

Danh mục cơ cấu ETF kỳ Q2/2024

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, **MWG** bị loại ra khỏi chỉ số **VNDiamond** và được thay thế bằng **BMP**. Cụ thể, chúng tôi ước tính có hơn 46 triệu cổ phiếu MWG sẽ bị bán ra, trong khi đó có hơn 472 nghìn cổ phiếu BMP sẽ được mua vào tương ứng.
- Trong khi đó đối với các quỹ sử dụng **VN30**, **VNFin Lead** 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 **06/05/2024** và các quỹ ETF mô phỏng theo chỉ số này phần lớn sẽ được giao dịch trong tuần từ **29/04-03/05** và chốt cơ cấu vào ngày **03/05/2024**.

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	-456,694	7,293,771	112,648	6,949,725
2	BCM	23,499	0	0	23,499
3	BID	-29,808	0	27	-29,781
4	BMP	0	472,403	0	472,403
5	BVH	-13,493	0	0	-13,493
6	CTG	-99,774	-967,927	195,179	-872,522
7	EIB	0	0	202,027	202,027
8	FPT	-193,372	-841,097	0	-1,034,469
9	GAS	2,996	0	0	2,996
10	GMD	0	9,129,782	0	9,129,782
11	GVR	-44,589	0	0	-44,589
12	HCM	0	0	-13,686	-13,686
13	HDB	-325,467	12,947,376	176,072	12,797,981
14	HPG	-579,794	0	0	-579,794
15	KDH	0	4,013,072	0	4,013,072
16	LPB	0	0	-575,146	-575,146
17	MBB	-340,081	-5,583,432	1,430,656	-4,492,858
18	MSB	0	-2,550,761	267,524	-2,283,237
19	MSN	1,530,326	0	0	1,530,326
20	MWG	-110,860	-46,132,897	0	-46,243,757
21	NLG	0	4,567,155	0	4,567,155
22	OCB	0	2,511,264	14,398	2,525,662
23	PLX	3,683	0	0	3,683
24	PNJ	0	4,845,488	0	4,845,488
25	POW	-31,698	0	0	-31,698
26	REE	0	5,412,492	0	5,412,492
27	SAB	-1,202	0	0	-1,202
28	SHB	161,687	0	559,451	721,138
29	SSB	92,429	0	0	92,429
30	SSI	-96,164	0	240,520	144,355
31	STB	-57,705	0	147,981	90,275
32	TCB	-618,584	1,792,719	439,335	1,613,470
33	TPB	-23,862	-5,038,338	-252,425	-5,314,625
34	VCB	-55,558	0	-19,443	-75,001
35	VCI	0	0	14,503	14,503
36	VHM	-102,393	0	0	-102,393
37	VIB	-157,287	-3,667,491	-133,095	-3,957,873
38	VIC	-188,886	0	0	-188,886
39	VJC	-30,064	0	0	-30,064
40	VND	0	0	-4,012	-4,012
41	VNM	-58,334	0	0	-58,334
42	VPB	-243,115	-3,841,178	512,247	-3,572,046
43	VRE	-57,124	14,938,792	0	14,881,668

