

Dự báo review danh mục chỉ số VNDIAMOND Q3/2024

LỊCH CƠ CẤU DANH MỤC CÁC QUỸ ETF Q3/2024

Tháng 7	Tháng 8	Tháng 9
Quỹ DCVFM VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF, KIM Growth VN30 ETF (VN30 Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 9,006.75 tỷ VND Ngày công bố: 15/07 Ngày giao dịch: 16/07 - 02/08 <p><i>Dự báo tại đây</i></p>		
Quỹ DCVFMVN DIAMOND ETF, MAFM VNDIAMOND ETF, BVFVN DIAMOND ETF (VNDiamond Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 13,227.08 tỷ VND Ngày công bố: 15/07 Ngày giao dịch: 16/07 - 05/08 <p><i>Dự báo:</i> Top mua TCB, PNJ, GMD, ACB, MBB</p> <p><i>Dự báo:</i> Top bán FPT, HDB, VRE, BMP</p>		
Quỹ SSIAM VNFIN LEAD ETF, VFM VN MIDCAP 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: 18,271.19 tỷ VND 		<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 06/09 Ngày giao dịch: 07/09 - 20/09 <p><i>(Dự báo danh mục: 01/09/2024)</i></p>
Quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF (MarketVector Vietnam Local Index)		
<ul style="list-style-type: none"> NAV: 12,542.87 tỷ VND 		<ul style="list-style-type: none"> Ngày công bố: 13/09 Ngày giao dịch: 14/09 - 20/09 <p><i>(Dự báo danh mục: 01/09/2024)</i></p>

Nguồn: DSC tổng hợp dựa vào dữ liệu ngày 28/06/2024

Dự báo review danh mục chỉ số VNDIAMOND Q3/2024

DỰ BÁO CHI TIẾT DANH MỤC VNDIAMOND

- HOSE sẽ công bố kết quả rà soát danh mục chỉ số VNDiamond vào ngày 15/7/2024, hoàn thành cơ cấu vào ngày 2/8/2024 và thay đổi sẽ có hiệu lực từ ngày 5/8/2024.
- DSC dự báo chỉ số **không có thay đổi** về thành phần trong kỳ này với 18 cổ phiếu trong danh mục.

TỔNG QUAN

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 13,227 tỷ đồng. Trong đó, quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND là quỹ có quy mô lớn nhất với 12,738 tỷ đồng.

DỰ BÁO

Trong kì review, danh mục chỉ số VN Diamond vẫn giữ nguyên 18 cổ phiếu. 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 (9.7%), ACB (8.7%) và MBB (5.9%).

DỰ BÁO CÁC CỔ PHIẾU THÀNH PHẦN CHỈ SỐ VNDIAMOND Q3/2024

STT	Mã	Giá	Số lượng CP lưu hành	Tỷ lệ free-float	Vốn hóa	Tỷ trọng mới
1	PNJ	95,500	334,559,621	80%	31,950,443,805,500	15.0%
2	FPT	130,500	1,460,448,066	85%	190,588,472,613,000	15.0%
3	GMD	83,000	310,486,957	90%	25,770,417,431,000	14.6%
4	TCB	23,350	7,045,021,622	65%	164,501,254,873,700	9.7%
5	ACB	23,800	4,466,657,912	90%	106,306,458,305,600	8.7%
6	REE	62,600	470,005,485	40%	29,422,343,361,000	7.4%
7	MBB	22,200	5,306,324,052	55%	117,800,393,954,400	5.9%
8	VPB	18,650	7,933,923,601	60%	147,967,675,158,650	4.0%
9	NLG	41,400	384,777,471	70%	15,929,787,299,400	3.5%
10	KDH	36,900	799,311,971	60%	29,494,611,729,900	2.8%
11	HDB	23,000	2,912,550,610	75%	66,988,664,030,000	2.3%
12	MSB	14,300	2,000,000,000	85%	28,600,000,000,000	2.2%
13	VIB	21,000	2,536,807,534	45%	53,272,958,214,000	2.2%
14	TPB	17,200	2,201,635,009	50%	37,868,122,154,800	1.7%
15	CTG	31,000	5,369,991,748	15%	166,469,744,188,000	1.7%
16	VRE	20,450	2,272,318,410	40%	46,468,911,484,500	1.5%
17	OCB	14,100	2,054,824,294	55%	28,973,022,545,400	1.5%
18	BMP	100,000	81,860,938	45%	8,186,093,800,000	0.3%
Tổng						100.0%

Nguồn: DSC dự báo

Dự báo review danh mục chỉ số VNDIAMOND Q3/2024

Hoạt động đáng chú ý của các quỹ ETF theo chỉ số VNDIAMOND

DSC ước tính 3 quỹ ETF có thể sẽ mua vào đáng kể các cổ phiếu: TCB (11 triệu cp), ACB (5.9 triệu cp), MBB (3.8 triệu cp) và bán ra cổ phiếu: HDB (9.5 triệu cp), VRE (8 triệu cp), FPT (3.5 triệu cp) trong đợt review.

(Số liệu được dự báo dựa vào các tiêu chí của chỉ số VN Diamond và dữ liệu chốt ngày 28/6/2024. Tỷ trọng và khối lượng mua bán dự kiến của từng cổ phiếu có thể thay đổi từ nay đến khi kết thúc thời gian tái cơ cấu do biến động giá cổ phiếu, vốn hóa và số lượng chứng chỉ quỹ)

ƯỚC TÍNH SL MUA/BÁN CỔ PHIẾU CỦA CÁC QUỸ ETF THEO CHỈ SỐ VNDIAMOND Q3/2024

STT	Mã	Tỷ trọng mới	+/- CP từ FUEVFNVD	+/- CP từ FUEMA VND	+/- CP từ FUEBFVND	+/- CP từ 3 quỹ	Số phiên GD tương ứng (KLGD TB 3 tháng)
1	TCB	9.7%	10,678,611	347,376	48,379	11,074,366	1.8
2	ACB	8.7%	5,683,552	188,516	26,322	5,898,390	0.7
3	MBB	5.9%	3,708,702	119,917	19,077	3,847,697	0.3
4	VPB	4.0%	3,255,714	105,152	12,521	3,373,388	0.2
5	MSB	2.2%	2,281,533	97,059	11,412	2,390,004	0.4
6	PNJ	15.0%	1,987,395	78,154	13,257	2,078,805	2.1
7	GMD	14.6%	1,892,319	56,759	11,232	1,960,310	1.6
8	VIB	2.2%	1,791,775	38,760	8,230	1,838,765	0.4
9	TPB	1.7%	1,674,108	57,701	5,995	1,737,804	0.2
10	OCB	1.5%	1,559,906	47,538	7,193	1,614,636	0.7
11	CTG	1.7%	1,098,157	15,190	5,605	1,118,952	0.2
12	NLG	3.5%	840,554	10,943	5,478	856,975	0.3
13	REE	7.4%	620,093	27,685	7,152	654,930	0.9
14	KDH	2.8%	448,208	(2,399)	4,473	450,282	0.2
15	BMP	0.3%	(39,075)	(22,421)	(2,305)	(63,801)	0.3
16	FPT	15.0%	(3,299,191)	(151,393)	(12,692)	(3,463,276)	1.3
17	VRE	1.5%	(7,724,501)	(266,240)	(29,366)	(8,020,107)	1.2
18	HDB	2.3%	(9,193,294)	(326,409)	(33,504)	(9,553,207)	1.5
Tổng		100.0%					

Nguồn: DSC dự báo

Dự báo review danh mục chỉ số VNDIAMOND 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

Dự báo review danh mục chỉ số VNDIAMOND 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