

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

LỊCH CƠ CẤU DANH MỤC CÁC QUỸ ETF

Tháng 9	Tháng 10	Tháng 11
Quỹ DCVFM VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF, KIM Growth VN30 ETF (VN30 Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 9.067,6 tỷ VND 	<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 21/10 Ngày giao dịch: 22/10 - 01/11 <p><i>(Dự báo danh mục: 30/09/2024)</i></p>	
Quỹ DCVFMVN DIAMOND ETF, MAFM VNDIAMOND ETF, BVFVN DIAMOND ETF (VNDiamond Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 12.604,4 tỷ VND 	<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 21/10 Ngày giao dịch: 22/10 - 01/11 <p><i>(Dự báo danh mục: 30/09/2024)</i></p>	
Quỹ SSIAM VNFIN LEAD ETF, VFM VN MIDCAP ETF, Vina Capital VN100 ETF,... (6 quỹ)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 1.892,6 tỷ VND 	<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 21/10 Ngày giao dịch: 22/10 - 01/11 	
Quỹ Fubon FTSE Vietnam ETF (FTSE Vietnam Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 15.908,4 tỷ VND Ngày công bố: tháng 09 Ngày giao dịch cuối: 20/09 <p><i>(Kết quả danh mục: 18/09/2024)</i></p>		
Quỹ FTSE Vietnam ETF (FTSE Vietnam Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 7.226,3 tỷ VND Ngày công bố: 06/09 Ngày giao dịch: 07/09 - 20/09 <p><i>(Kết quả danh mục: 18/09/2024)</i></p>		
Quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF (MarketVector Vietnam Local Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 12.200,1 tỷ VND Ngày công bố: 13/09 Ngày giao dịch: 14/09 - 20/09 <p>Dự báo: Top mua</p> <p>HPG, VND, DGC</p> <p>Dự báo: Top bán</p> <p>VHM, VIX, VNM, EVF</p>		

Nguồn: DSC tổng hợp dựa vào dữ liệu ngày 16/09/2024

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

KẾT QUẢ CHI TIẾT DANH MỤC MARKETVECTOR VN LOCAL INDEX

- MarketVector Vietnam Local - chỉ số cơ sở của quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF - đã chính thức công bố danh mục vào ngày 13/09/2024, hoàn thành cơ cấu vào ngày 20/09/2024 và có hiệu lực từ ngày 23/9/2024.
- Quỹ Vaneck Vector Vietnam ETF (VNM ETF) **loại cổ phiếu EVF và không có cổ phiếu nào thêm vào.** Điều này giống với dự báo của DSC.

TỔNG QUAN

Hiện chỉ số MarketVector Vietnam Local có quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF tham chiếu. Đây là quỹ ngoại lớn thứ hai tại thị trường Việt nam với tổng tài sản quản lý hơn 12.200 tỷ đồng và 39,75 triệu cổ phiếu đang lưu hành. Kể từ đầu năm, tổng tài sản quỹ đã giảm hơn 4% và bị rút ròng hơn 400 tỷ đồng.

KẾT QUẢ

Danh mục chỉ số bao gồm 44 cổ phiếu trong đó không thêm cổ phiếu mới và loại ra EVF

Trong kì review, EVF bị loại khỏi danh mục MarketVector Vietnam Index do không đủ điều kiện vốn hóa free-float. HNG cũng không xuất hiện trong chỉ số do bị hủy niêm yết khỏi sàn HSX vào ngày 06/09. Danh mục chỉ số mới vẫn tập trung tỷ trọng vào ngành bất động sản (~31%) và thực phẩm đồ uống (~20%). Năm cổ phiếu có tỷ trọng cao nhất là VIC (8%), VHM (8%), VNM (7%), HPG (6,5%), VCB (6%), chiếm tổng cộng 35,5% tổng tỷ trọng rổ.

Hoạt động đáng chú ý của quỹ ETF theo chỉ số MVVNL

Với thay đổi trên, DSC ước tính quỹ sẽ mua thêm lượng đáng kể cổ phiếu SHB (3,2 triệu cp), VND (3,1 triệu cp), HPG (3 triệu cp), NVL (2,8 triệu cp) và bán mạnh VIX (15,8 triệu cp), EVF (8.4 triệu cp), VHM (4,4 triệu cp) để tái cơ cấu danh mục.