Nguồn: Mirae Asset research

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%	-364,232	-7,059	-71,985	-13,418	-456,694
2	BCM	0.0%	24,385	769	2,405	-4,059	23,499
3	BID	0.0%	-30,201	1,088	-223	-472	-29,808
4	BVH	0.0%	-17,355	1,018	3,599	-755	-13,493
5	CTG	0.0%	-87,598	1,268	-10,987	-2,457	-99,774
6	FPT	0.0%	-84,542	-543	-89,486	-18,800	-193,372
7	GAS	0.0%	961	355	1,557	123	2,996
8	GVR	0.0%	-5,202	1,627	-33,205	-7,809	-44,589
9	HDB	0.0%	-157,276	-1,592	-138,128	-28,471	-325,467
10	HPG	0.0%	-529,363	-1,315	-42,353	-6,763	-579,794
11	MBB	0.0%	-227,986	-2,402	-92,211	-17,482	-340,081
12	MSN	0.0%	1,522,429	619	5,703	1,575	1,530,326
13	MWG	0.0%	-59,628	-702	-41,902	-8,628	-110,860
16	PLX	0.0%	1,508	209	2,799	-833	3,683
17	POW	0.0%	-47,215	3,861	9,832	1,823	-31,698
18	SAB	0.0%	-11,737	765	8,388	1,382	-1,202
31	SHB	0.0%	37,707	4,883	96,367	22,731	161,687
32	SSB	0.0%	62,825	2,131	21,622	5,851	92,429
19	SSI	0.0%	-68,548	1,424	-24,381	-4,660	-96,164
20	STB	0.0%	-166,644	-156	89,213	19,882	-57,705
21	TCB	0.0%	-227,293	-1,921	-322,743	-66,626	-618,584
22	TPB	0.0%	-74,858	2,182	40,095	8,719	-23,862
23	VCB	0.0%	-57,533	-184	1,507	652	-55,558
24	VHM	0.0%	-112,487	-769	8,817	2,045	-102,393
25	VIB	0.0%	-108,911	-878	-38,163	-9,335	-157,287
26	VIC	0.0%	-123,537	-1,723	-53,085	-10,541	-188,886
27	VJC	0.0%	-28,168	19	-1,491	-424	-30,064
28	VNM	0.0%	-80,896	-566	18,999	4,130	-58,334
29	VPB	0.0%	-412,489	-2,386	141,180	30,579	-243,115
30	VRE	0.0%	-90,720	1,836	26,013	5,747	-57,124

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.
- ❖ Trong kỳ này, **MWG** bị loại ra khỏi chỉ số **VNDiamond** và được thay thế bằng **BMP**. Cụ thể, chúng tôi ước tính có hơn 46 triệu cổ phiếu MWG sẽ bị bán ra, trong khi đó có hơn 472 nghìn cổ phiếu BMP sẽ được mua vào tương ứng.

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	FUEFVND
1	ACB	0.0%	0.0%	25.0%	-9.5%	7,293,771
2	BMP	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	472,403
3	CTG	0.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-967,927
4	FPT	0.0%	0.0%	25.0%	-35.6%	-841,097
5	GMD	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	9,129,782
6	HDB	0.0%	50.0%	0.0%	-9.4%	12,947,376
7	KDH	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	4,013,072
8	MBB	0.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-5,583,432
9	MSB	0.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-2,550,761
10	MWG	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	-46,132,897
11	NLG	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	4,567,155
12	OCB	0.0%	0.0%	25.0%	-9.4%	2,511,264
13	PNJ	-5.0%	0.0%	0.0%	-11.3%	4,845,488
14	REE	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	5,412,492
15	TCB	0.0%	0.0%	25.0%	-10.9%	1,792,719
16	TPB	-10.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-5,038,338
17	VIB	-5.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-3,667,491
18	VPB	0.0%	0.0%	0.0%	-9.4%	-3,841,178
19	VRE	0.0%	12.5%	0.0%	0.0%	14,938,792

Nguồn: Mirae Asset research

3) CHỈ SỐ VNFIN LEAD

- ❖ Chỉ số VNFin Lead không có sự thay đổi thành phần ở trong kỳ cơ cấu này. Hiện chỉ có quỹ SSIAM VNFin lead ETF là sử dụng tracking theo chỉ số này.

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%	0.3%	0.0%	112,648
2	BID	0.0%	0.0%	0.0%	27
3	CTG	0.0%	0.7%	0.0%	195,179
4	EIB	0.0%	0.3%	0.0%	202,027
5	HCM	0.0%	-0.2%	0.0%	-13,686
6	HDB	0.0%	0.2%	0.0%	176,072
7	LPB	0.0%	-0.8%	0.0%	-575,146
8	MBB	0.0%	1.4%	0.0%	1,430,656
9	MSB	0.0%	0.4%	0.0%	267,524
10	OCB	0.0%	0.0%	0.0%	14,398
11	SHB	5.0%	0.1%	0.0%	559,451
12	SSI	0.0%	0.5%	0.0%	240,520
13	STB	0.0%	-1.3%	11.5%	147,981
14	TCB	0.0%	0.5%	0.0%	439,335
15	TPB	-10.0%	-0.1%	0.0%	-252,425
16	VCB	0.0%	-0.1%	0.0%	-19,443
17	VCI	0.0%	0.1%	0.0%	14,503
18	VIB	-5.0%	-0.1%	0.0%	-133,095
19	VND	0.0%	-0.1%	0.0%	-4,012
20	VPB	0.0%	-1.8%	24.2%	512,247

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