nhóm ngành Ngân hàng sẽ bị áp dụng mức tỷ trọng tối đa cho cả nhóm ngành là 40%. Quý VFMVN Diamond hiện có tổng giá trị tài sản khoảng 18.200 tỷ đồng. Chúng tôi ước tính tỷ trọng danh mục chỉ số và giao dịch của quý như sau:

Danh mục VNDiamond và giao dịch quỹ VFMVN Diamond ETF

Mã CK	Phân ngành	% Freefloat	wFOL	wL	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Thay đổi	Số lượng CP mua/bán	KLGD trung bình ngày	Số ngày giao dịch tương đương
FPT	Công nghệ Thông tin	85%	100%	75%	15,00%	15,68%	-0,68%	-1.534.124	680.300	2,26
MWG	Bán lẻ	75%	100%	100%	15,00%	13,94%	1,06%	4.611.632	1.606.365	2,87
PNJ	Hàng cá nhân & Gia dụng	80%	100%	100%	12,38%	13,25%	-0,87%	-1.819.355	276.455	6,58
TCB	Ngân hàng	65%	100%	100%	9,07%	8,27%	0,80%	5.190.026	2.264.300	2,29
GMD	Hàng & Dịch vụ Công nghiệp	90%	100%	100%	8,06%	5,19%	2,87%	11.150.246	323.575	34,46
VPB	Ngân hàng	70%	50%	100%	7,45%	6,90%	0,55%	5.203.558	18.322.270	0,28
MBB	Ngân hàng	55%	100%	100%	6,64%	6,04%	0,60%	5.903.313	6.467.385	0,91
REE	Hàng & Dịch vụ Công nghiệp	45%	100%	100%	6,45%	7,34%	-0,89%	-2.300.038	179.720	12,80
ACB	Ngân hàng	85%	100%	50%	5,29%	7,23%	-1,94%	-14.177.644	3.396.940	4,17
VIB	Ngân hàng	50%	100%	100%	3,31%	3,04%	0,27%	2.219.420	2.785.065	0,80
TPB	Ngân hàng	60%	100%	100%	3,13%	2,89%	0,24%	2.002.799	4.269.150	0,47
CTG	Ngân hàng	15%	75%	100%	2,31%	1,42%	0,89%	5.414.890	2.008.490	2,70
KDH	Bất động sản	65%	25%	100%	1,85%	1,81%	0,04%	276.542	1.092.190	0,25
MSB	Ngân hàng	80%	100%	50%	1,46%	2,64%	-1,18%	-16.262.697	1.432.935	11,35
OCB	Ngân hàng	55%	100%	75%	1,34%	1,65%	-0,31%	-3.256.481	360.100	9,04
NLG	Bất động sản	65%	25%	100%	0,93%	0,56%	0,37%	2.619.525	1.127.225	2,32
DHC	Tài nguyên Cơ bản	70%	25%	100%	0,34%	0,18%	0,16%	728.925	127.610	5,71
EIB	Ngân hàng	80%	25%	50%	0,00%	0,61%	-0,61%	-4.156.893	3.194.600	1,30

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
thanhtk@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