

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

LỊCH CƠ CẤU DANH MỤC CÁC QUỸ ETF Q3/2024

Tháng 7	Tháng 8	Tháng 9
Quỹ DCFVM VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF, KIM Growth VN30 ETF (VN30 Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 9,263.27 tỷ VND Ngày công bố: 15/07 Ngày giao dịch: 16/07 - 02/08 <p><i>Ước tính:</i> Top mua</p> <p>HPG, TCB, SSB, MWG</p> <p><i>Ước tính:</i> Top bán</p> <p>FPT, HDB, VRE, BMP</p>		
Quỹ DCFMVN DIAMOND ETF, MAFM VNDIAMOND ETF, BVFVN DIAMOND ETF (VNDiamond Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 12,570.02 tỷ VND Ngày công bố: 15/07 Ngày giao dịch: 16/07 - 02/08 <p><i>Ước tính:</i> Top mua</p> <p>PNJ, TCB, ACB, MBB, HDB</p> <p><i>Ước tính:</i> Top bán</p> <p>FPT, GMD</p>		
Quỹ SSIAM VNFIN LEAD ETF, VFM VNMIDCAP ETF, Vina Capital VN100 ETF,... (6 quỹ)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 2,273.70 tỷ VND Ngày công bố: 15/07 Ngày giao dịch: 16/07 - 02/08 		
Quỹ Fubon FTSE Vietnam ETF (FTSE Vietnam Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 18,141.32 tỷ VND 		<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 06/09 Ngày giao dịch: 07/09 - 20/09 <p>(Dự báo danh mục: 01/09/2024)</p>
Quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF (MarketVector Vietnam Local Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 12,800.64 tỷ VND 		<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 13/09 Ngày giao dịch: 14/09 - 20/09 <p>(Dự báo danh mục: 01/09/2024)</p>

Nguồn: DSC tổng hợp dựa vào dữ liệu ngày 15/07/2024

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

TỔNG HỢP THAY ĐỔI VỀ SỐ LƯỢNG CỔ PHIẾU CỦA CÁC QUỸ ETF THEO CHỈ SỐ VN30 VÀ VNDIAMOND Q3/2024

Mã	+/- CP 4 quỹ theo VN30	+/- CP 3 quỹ theo VNDiamond	Tổng SLCP mua bán	Tổng giá trị giao dịch (đồng)	Số phiên GD tương ứng (SLCP / KLGDTB 3 tháng)
TCB	1,456,267	7,800,439	9,256,706	209,664,386,327	1.41
ACB	1,073,964	3,509,218	4,583,183	109,767,222,251	0.58
HDB	1,078,067	2,352,631	3,430,699	83,709,044,926	0.50
MBB	1,068,809	2,509,083	3,577,892	82,470,418,993	0.27
VPB	1,235,593	2,115,692	3,351,285	63,004,157,676	0.23
CTG	436,450	763,910	1,200,360	38,531,542,457	0.19
HPG	1,263,264	-	1,263,264	35,939,868,697	0.06
VIB	402,871	1,154,662	1,557,534	33,175,465,259	0.36
SSB	1,573,883	-	1,573,883	32,736,766,400	0.93
MWG	507,788	-	507,788	32,650,794,115	0.06
TPB	322,753	976,589	1,299,342	22,933,383,700	0.18
VCB	251,688	-	251,688	22,022,734,578	0.19
STB	700,895	-	700,895	20,851,623,429	0.05
VNM	259,622	-	259,622	17,186,981,574	0.09
SHB	1,416,366	-	1,416,366	16,925,573,700	0.07
SSI	455,991	-	455,991	15,640,491,287	0.02
VHM	405,356	-	405,356	15,403,532,285	0.06
VIC	368,900	-	368,900	15,254,033,218	0.07
POW	891,900	-	891,900	13,556,872,507	0.13
VJC	123,940	-	123,940	12,914,594,891	0.15
SAB	140,316	-	140,316	7,829,615,019	0.18
VRE	155,164	186,291	341,456	6,948,619,502	0.05
PLX	90,863	-	90,863	4,361,422,307	0.08
BID	67,009	-	67,009	3,119,284,707	0.05
BVH	23,186	-	23,186	1,067,734,387	0.05
GVR	(36,014)	-	(36,014)	(1,386,543,046)	(0.01)
GAS	(22,575)	-	(22,575)	(1,767,609,471)	(0.03)
BCM	(203,839)	-	(203,839)	(13,697,950,696)	(0.38)
MSN	(365,739)	-	(365,739)	(27,247,528,574)	(0.11)
FPT	(1,648,870)	(3,067,333)	(4,716,202)	(625,840,053,761)	(1.53)

