

Danh mục cơ cấu ETF kỳ Q3/2024

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 **NAB, SSB và VIX** là 3 mã cổ phiếu được thêm vào chỉ số **VNFin Lead** và không có mã nào bị loại. Cụ thể, chúng tôi ước tính NAB, SSB và VIX lần lượt được mua **98,100 cổ phiếu; 153,800 cổ phiếu và 724,900 cổ phiếu**.
  - 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 05/08/2024 và các quỹ ETF mô phỏng theo chỉ số này phần lớn sẽ được giao dịch trong tuần từ 29/07-02/08 và chốt cơ cấu vào ngày 02/08/2024.**

Tổng hợp giao dịch của các quỹ ETF VN30; VNDiamond và VNFinlead

Stt	Mã	Mua/bán dự kiến			
		ETF VN30	ETF VNDiamond	ETF VNFin Lead	Tổng
1	TCB	871,481	4,419,802	439,278	5,730,561
2	ACB	734,031	1,123,088	2,634,557	4,491,676
3	GMD	0	2,736,138	0	2,736,138
4	PNJ	0	2,626,519	0	2,626,519
5	OCB	0	2,380,332	-7,032	2,373,300
6	REE	0	2,081,027	0	2,081,027
7	MSB	0	1,892,072	17,026	1,909,098
8	SSB	1,224,251	0	153,800	1,378,051
9	VPB	818,838	812,263	-317,631	1,313,471
10	HDB	322,974	815,613	-16,112	1,122,474
11	MBB	723,342	204,565	143,641	1,071,549
12	POW	909,513	0	0	909,513
13	CTG	120,593	146,062	517,546	784,202
14	VIX	0	0	724,969	724,969
15	VIB	198,789	525,394	-18,779	705,405
16	TPB	163,539	504,509	-46,835	621,213
17	LPB	0	0	601,561	601,561
18	HPG	579,397	0	0	579,397
19	VHM	213,590	0	0	213,590
20	SHB	792,542	0	-587,986	204,555
21	VIC	198,381	0	0	198,381
22	MWG	187,097	0	0	187,097
23	VNM	150,092	0	0	150,092
24	NLG	0	102,312	0	102,312
25	VCB	104,680	0	-5,328	99,352
26	NAB	0	0	98,149	98,149
27	BID	44,641	0	48,645	93,286
28	VRE	133,082	-62,733	0	70,350
29	VJC	48,592	0	0	48,592
30	BMP	0	34,784	0	34,784
31	PLX	27,722	0	0	27,722
32	KDH	0	25,367	0	25,367
33	GVR	24,923	0	0	24,923
34	SAB	24,343	0	0	24,343
35	GAS	9,726	0	0	9,726
36	BCM	8,951	0	0	8,951
37	BVH	6,377	0	0	6,377
38	VCI	0	0	-16,438	-16,438
39	HCM	0	0	-40,006	-40,006
40	SSI	217,831	0	-259,826	-41,995
41	STB	327,907	0	-497,630	-169,723
42	EIB	0	0	-197,923	-197,923
43	VND	0	0	-369,916	-369,916
44	MSN	-375,813	0	0	-375,813
45	FPT	-1,635,998	-3,774,970	0	-5,410,968

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 **E1VFN30**, **FUEMAV30**, **FUEKIV30**, **FUESSV30**. Với tổng quy mô tài sản ròng ước tính hơn 9,3 nghìn tỷ đồng.
- ❖ Trong kỳ này, chỉ số VN30 không có sự thay đổi về thành phần mã cổ phiếu và chỉ thành đổi cấu phần tính toán.

