

Danh mục cơ cấu ETF kỳ Q1/2024

Mirae Asset Securities (Vietnam) JSC

Nguyễn Khánh Duy, duy.nk@miraeasset.com.vn; Trương Hoàng Tiến Hưng, hung.tht@miraeasset.com.vn;

Kết quả

- Theo đợt cơ cấu mới nhất, **SSB** bị loại khỏi rổ chỉ số **VNFin Lead**.
- Trong khi đó đối với các quỹ sử dụng **VN30, VNDiamond** làm chỉ số tham chiếu vẫn giữ nguyên danh sách các mã cổ phiếu thành phần khi chỉ có một vài thay đổi trong tỷ trọng tính toán.
- ❖ Lưu ý, bộ chỉ số **VN30, VNDiamond** và **VNFin Lead** sẽ có hiệu lực bắt đầu từ **05/02/2024** và các quỹ ETF mô phỏng theo chỉ số này phần lớn sẽ được giao dịch trong tuần sau từ **29/01-02/02** và chốt cơ cấu vào ngày **02/02/2024**.

Tổng hợp giao dịch của các quỹ ETF VN30 và VNDiamond

Stt	Mã	Mua/bán dự kiến			
		ETF VN30	ETF VNDiamond	ETF VNFin Lead	Tổng
1	ACB	48,813	12,509,928	91,372	12,650,113
2	BCM	-2,309	0	0	-2,309
3	BID	10,464	0	-21,769	-11,305
4	BVH	3,200	0	0	3,200
5	CTG	13,175	-1,172,397	-221,291	-1,380,513
6	FPT	13,940	250,884	0	264,824
7	GAS	1,761	0	0	1,761
8	GVR	1,034	0	0	1,034
9	HDB	1,113,904	5,135,448	1,044,178	7,293,530
10	HPG	59,408	0	0	59,408
11	MBB	39,826	-5,556,705	-1,228,172	-6,745,051
12	MSN	545,625	0	0	545,625
13	MWG	26,534	9,004,654	0	9,031,189
14	PLX	-92,413	0	0	-92,413
15	POW	9,268	0	0	9,268
16	SAB	7,339	0	0	7,339
17	SHB	53,828	0	-537,391	-483,563
18	SSB	30,163	0	-590,570	-560,407
19	SSI	25,531	0	955,031	980,562
20	STB	39,755	0	1,129,465	1,169,220
21	TCB	-98,789	-14,542,510	-474,508	-15,115,806
22	TPB	20,534	-2,554,562	-305,603	-2,839,631
23	VCB	13,697	0	-35,277	-21,580
24	VHM	-1,557,365	0	0	-1,557,365
25	VIB	-228,190	-5,000,994	-420,720	-5,649,904
26	VIC	23,999	0	0	23,999
27	VJC	7,235	0	0	7,235
28	VNM	15,025	0	0	15,025
29	VPB	-130,734	-4,169,655	160,809	-4,139,580
30	VRE	197,312	-1,018,942	0	-821,630
31	GMD	0	226,337	0	226,337
32	KDH	0	-2,020,246	0	-2,020,246
33	MSB	0	-3,102,135	151,957	-2,950,178
34	NLG	0	-368,018	0	-368,018
35	OCB	0	-1,071,569	15,257	-1,056,313
36	PNJ	0	2,880,831	0	2,880,831
37	REE	0	-1,433,733	0	-1,433,733
38	EIB	0	0	274,886	274,886
39	HCM	0	0	119,586	119,586
40	LPB	0	0	-1,133,634	-1,133,634
41	VCI	0	0	39,936	39,936
42	VND	0	0	166,950	166,950

Nguồn: Mirae Asset research

PLEASE SEE ANALYST CERTIFICATIONS AND IMPORTANT DISCLOSURES AND DISCLAIMERS IN APPENDIX 1 AT THE END OF REPORT.

1) CHỈ SỐ VN30

- ❖ Hiện tại có 4 quỹ đang sử dụng chỉ số VN30 làm bộ chỉ số tham chiếu gồm có **E1FVN30, FUEMAV30, FUEKIV30, FUESSV30**.