Nguồn: DSC ước tính dựa vào số liệu ngày 15/07/2024

KẾT QUẢ THAY ĐỔI DANH MỤC CHI TIẾT

- HOSE đã chính thức công bố kết quả rà soát danh mục các chỉ số vào ngày 15/7/2024.
- Các chỉ số mới sẽ có hiệu lực từ ngày 5/8/2024. Danh sách cổ phiếu thành phần của chỉ số VN30 và VNDiamond **không thay đổi** trong kỳ này. Điều này giống với dự báo của DSC.

1. CHỈ SỐ VN30

Hiện có 4 quỹ ETF nội sử dụng chỉ số VN30 làm cơ sở (bao gồm: DCVFM VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF và KIM Growth VN30 ETF) với tổng quy mô tài sản hơn 9,000 tỷ đồng. Trong đó, DCVFMVN30 ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với 7,425 tỷ đồng.

DSC ước tính danh mục chỉ số như sau:

- Chỉ số VN30 vẫn giữ nguyên cổ phiếu thành phần trong danh mục. Top 5 cổ phiếu có tỷ trọng lớn nhất gồm: FPT, TCB, HPG, ACB, VPB, chiếm khoảng 40% tỷ trọng của danh mục mới.
- Cổ phiếu dự phòng của chỉ số VN30 giữ nguyên EIB, NVL và PNJ và thêm hai cổ phiếu mới: LPB và DGC.
- Đến hết ngày 2/8/2024, các quỹ ETF theo chỉ số VN30 sẽ mua vào đáng kể các cổ phiếu thuộc ngành ngân hàng: SSB (1,5 triệu cp), TCB (1,4 triệu cp), SHB (1,4 triệu cp) và bán mạnh các cổ phiếu: FPT (1,6 triệu cp), MSN (365 nghìn cp), BCM (200 nghìn cp).

DANH MỤC CHỈ SỐ VN30 Q3/2024

STT	Mã	Giá (đồng)	SL CP lưu hành	Tỷ lệ freefloat	Vốn hóa (đồng)	Giới hạn tỷ trọng VH	Tỷ trọng mới
1	FPT	132,700	1,460,448,066	85%	193,801,458,358,200	79%	9.98%
2	TCB	22,650	7,045,021,622	65%	159,569,739,738,300	100%	7.95%
3	HPG	28,450	6,396,250,200	55%	181,973,318,190,000	100%	7.67%
4	ACB	23,950	4,466,657,912	90%	106,976,456,992,400	100%	7.38%
5	VPB	18,800	7,933,923,601	60%	149,157,763,698,800	100%	6.86%
6	MWG	64,300	1,461,915,388	80%	94,001,159,448,400	100%	5.76%
7	MBB	23,050	5,306,324,052	55%	122,310,769,398,600	100%	5.16%
8	STB	29,750	1,885,215,716	100%	56,085,167,551,000	100%	4.30%
9	VNM	66,200	2,089,955,445	40%	138,355,050,459,000	100%	4.24%
10	VCB	87,500	5,589,091,262	11%	489,045,485,425,000	100%	4.12%
11	MSN	74,500	1,438,351,617	45%	107,157,195,466,500	100%	3.70%
12	HDB	24,400	2,912,550,610	75%	71,066,234,884,000	100%	4.09%
13	VHM	38,000	4,354,367,488	30%	165,465,964,544,000	100%	3.81%
14	VIC	41,350	3,823,661,561	30%	158,108,405,547,350	100%	3.64%