(Số liệu được dự báo dựa vào các tiêu chí của chỉ số MarketVector Vietnam và dữ liệu chốt ngày 13/09/2024)

DANH MỤC CỔ PHIẾU THÀNH PHẦN CHỈ SỐ MVVNL Q3/2024

STT	Mã	Giá	Số lượng CP lưu hành	Tỷ lệ free-float	Vốn hóa (đồng)	Tỷ trọng mới
1	VIC	42.900	3.823.661.561	30%	164.035.080.966.900	8,00%
2	VHM	43.000	4.354.367.488	30%	187.237.801.984.000	8,00%
3	VNM	72.900	2.089.955.445	40%	152.357.751.940.500	7,00%
4	HPG	25.000	6.396.250.200	55%	159.906.255.000.000	6,50%
5	VCB	89.900	5.589.091.262	11%	502.459.304.453.800	6,00%
6	SSI	32.300	1.509.138.669	70%	48.745.179.008.700	5,50%
7	MSN	74.200	1.438.351.617	45%	106.725.689.981.400	5,00%
8	VND	14.300	1.522.299.908	75%	21.768.888.684.400	3,31%
9	DGC	113.500	379.778.413	60%	43.104.849.875.500	2,98%
10	VCI	33.400	574.470.000	70%	19.187.298.000.000	2,22%

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

STT	Mã	Giá	Số lượng CP lưu hành	Tỷ lệ free-float	Vốn hóa (đồng)	Tỷ trọng mới
11	VRE	19.300	2.272.318.410	40%	43.855.745.313.000	2,22%
12	NVL	11.550	1.950.104.538	65%	22.523.707.413.900	2,34%
13	SHB	10.300	3.662.412.356	85%	37.722.847.266.800	2,35%
14	VJC	104.800	541.611.334	55%	56.760.867.803.200	1,70%
15	EIB	18.350	1.740.866.148	90%	31.944.893.815.800	1,99%
16	VHC	69.900	224.453.159	45%	15.689.275.814.100	1,84%
17	PDR	21.500	873.140.083	45%	18.772.511.784.500	1,51%
18	GEX	20.600	859.429.793	75%	17.704.253.735.800	1,66%
19	HUT	16.600	892.511.965	40%	14.815.698.619.000	1,64%
20	VIX	11.300	1.439.306.157	95%	16.264.159.574.100	1,62%
21	SAB	56.100	1.282.562.372	11%	71.951.749.069.200	1,66%
22	FTS	44.000	305.919.366	55%	13.460.452.104.000	1,52%
23	VPI	56.900	290.399.385	45%	16.523.725.006.500	1,49%
24	POW	12.800	2.341.871.600	25%	29.975.956.480.000	1,38%
25	DIG	22.000	609.851.995	80%	13.416.743.890.000	1,36%
26	KBC	25.100	767.604.759	75%	19.266.879.450.900	1,24%
27	TCH	17.800	668.215.843	55%	11.894.242.005.400	1,26%
28	HAG	10.450	1.057.399.283	60%	11.049.822.507.350	1,17%
29	PVS	40.400	477.966.290	50%	19.309.838.116.000	1,25%
30	PVD	26.000	555.880.006	50%	14.452.880.156.000	1,07%
31	SHS	14.800	813.156.748	90%	12.034.719.870.400	1,08%
32	IDC	58.400	329.999.929	60%	19.271.995.853.600	1,15%
33	CTR	125.000	114.385.879	35%	14.298.234.875.000	1,12%
34	DCM	38.150	529.400.000	25%	20.196.610.000.000	1,12%
35	DPM	35.500	391.334.260	45%	13.892.366.230.000	1,09%
36	KDC	54.800	289.806.316	60%	15.881.386.116.800	1,22%
37	HSG	19.950	615.982.309	85%	12.288.847.064.550	0,85%
38	VCG	18.100	598.593.458	55%	10.834.541.589.800	0,85%
39	BVH	42.750	742.322.764	10%	31.734.298.161.000	0,95%
40	KDH	37.250	909.403.715	60%	33.875.288.383.750	0,69%
41	SBT	13.600	740.500.993	50%	10.070.813.504.800	0,93%
42	DXG	15.300	720.703.435	80%	11.026.762.555.500	0,76%
43	CEO	15.300	540.406.432	70%	8.268.218.409.600	0,80%
44	HDG	27.600	336.331.529	60%	9.282.750.200.400	0,62%