Danh mục giao dịch các quỹ ETF VN30

STT	Mã	Thay đổi trong tính toán	Mua/bán dự kiến				
		Free-float (%)	E1FVN30	FUEMAV30	FUEKIV30	FUESSV30	Tổng
1	ACB	0.0%	30,151	-16,700	27,250	8,111	48,813
2	BCM	0.0%	1,637	216	934	-5,096	-2,309
3	BID	0.0%	7,321	-208	2,905	445	10,464
4	BVH	0.0%	3,392	584	199	-975	3,200
5	CTG	0.0%	7,071	-2,198	6,577	1,725	13,175
6	FPT	0.0%	8,145	-5,159	8,320	2,633	13,940
7	GAS	0.0%	284	62	1,078	336	1,761
8	GVR	0.0%	-2,380	797	2,444	173	1,034
9	HDB	-5.0%	966,225	36,787	88,571	22,322	1,113,904
10	HPG	0.0%	38,744	-15,304	28,325	7,643	59,408
11	MBB	0.0%	19,802	-10,119	23,032	7,111	39,826
12	MSN	-5.0%	475,651	18,398	41,291	10,285	545,625
13	MWG	0.0%	18,337	-5,702	11,273	2,626	26,534
16	PLX	1.0%	-81,981	-3,615	-5,592	-1,225	-92,413
17	POW	0.0%	1,428	2,030	5,241	569	9,268
18	SAB	0.0%	5,550	-137	1,960	-34	7,339
31	SHB	0.0%	34,293	-8,032	20,062	7,504	53,828
32	SSB	0.0%	20,593	-3,620	10,091	3,099	30,163
19	SSI	0.0%	17,160	-3,287	9,102	2,556	25,531
20	STB	0.0%	28,780	-8,948	15,599	4,323	39,755
21	TCB	0.0%	-113,440	-9,885	18,707	5,828	-98,789
22	TPB	0.0%	9,944	-3,670	10,779	3,481	20,534
23	VCB	0.0%	10,073	-2,929	4,989	1,564	13,697
24	VHM	5.0%	-1,363,151	-71,475	-99,246	-23,493	-1,557,365
25	VIB	5.0%	-115,966	-41,410	-53,957	-16,857	-228,190
26	VIC	0.0%	15,581	-4,300	9,795	2,923	23,999
27	VJC	0.0%	4,443	-1,034	3,102	724	7,235
28	VNM	0.0%	10,093	-3,027	5,971	1,988	15,025
29	VPB	10.0%	319,819	-9,694	-356,689	-84,169	-130,734
30	VRE	0.0%	-57,133	245,057	7,146	2,242	197,312

Nguồn: Mirae Asset research

2) CHỈ SỐ VNDIAMOND

- ❖ Hiện tại có 3 quỹ ETF đang sử dụng chỉ số này tham chiếu **VFMVNDiamond**, **MAFM VNDiamond** và **BVFN Diamond**, tuy nhiên do tỷ trọng của **VFMVN Diamond** chiếm 95% tỷ trọng giao dịch cho nên chúng tôi chỉ đưa ra dự báo thay đổi cho riêng nhóm quỹ này.

Danh mục giao dịch các quỹ ETF VNDiamond

STT	Mã	Thay đổi trong tính toán				Mua/bán dự kiến
		Free-float (%)	Giới hạn trọng số FOL	Giới hạn trọng số thanh khoản	Giới hạn trọng số vốn hóa	FUEVFVND
1	ACB	0.0%	0.0%	25.0%	0.3%	12,509,928
2	CTG	0.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-1,172,397
3	FPT	0.0%	0.0%	0.0%	7.1%	250,884
4	GMD	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	226,337
5	HDB	5.0%	0.0%	25.0%	0.3%	5,135,448
6	KDH	-5.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-2,020,246
7	MBB	0.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-5,556,705
8	MSB	0.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-3,102,135
9	MWG	0.0%	0.0%	0.0%	15.5%	9,004,654
10	NLG	5.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-368,018
11	OCB	0.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-1,071,569
12	PNJ	0.0%	0.0%	25.0%	0.0%	2,880,831
13	REE	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-1,433,733
14	TCB	0.0%	0.0%	-25.0%	0.3%	-14,542,510
15	TPB	0.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-2,554,562
16	VIB	-5.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-5,000,994
17	VPB	-10.0%	0.0%	0.0%	0.3%	-4,169,655
18	VRE	0.0%	-0.5%	0.0%	0.0%	-1,018,942

Nguồn: Mirae Asset research

3) CHỈ SỐ VNFIN LEAD

- ❖ Chỉ số VNFin Lead có sự thay đổi danh sách các cổ phiếu thành phần khi loại **SSB** ra khỏi rổ chỉ số với khối lượng hơn **590,000 cổ phiếu**.