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

STT	Mã	Giá (đồng)	SL CP lưu hành	Tỷ lệ freefloat	Vốn hóa (đồng)	Giới hạn tỷ trọng VH	Tỷ trọng mới
15	SHB	11,950	3,662,412,356	85%	43,765,827,654,200	100%	2.85%
16	SSI	34,300	1,509,138,669	70%	51,763,456,346,700	100%	2.78%
17	VJC	104,200	541,611,334	55%	56,435,901,002,800	100%	2.38%
18	SSB	20,800	2,495,700,000	60%	51,910,560,000,000	100%	2.39%
19	CTG	32,100	5,369,991,748	15%	172,376,735,110,800	100%	1.98%
20	VIB	21,300	2,536,807,534	45%	54,034,000,474,200	100%	1.86%
21	TPB	17,650	2,201,635,009	50%	38,858,857,908,850	100%	1.49%
22	VRE	20,350	2,272,318,410	40%	46,241,679,643,500	100%	1.42%
23	BID	46,550	5,700,435,900	4%	265,355,291,145,000	100%	0.81%
24	GAS	78,300	2,296,739,847	5%	179,834,730,020,100	100%	0.69%
25	SAB	55,800	1,282,562,372	11%	71,566,980,357,600	100%	0.60%
26	POW	15,200	2,341,871,600	25%	35,596,448,320,000	100%	0.68%
27	GVR	38,500	4,000,000,000	4%	154,000,000,000,000	100%	0.47%
28	PLX	48,000	1,270,592,235	10%	60,988,427,280,000	100%	0.47%
29	BVH	46,050	742,322,764	10%	34,183,963,282,200	100%	0.26%
30	BCM	67,200	1,035,000,000	4%	69,552,000,000,000	100%	0.21%
Tổng							100.0%

Nguồn: DSC ước tính dựa vào số liệu ngày 15/07/2024

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

ƯỚC TÍNH GIAO DỊCH CÁC QUỸ ETF THEO CHỈ SỐ VN30 Q3/2024

STT	Mã	Tỷ trọng mới	Tổng SLCP mua/bán 4 quỹ	Tổng giá trị giao dịch (đồng)	Số phiên GD tương ứng (SLCP / KLGDTB 3 tháng)
1	HPG	7.7%	1,263,264	35,939,868,697	0.06
2	TCB	8.0%	1,456,267	32,984,452,327	0.22
3	SSB	2.4%	1,573,883	32,736,766,400	0.93
4	MWG	5.8%	507,788	32,650,794,115	0.06
5	HDB	4.1%	1,078,067	26,304,844,926	0.16
6	ACB	7.4%	1,073,964	25,721,440,251	0.14
7	MBB	5.2%	1,068,809	24,636,054,993	0.08
8	VPB	6.9%	1,235,593	23,229,141,676	0.09
9	VCB	4.1%	251,688	22,022,734,578	0.19
10	STB	4.3%	700,895	20,851,623,429	0.05
11	VNM	4.2%	259,622	17,186,981,574	0.09
12	SHB	2.9%	1,416,366	16,925,573,700	0.07
13	SSI	2.8%	455,991	15,640,491,287	0.02
14	VHM	3.8%	405,356	15,403,532,285	0.06
15	VIC	3.6%	368,900	15,254,033,218	0.07
16	CTG	2.0%	436,450	14,010,030,457	0.07
17	POW	0.7%	891,900	13,556,872,507	0.13
18	VJC	2.4%	123,940	12,914,594,891	0.15
19	VIB	1.9%	402,871	8,581,157,259	0.09
20	SAB	0.6%	140,316	7,829,615,019	0.18
21	TPB	1.5%	322,753	5,696,595,700	0.04
22	PLX	0.5%	90,863	4,361,422,307	0.08
23	VRE	1.4%	155,164	3,157,597,502	0.02
24	BID	0.8%	67,009	3,119,284,707	0.05
25	BVH	0.3%	23,186	1,067,734,387	0.05
26	GVR	0.5%	(36,014)	(1,386,543,046)	(0.01)
27	GAS	0.7%	(22,575)	(1,767,609,471)	(0.03)
28	BCM	0.2%	(203,839)	(13,697,950,696)	(0.38)
29	MSN	3.7%	(365,739)	(27,247,528,574)	(0.11)
30	FPT	10.0%	(1,648,870)	(218,805,001,761)	(0.54)
Tổng		100.0%			