Tổng**100,00%**

Nguồn: DSC ước tính

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

ƯỚC TÍNH SỐ LƯỢNG MUA/BÁN CỔ PHIẾU CỦA QUỸ VANECK VECTORS VIETNAM ETF Q3/2024

STT	Mã	Tỷ trọng mới	Tổng SLCP mua/bán	Tổng giá trị giao dịch (đồng)	Số phiên GD tương ứng (SLCP / KLGDTB 3 tháng)
1	HPG	6,5%	3.074.422	76.860.546.920	0,28
2	VND	3,3%	3.156.666	45.140.321.207	1,12
3	DGC	3,0%	365.465	41.480.295.163	0,07
4	SSI	5,5%	1.170.906	37.820.269.119	0,15
5	NVL	2,3%	2.851.968	32.940.234.394	2,60
6	SHB	2,4%	3.198.081	32.940.234.394	0,90
7	VRE	2,2%	1.580.322	30.500.217.032	0,65
8	MSN	5,0%	378.170	28.060.199.669	0,10
9	EIB	2,0%	1.529.166	28.060.199.669	0,18
10	VHC	1,8%	349.073	24.400.173.625	0,03
11	VJC	1,7%	221.185	23.180.164.944	0,02
12	GEX	1,7%	1.125.251	23.180.164.944	0,11
13	HUT	1,6%	1.396.395	23.180.164.944	0,40
14	SAB	1,7%	413.194	23.180.164.944	0,08
15	PDR	1,5%	964.658	20.740.147.581	0,34
16	FTS	1,5%	471.367	20.740.147.581	0,08
17	DIG	1,4%	831.824	18.300.130.219	1,88
18	POW	1,4%	1.429.698	18.300.130.219	0,13
19	KBC	1,2%	680.483	17.080.121.538	0,19
20	TCH	1,3%	959.557	17.080.121.538	0,05
21	PVS	1,3%	422.775	17.080.121.538	0,06
22	HAG	1,2%	1.517.714	15.860.112.856	0,16
23	CTR	1,1%	126.881	15.860.112.856	0,03
24	DCM	1,1%	415.730	15.860.112.856	0,13
25	IDC	1,2%	271.577	15.860.112.856	0,34
26	SHS	1,1%	989.196	14.640.104.175	0,10
27	PVD	1,1%	563.081	14.640.104.175	0,16
28	DPM	1,1%	412.397	14.640.104.175	0,31
29	BVH	1,0%	313.920	13.420.095.494	0,15
30	SBT	0,9%	986.772	13.420.095.494	0,05

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

STT	Mã	Tỷ trọng mới	Tổng SLCP mua/bán	Tổng giá trị giao dịch (đồng)	Số phiên GD tương ứng (SLCP / KLGDTB 3 tháng)
31	HSG	0,9%	611.533	12.200.086.813	0,76
32	DXG	0,8%	637.913	9.760.069.450	0,36
33	KDH	0,7%	262.015	9.760.069.450	0,32
34	CEO	0,8%	478.435	7.320.052.088	0,06
35	KDC	1,2%	111.315	6.100.043.406	0,02
36	VCG	0,9%	67.404	1.220.008.681	0,06
37	HDG	0,6%	44.203	1.220.008.681	0,02
38	VPI	1,5%	(214.413)	(12.200.086.813)	(0,02)
39	VCI	2,2%	(1.241.925)	(41.480.295.163)	(0,41)
40	VIC	8,0%	(1.336.606)	(57.340.408.019)	(0,56)
41	VCB	6,0%	(678.537)	(61.000.434.063)	(0,05)
42	VNM	7,0%	(1.907.833)	(139.080.989.664)	(2,36)
43	VIX	1,6%	(15.870.909)	(179.341.276.146)	(1,30)
44	VHM	8,0%	(4.397.706)	(189.101.345.596)	(0,22)
	EVF	-	(8.413.853)	(97.600.694.501)	(1,29)
	HNG	-	-	-	-
Tổng		100,0%			

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local Q3/2024

PHỤ LỤC

TIÊU CHÍ ĐÁNH GIÁ CHỈ SỐ MARKETVECTOR VIETNAM LOCAL INDEX

Tiêu chí	Cổ phiếu thuộc bộ chỉ số	Cổ phiếu không thuộc bộ chỉ số
Vốn hóa	> 75 triệu USD	> 150 triệu USD
Giá trị giao dịch	GTGD bình quân 3 tháng \geq 0,6 triệu USD tại kỳ review và hai kỳ trước	GTGD bình quân 3 tháng \geq 1 triệu USD tại kỳ review và hai kỳ trước
Khối lượng giao dịch	KLGD bình quân \geq 200.000 cp trong 6 tháng tại kỳ review và hai kỳ trước	KLGD bình quân \geq 250.000 cp trong 6 tháng tại kỳ review và hai kỳ trước
Tỷ lệ free-float/ Room ngoại còn lại	\geq 5%	\geq 10%
Kỳ review	Theo quý	
Kỳ cơ cấu	Nửa năm (tháng 3, tháng 9)	

Kết quả review chỉ số MarketVector VN Local 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

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