Danh mục giao dịch các quỹ ETF VNFin Lead

STT	Mã	Thay đổi trong tính toán			Mua/bán dự kiến
		Free-float (%)	Giới hạn trọng số thanh khoản	Giới hạn trọng số vốn hóa	FUESSVFL
1	ACB	0.0%	0.1%	0.0%	91,372
2	BID	0.0%	-0.2%	0.0%	-21,769
3	CTG	0.0%	-0.5%	0.0%	-221,291
4	EIB	0.0%	0.5%	0.0%	274,886
5	HCM	0.0%	0.2%	0.0%	119,586
6	HDB	5.0%	0.8%	0.0%	1,044,178
7	LPB	0.0%	-0.9%	0.0%	-1,133,634
8	MBB	0.0%	-0.7%	0.0%	-1,228,172
9	MSB	0.0%	0.2%	0.0%	151,957
10	OCB	0.0%	0.0%	0.0%	15,257
11	SHB	0.0%	-0.2%	0.0%	-537,391
12	SSB	N/A	N/A	N/A	-590,570
13	SSI	0.0%	2.0%	0.0%	955,031
14	STB	0.0%	0.0%	11.1%	1,129,465
15	TCB	0.0%	-0.3%	0.0%	-474,508
16	TPB	0.0%	-0.4%	0.0%	-305,603
17	VCB	0.0%	-0.1%	0.0%	-35,277
18	VCI	0.0%	0.3%	0.0%	39,936
19	VIB	-5.0%	-0.2%	0.0%	-420,720
20	VND	0.0%	0.6%	0.0%	166,950
21	VPB	-10.0%	-0.4%	15.4%	160,809

Nguồn: Mirae Asset research

KHUYẾN CÁO

Báo cáo này được công bố bởi Công ty Cổ phần Chứng khoán Mirae Asset (Việt Nam) (MAS), công ty chứng khoán được phép thực hiện môi giới chứng khoán tại nước Cộng hòa xã hội chủ nghĩa Việt Nam và là thành viên của Sở giao dịch chứng khoán Việt Nam. Thông tin và ý kiến trong báo cáo này đã được tổng hợp một cách thiện chí và từ các nguồn được cho là đáng tin cậy, nhưng những thông tin đó chưa được xác minh một cách độc lập và MAS không cam đoan, đại diện hoặc bảo đảm, rõ ràng hay ngụ ý, về tính công bằng, chính xác, đầy đủ hoặc tính đúng đắn của thông tin và ý kiến trong báo cáo này hoặc của bất kỳ bản dịch nào từ tiếng Anh sang tiếng Việt. Trong trường hợp bản dịch tiếng Anh của báo cáo được chuẩn bị bằng tiếng Việt, bản gốc của báo cáo bằng tiếng Việt có thể đã được cung cấp cho nhà đầu tư trước khi thực hiện báo cáo này. Đối tượng dự kiến của báo cáo này là các nhà đầu tư tổ chức chuyên nghiệp, có kiến thức cơ bản về môi trường kinh doanh địa phương, các thông lệ chung, luật và nguyên tắc kế toán và không có đối tượng nào nhận hoặc sử dụng báo cáo này vi phạm bất kỳ luật và quy định nào hoặc quy định của MAS và các bên liên kết, chi nhánh đối với các yêu cầu đăng ký hoặc cấp phép ở bất kỳ khu vực tài phán nào sẽ nhận được hoặc sử dụng bất kỳ thông tin nào từ đây. Báo cáo này chỉ dành cho mục đích thông tin chung, không phải và sẽ không được hiểu là một lời đề nghị hoặc một lời mời chào để thực hiện bất cứ giao dịch chứng khoán hoặc công cụ tài chính nào khác. Báo cáo này không phải là lời khuyên đầu tư cho bất kỳ đối tượng nào và đối tượng đó sẽ không được coi là khách hàng của MAS khi nhận được báo cáo này. Báo cáo này không tính đến các mục tiêu đầu tư, tình hình tài chính hoặc nhu cầu cụ thể của các khách hàng cá nhân. Không được dựa vào báo cáo này để thực hiện quyết định độc lập. Thông tin và ý kiến có trong báo cáo này có giá trị kể từ ngày công bố và có thể thay đổi mà không cần thông báo trước. Giá và giá trị của các khoản đầu tư được đề cập trong báo cáo này và thu nhập từ các khoản đầu tư đó có thể giảm giá hoặc tăng giá, và các nhà đầu tư có thể phải chịu thua lỗ cho các khoản đầu tư. Hiệu suất trong quá khứ không phải là hướng dẫn cho hiệu suất trong tương lai. Lợi nhuận trong tương lai không được đảm bảo và có thể xảy ra mất vốn ban đầu. MAS, các chi nhánh và giám đốc, cán bộ nhân viên và đại diện của họ không chịu bất kỳ trách nhiệm pháp lý nào đối với bất kỳ tổn thất nào phát sinh từ việc sử dụng báo cáo này. MAS có thể đã đưa ra các báo cáo khác không nhất quán và đưa ra kết luận khác với các ý kiến được trình bày trong báo cáo này. Các báo cáo có thể phản ánh các giả định, quan điểm và phương pháp phân tích khác nhau của các nhà phân tích. MAS có thể đưa ra các quyết định đầu tư không phù hợp với các ý kiến và quan điểm được trình bày trong báo cáo nghiên cứu này. MAS, các chi nhánh và giám đốc, cán bộ, nhân viên và đại diện có thể mua hoặc bán bất kỳ chứng khoán vào bất kỳ lúc nào và có thể thực hiện mua hoặc bán, hoặc đề nghị mua hoặc bán bất kỳ chứng khoán nào như vậy hoặc các công cụ tài chính khác tùy từng thời điểm trên thị trường hoặc theo cách khác, trong từng trường hợp, với tư cách là bên tự doanh hoặc môi giới. MAS và các chi nhánh có thể đã có, hoặc có thể tham gia vào các mối quan hệ kinh doanh với các công ty để cung cấp các dịch vụ ngân hàng đầu tư, tạo lập thị trường hoặc các dịch vụ tài chính khác được cho phép theo luật và quy định hiện hành. Không một phần nào của báo cáo này có thể được sao chép hoặc soạn thảo lại theo bất kỳ cách thức hoặc hình thức nào hoặc được phân phối lại hoặc xuất bản, toàn bộ hoặc một phần, mà không có sự đồng ý trước bằng văn bản của MAS.