Nguồn: DSC ước tính dựa vào số liệu ngày 15/07/2024

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

2. CHỈ SỐ VNDIAMOND

Hiện có tổng cộng 3 quỹ ETF nội sử dụng chỉ số VNDiamond làm tham chiếu (bao gồm: DCVFMVN DIAMOND, MAFM VNDIAMOND và BVFVN DIAMOND) với tổng quy mô tài sản hơn 12,570 tỷ đồng. Trong đó, quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND là quỹ có quy mô lớn nhất với 12,080 tỷ đồng.

DSC ước tính danh mục chỉ số như sau:

- Chỉ số VNDiamond vẫn giữ nguyên 18 cổ phiếu thành phần trong danh mục. Top 3 cổ phiếu có tỷ trọng lớn nhất gồm: FPT, PNJ, GMD chiếm khoảng 45% tỷ trọng danh mục mới. Tỷ trọng ngành ngân hàng được dự báo sẽ tiếp tục lớn nhất, chiếm 40% tỷ trọng rổ chỉ số. Top 3 ngân hàng có tỷ trọng lớn nhất bao gồm: TCB (8,9%), ACB (8,2%) và MBB (5,7%).
- Đến hết ngày 2/8/2024, các quỹ ETF theo chỉ số VNDiamond sẽ mua vào đáng kể các cổ phiếu thuộc ngành ngân hàng: TCB (7,8 triệu cp), ACB (3,5 triệu cp), MSB (2,7 triệu cp), MBB (2,5 triệu cp), HDB (2,3 triệu cp), VPB (2,1 triệu cp) và bán mạnh cổ phiếu: FPT (3 triệu cp).

DANH MỤC CHỈ SỐ VNDIAMOND Q3/2024

STT	Mã	Giá (đồng)	Số lượng CP lưu hành	Tỷ lệ free-float	Vốn hóa (đồng)	Tỷ trọng mới
1	FPT	132,700	1,460,448,066	85%	193,801,458,358,200	15.0%
2	PNJ	97,700	334,559,621	85%	32,686,474,971,700	15.0%
3	GMD	81,300	310,486,957	85%	25,242,589,604,100	12.7%
4	TCB	22,650	7,045,021,622	65%	159,569,739,738,300	8.9%
5	ACB	23,950	4,466,657,912	90%	106,976,456,992,400	8.2%
6	REE	72,000	470,005,485	40%	33,840,394,920,000	8.0%
7	MBB	23,050	5,306,324,052	55%	122,310,769,398,600	5.7%
8	VPB	18,800	7,933,923,601	60%	149,157,763,698,800	3.8%
9	NLG	43,800	384,777,471	70%	16,853,253,229,800	3.5%
10	KDH	37,800	799,311,971	60%	30,213,992,503,800	2.7%
11	HDB	24,400	2,912,550,610	75%	71,066,234,884,000	4.6%
12	MSB	14,600	2,000,000,000	90%	29,200,000,000,000	2.2%
13	VIB	21,300	2,536,807,534	45%	54,034,000,474,200	2.1%
14	TPB	17,650	2,201,635,009	50%	38,858,857,908,850	1.7%
15	CTG	32,100	5,369,991,748	15%	172,376,735,110,800	1.7%
16	VRE	20,350	2,272,318,410	40%	46,241,679,643,500	2.7%
17	OCB	14,400	2,054,824,294	55%	29,589,469,833,600	1.4%
18	BMP	96,200	81,860,938	45%	7,875,022,235,600	0.3%
Tổng						100.0%