#### Danh mục giao dịch các quỹ ETF VN30

STT	Mã	Thay đổi trong tính toán		Mua/bán dự kiến				
		Free-float (%)	Vốn hóa	E1VFN30	FUEMAV30	FUEKIV30	FUESSV30	Tổng
1	SSB	0.0%	0.0%	998,750	44,097	162,507	18,896	1,224,251
2	POW	5.0%	0.0%	728,024	41,184	125,484	14,821	909,513
3	TCB	0.0%	0.0%	712,899	25,062	117,787	15,732	871,481
4	VPB	0.0%	0.0%	656,378	25,599	120,600	16,262	818,838
5	SHB	0.0%	0.0%	638,193	35,479	119,153	-284	792,542
6	ACB	0.0%	0.0%	602,460	21,668	96,100	13,803	734,031
7	MBB	0.0%	0.0%	624,594	15,756	73,121	9,871	723,342
8	HPG	0.0%	0.0%	451,820	27,915	87,408	12,254	579,397
9	STB	0.0%	0.0%	259,896	13,293	48,096	6,621	327,907
10	HDB	-5.0%	0.0%	256,163	17,627	51,673	-2,490	322,974
11	SSI	0.0%	0.0%	176,738	10,755	26,702	3,637	217,831
12	VHM	0.0%	0.0%	167,993	7,097	33,755	4,745	213,590
13	VIB	0.0%	0.0%	155,599	8,908	30,251	4,030	198,789
16	VIC	0.0%	0.0%	155,687	9,488	29,218	3,988	198,381
17	MWVG	0.0%	0.0%	143,649	9,862	29,456	4,130	187,097
18	TPB	0.0%	0.0%	121,846	8,674	29,170	3,849	163,539
31	VNM	0.0%	0.0%	117,685	6,929	22,430	3,047	150,092
32	VRE	0.0%	0.0%	102,793	8,291	18,544	3,455	133,082
19	CTG	0.0%	0.0%	87,944	6,663	22,889	3,098	120,593
20	VCB	0.0%	0.0%	82,295	4,851	15,453	2,082	104,680
21	VJC	0.0%	0.0%	36,659	2,317	8,522	1,093	48,592
22	BID	0.0%	-21.3%	35,261	3,033	5,385	962	44,641
23	PLX	0.0%	0.0%	21,446	1,420	4,323	534	27,722
24	GVR	0.0%	0.0%	16,798	2,903	4,521	701	24,923
25	SAB	0.0%	0.0%	18,218	2,100	4,083	-59	24,343
26	GAS	0.0%	0.0%	6,387	868	1,985	486	9,726
27	BCM	0.0%	0.0%	11,788	1,541	120	-4,498	8,951
28	BVH	0.0%	0.0%	3,653	1,679	1,816	-772	6,377
29	MSN	5.0%	0.0%	-304,656	-14,596	-51,144	-5,417	-375,813
30	FPT	0.0%	0.0%	-1,307,856	-68,362	-233,753	-26,027	-1,635,998

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, không có thay đổi về thành phần với 18 mã cổ phiếu trong danh mục.
- ❖ **Lưu ý:** Hiện tại cổ phiếu **MWG** vẫn còn trong danh mục nắm giữ của quỹ **VFMVN Diamond** tính tới thời điểm cuối tháng 6 với khối lượng hơn 6 triệu cổ phiếu (chiếm khoảng 3,3% tỷ trọng danh mục). Mặc dù **MWG** đã bị loại khỏi danh mục thành phần chỉ số **VNDiamond** áp dụng kể từ kỳ tháng 4/2024.

### 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	FUEVFN
1	<b>MWG</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	N/A
2	<b>TCB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	4,419,802
3	<b>GMD</b>	-5.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2,736,138
4	<b>PNJ</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2,626,519
5	<b>OCB</b>	5.0%	0.0%	0.0%	3.2%	2,380,332
6	<b>REE</b>	0.0%	0.0%	0.0%	2.2%	2,081,027
7	<b>MSB</b>	5.0%	0.0%	0.0%	0.7%	1,892,072
8	<b>ACB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.9%	1,123,088
9	<b>HDB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	815,613
10	<b>VPB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	812,263
11	<b>VIB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	525,394
12	<b>TPB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	504,509
13	<b>MBB</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	204,565
14	<b>CTG</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	146,062
15	<b>NLG</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	102,312
16	<b>BMP</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	34,784
17	<b>KDH</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	25,367
18	<b>VRE</b>	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	-62,733
19	<b>FPT</b>	0.0%	0.0%	25.0%	-10.8%	-3,774,970