Mirae Asset Securities International Network

Mirae Asset Securities Co., Ltd. (Seoul)

One-Asia Equity Sales Team
Mirae Asset Center 1 Building
26 Eulji-ro 5-gil, Jung-gu, Seoul 04539
Korea

Tel: 82-2-3774-2124

Mirae Asset Securities (USA) Inc.

810 Seventh Avenue, 37th Floor
New York, NY 10019
USA

Tel: 1-212-407-1000

PT. Mirae Asset Sekuritas Indonesia

Equity Tower Building Lt. 50
Sudirman Central Business District
Jl. Jend. Sudirman, Kav. 52-53
Jakarta Selatan 12190
Indonesia
Tel: 62-21-515-3281

Mirae Asset Securities Mongolia UTsK LLC

#406, Blue Sky Tower, Peace Avenue 17
1 Khoroo, Sukhbaatar District
Ulaanbaatar 14240
Mongolia

Tel: 976-7011-0806

Shanghai Representative Office

38T31, 38F, Shanghai World Financial Center
100 Century Avenue, Pudong New Area
Shanghai 200120
China

Tel: 86-21-5013-6392

Mirae Asset Securities (HK) Ltd.

Units 8501, 8507-8508, 85/F
International Commerce Centre
1 Austin Road West
Kowloon
Hong Kong
Tel: 852-2845-6332

Mirae Asset Wealth Management (USA) Inc.

555 S. Flower Street, Suite 4410,
Los Angeles, California 90071
USA

Tel: 1-213-262-3807

Mirae Asset Securities (Singapore) Pte. Ltd.

6 Battery Road, #11-01
Singapore 049909
Republic of Singapore

Tel: 65-6671-9845

Mirae Asset Investment Advisory (Beijing) Co., Ltd

2401B, 24th Floor, East Tower, Twin Towers
B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District
Beijing 100022
China

Tel: 86-10-6567-9699

Ho Chi Minh Representative Office

7F, Saigon Royal Building
91 Pasteur St.
District 1, Ben Nghe Ward, Ho Chi Minh City
Vietnam

Tel: 84-8-3910-7715

Mirae Asset Securities (UK) Ltd.

41st Floor, Tower 42
25 Old Broad Street,
London EC2N 1HQ
United Kingdom

Tel: 44-20-7982-8000

Mirae Asset Wealth Management (Brazil) CCTVM

Rua Funchal, 418, 18th Floor, E-Tower Building
Vila Olimpia
Sao Paulo - SP
04551-060
Brazil
Tel: 55-11-2789-2100

Mirae Asset Securities (Vietnam) JSC

7F, Le Meridien Building
3C Ton Duc Thang St.
District 1, Ben Nghe Ward, Ho Chi Minh City
Vietnam

Tel: 84-8-3911-0633 (ext.110)

Beijing Representative Office

2401A, 24th Floor, East Tower, Twin Towers
B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District
Beijing 100022
China

Tel: 86-10-6567-9699 (ext. 3300)

Mirae Asset Capital Markets (India) Private Limited

Unit No. 506, 5th Floor, Windsor Bldg., Off CST
Road, Kalina, Santacruz (East), Mumbai – 400098
India

Tel: 91-22-62661336