Nguồn: DSC ước tính dựa vào số liệu ngày 15/07/2024

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

ƯỚC TÍNH GIAO DỊCH CÁC QUỸ ETF THEO CHỈ SỐ VNDIAMOND Q3/2024

STT	Mã	Tỷ trọng mới	Tổng SLCP mua/bán 3 quý	Tổng GTGD tương ứng (đồng)	Số phiên GD tương ứng (SLCP / KLGDTB 3 tháng)
1	PNJ	15.0%	1,840,378	179,804,972,000	2.0
2	TCB	8.9%	7,800,439	176,679,934,000	1.2
3	ACB	8.2%	3,509,218	84,045,782,000	0.5
4	MBB	5.7%	2,509,083	57,834,364,000	0.2
5	HDB	4.6%	2,352,631	57,404,200,000	0.4
6	MSB	2.2%	2,733,415	39,907,860,000	0.4
7	VPB	3.8%	2,115,692	39,775,016,000	0.1
8	REE	8.0%	443,346	31,920,922,000	0.6
9	NLG	3.5%	647,090	28,342,558,000	0.3
10	VIB	2.1%	1,154,662	24,594,308,000	0.3
11	CTG	1.7%	763,910	24,521,512,000	0.1
12	TPB	1.7%	976,589	17,236,788,000	0.1
13	OCB	1.4%	1,069,886	15,406,364,000	0.5
14	KDH	2.7%	128,695	4,864,664,000	0.1
15	VRE	2.7%	186,291	3,791,022,000	0.0
16	BMP	0.3%	(46,977)	(4,519,232,000)	0.2
17	GMD	12.7%	(821,032)	(66,749,898,000)	0.6
18	FPT	15.0%	(3,067,333)	(407,035,052,000)	1.0
Tổng		100.0%			

Nguồn: DSC ước tính dựa vào số liệu ngày 15/07/2024

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

PHỤ LỤC

TIÊU CHÍ ĐÁNH GIÁ CHỈ SỐ VN DIAMOND INDEX

Tiêu chí	Cổ phiếu thuộc bộ chỉ số	Cổ phiếu không thuộc bộ chỉ số
Niêm yết		Không trong diện bị cảnh báo Niêm yết trên HOSE >3 tháng
Vốn hóa	GTVH_freefloat >= 2,000 tỷ đồng cho cp thuộc VNAllshare GTVH_freefloat >= 5,000 tỷ đồng cho cp ngoài VNAllshare	
Thanh khoản	GTGDKL >= 8 tỷ đồng/ngày KLGDKL >= 100,000 cp/ngày	GTGDKL >= 10 tỷ đồng/ngày KLGDKL >= 200,000 cp/ngày
Tỷ lệ FOL	>= 80%	>= 95%
PE	0 <= PE <= 3 lần PE bình quân	0 <= PE <= 2 lần PE bình quân
Vốn hóa NĐTNN có thể mua		Tối đa 500 tỷ đồng
Kỳ review		Theo quý
Kỳ cơ cấu		Nửa năm (tháng 4, tháng 10)