Nguồn: Mirae Asset research

### 3) CHỈ SỐ VNFIN LEAD

- ❖ Theo đợt cơ cấu mới nhất **NAB, SSB và VIX** là 3 mã cổ phiếu được thêm vào chỉ số VNFin Lead và không có mã nào bị loại. Cụ thể, chúng tôi ước tính NAB, SSB và VIX lần lượt được mua **98,100 cổ phiếu; 153,800 cổ phiếu và 724,900 cổ phiếu**. Hiện chỉ có quỹ SSIAM VNFin lead ETF là sử dụng mô phỏng 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%	0.1%	0.0%	2,634,557
2	VIX	#N/A	#N/A	#N/A	724,969
3	LPB	0.0%	-1.8%	0.0%	601,561
4	CTG	0.0%	0.1%	0.0%	517,546
5	TCB	0.0%	-0.5%	0.0%	439,278
6	SSB	#N/A	#N/A	#N/A	153,800
7	MBB	0.0%	-0.2%	0.0%	143,641
8	NAB	#N/A	#N/A	#N/A	98,149
9	BID	0.0%	0.0%	0.0%	48,645
10	MSB	-5.0%	0.2%	0.0%	17,026
11	VCB	0.0%	0.1%	0.0%	-5,328
12	OCB	0.0%	0.1%	0.0%	-7,032
13	HDB	0.0%	0.0%	0.0%	-16,112
14	VCI	0.0%	0.5%	0.0%	-16,438
15	VIB	0.0%	0.2%	0.0%	-18,779
16	HCM	0.0%	0.5%	0.0%	-40,006
17	TPB	0.0%	0.4%	0.0%	-46,835
18	EIB	0.0%	1.0%	0.0%	-197,923
19	SSI	0.0%	2.1%	0.0%	-259,826
20	VPB	0.0%	0.6%	0.0%	-317,631
21	VND	0.0%	2.5%	0.0%	-369,916
22	STB	0.0%	2.1%	0.0%	-497,630
23	SHB	0.0%	1.3%	0.0%	-587,986

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 vì 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**

<b>Mirae Asset Securities Co., Ltd. (Seoul)</b> 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	<b>Mirae Asset Securities (HK) Ltd.</b> Units 8501, 8507-8508, 85/F International Commerce Centre 1 Austin Road West Kowloon Hong Kong Tel: 852-2845-6332	<b>Mirae Asset Securities (UK) Ltd.</b> 41st Floor, Tower 42 25 Old Broad Street, London EC2N 1HQ United Kingdom  Tel: 44-20-7982-8000
<b>Mirae Asset Securities (USA) Inc.</b> 810 Seventh Avenue, 37th Floor New York, NY 10019 USA  Tel: 1-212-407-1000	<b>Mirae Asset Wealth Management (USA) Inc.</b> 555 S. Flower Street, Suite 4410, Los Angeles, California 90071 USA  Tel: 1-213-262-3807	<b>Mirae Asset Wealth Management (Brazil) CCTVM</b> Rua Funchal, 418, 18th Floor, E-Tower Building Vila Olimpia Sao Paulo - SP 04551-060 Brazil Tel: 55-11-2789-2100
<b>PT. Mirae Asset Sekuritas Indonesia</b> Equity Tower Building Lt. 50 Sudirman Central Business District Jl. Jend. Sudirman, Kav. 52-53 Jakarta Selatan 12190 Indonesia Tel: 62-21-515-3281	<b>Mirae Asset Securities (Singapore) Pte. Ltd.</b> 6 Battery Road, #11-01 Singapore 049909 Republic of Singapore  Tel: 65-6671-9845	<b>Mirae Asset Securities (Vietnam) JSC</b> 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)
<b>Mirae Asset Securities Mongolia UTsK LLC</b> #406, Blue Sky Tower, Peace Avenue 17 1 Khoroo, Sukhbaatar District Ulaanbaatar 14240 Mongolia  Tel: 976-7011-0806	<b>Mirae Asset Investment Advisory (Beijing) Co., Ltd</b> 2401B, 24th Floor, East Tower, Twin Towers B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District Beijing 100022 China  Tel: 86-10-6567-9699	<b>Beijing Representative Office</b> 2401A, 24th Floor, East Tower, Twin Towers B12 Jianguomenwai Avenue, Chaoyang District Beijing 100022 China  Tel: 86-10-6567-9699 (ext. 3300)
<b>Shanghai Representative Office</b> 38T31, 38F, Shanghai World Financial Center 100 Century Avenue, Pudong New Area Shanghai 200120 China  Tel: 86-21-5013-6392	<b>Ho Chi Minh Representative Office</b> 7F, Saigon Royal Building 91 Pasteur St. District 1, Ben Nghe Ward, Ho Chi Minh City Vietnam  Tel: 84-8-3910-7715	<b>Mirae Asset Capital Markets (India) Private Limited</b> Unit No. 506, 5th Floor, Windsor Bldg., Off CST Road, Kalina, Santacruz (East), Mumbai – 400098 India  Tel: 91-22-62661336