Nguồn: HSX, DSC tổng hợp

TIÊU CHÍ ĐÁNH GIÁ CHỈ SỐ VN30 INDEX

Tiêu chí	Cổ phiếu thuộc bộ chỉ số	Cổ phiếu không thuộc bộ chỉ số
Niêm yết		Không trong diện bị cảnh báo Niêm yết trên HOSE > 6 tháng hoặc >3 tháng với top 5 cổ phiếu vốn hóa lớn
Tỷ lệ free-float	>= 10%	>= 10%
	Vốn hóa free-float >= 2.000 tỷ đồng	Vốn hóa free-float >= 2.500 tỷ đồng
Tỷ suất quay vòng	>= 0,04%	>= 0,05%
KLGD khớp lệnh		>= 100.000 cổ phiếu
Giá trị giao dịch khớp lệnh	>= 9 tỷ đồng	>= 10 tỷ đồng
Vốn hóa		Theo thứ tự giảm dần
Kỳ review		Theo quý
Kỳ cơ cấu		Nửa năm (tháng 2, tháng 7)

Nguồn: HSX, DSC tổng hợp

Kết quả thay đổi danh mục chỉ số VN30, VNDiamond kỳ Q3/2024

Xác nhận của chuyên viên phân tích

Chúng tôi xác nhận rằng những quan điểm được trình bày trong báo cáo này phản ánh đúng quan điểm cá nhân của chúng tôi. Chúng tôi cũng xác nhận rằng không có phần thù lao nào của chúng tôi đã, đang, hoặc sẽ trực tiếp hay gián tiếp có liên quan đến các khuyến nghị hay quan điểm thể hiện trong báo cáo này. Các chuyên viên phân tích nghiên cứu phụ trách các báo cáo này nhận được thù lao dựa trên nhiều yếu tố khác nhau, bao gồm chất lượng, tính chính xác của nghiên cứu, và doanh thu của công ty, trong đó bao gồm doanh thu từ các đơn vị kinh doanh khác như bộ phận Môi giới tổ chức, hoặc Tư vấn doanh nghiệp.

Báo cáo miễn trừ trách nhiệm

Báo cáo này được viết và phát hành bởi Công ty Cổ phần Chứng khoán DSC. Báo cáo này được viết dựa trên nguồn thông tin đáng tin cậy vào thời điểm công bố. Công ty Cổ phần Chứng khoán DSC không chịu trách nhiệm về độ chính xác của những thông tin này. Quan điểm, dự báo và những ước lượng trong báo cáo này chỉ thể hiện ý kiến của tác giả tại thời điểm phát hành. Những quan điểm này không thể hiện quan điểm chung của Công ty Cổ phần Chứng khoán DSC và có thể thay đổi mà không cần thông báo trước. Báo cáo này chỉ nhằm mục đích cung cấp thông tin cho các tổ chức đầu tư cũng như các nhà đầu tư cá nhân của Công ty cổ phần chứng khoán DSC và không mang tính chất mời chào mua hay bán bất kỳ chứng khoán nào được thảo luận trong báo cáo này. Quyết định của nhà đầu tư nên dựa vào những sự tư vấn độc lập và thích hợp với tình hình tài chính cũng như mục tiêu đầu tư riêng biệt. Báo cáo này không được phép sao chép, tái tạo, phát hành và phân phối với bất kỳ mục đích nào nếu không được sự chấp thuận bằng văn bản của Công ty Cổ phần Chứng khoán DSC. Xin vui lòng ghi rõ nguồn trích dẫn nếu sử dụng các thông tin trong báo cáo này.

Liên hệ - Trung tâm phân tích DSC

Trương Thái Đạt,

GD. Trung tâm Phân tích
dat.tt@dsc.com.vn

Tiền Quốc Việt,

Trưởng phòng Phân tích
viet.tq@dsc.com.vn

Trần Thanh Vân

Chuyên viên Phân tích
van.tt@dsc.com.vn

HỘI SỞ CHÍNH

📍 Tầng 2, Thành Công Building, 80 Dịch Vọng Hậu, Cầu Giấy, Hà Nội

☎ (024) 3880 3456

✉ info@dsc.com.vn