

### 1. Chỉ số VN Diamond và dự báo cơ cấu quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND (FUEVFNVD)

Ngày công bố: 17/10/2022  
 Ngày cơ cấu danh mục: 04/11/2022

Trong lần cập nhật thông tin định kỳ quý 3 tới đây, HoSE sẽ công bố thay đổi danh mục mới của bộ chỉ số VN Diamond. Dựa theo dữ liệu đến ngày 23/09/2022, chúng tôi dự báo KDH và TCM sẽ là những cổ phiếu bị loại ra. Trong đó, TCM vi phạm tiêu chí vốn hóa điều chỉnh free-float còn KDH vi phạm tiêu chí FOL. Để đảm bảo quy định duy trì ít nhất 8 cổ phiếu không thuộc nhóm ngành bị giới hạn vốn hóa, chúng tôi cho rằng HCM và SAB sẽ là những cổ phiếu được lựa chọn để thay thế dựa trên giá trị FOL từ cao xuống thấp của danh sách sau sàng lọc. Với dự báo trên, chúng tôi đưa ra bảng cơ cấu của quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND – quỹ mô phỏng chỉ số VN Diamond như sau.

STT	MCK	Hiện tại		Mới		SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Tỷ trọng (%)	SLCP	Tỷ trọng (%)	SLCP		
1	FPT	15.1%	30,106,934	15.0%	30,003,660	(103,274)	
2	MWG	17.0%	40,310,140	15.0%	35,623,943	(4,686,197)	
3	PNJ	14.8%	21,388,128	15.0%	21,705,897	317,769	
4	TCB	8.5%	41,168,000	9.0%	43,373,713	2,205,713	
5	REE	9.8%	19,302,484	8.5%	16,854,456	(2,448,028)	
6	MBB	5.9%	46,200,520	6.8%	53,675,557	7,475,037	
7	ACB	7.3%	53,094,116	6.4%	46,344,786	(6,749,330)	
8	VPB	7.5%	43,123,211	5.9%	33,716,362	(9,406,849)	
9	GMD	2.3%	7,729,250	4.0%	13,498,393	5,769,143	
10	MSB	2.5%	23,773,006	3.0%	27,946,912	4,173,906	
11	TPB	2.2%	14,658,825	2.6%	17,023,272	2,364,447	
12	VIB	2.1%	15,692,804	2.5%	18,713,751	3,020,947	
13	OCB	0.7%	6,963,900	1.6%	16,217,347	9,253,447	
14	CTG	0.5%	3,354,915	1.2%	7,758,114	4,403,199	
15	<b>SAB</b>			<b>1.1%</b>	<b>929,251</b>	<b>929,251</b>	<b>Thêm</b>
16	EIB	0.9%	4,179,300	1.0%	4,961,806	782,506	
17	<b>HCM</b>			<b>1.0%</b>	<b>6,022,950</b>	<b>6,022,950</b>	<b>Thêm</b>
18	DHC	0.2%	674,200	0.4%	1,198,667	524,467	
	<b>KDH</b>	<b>1.7%</b>	<b>9,125,202</b>			<b>(9,125,202)</b>	<b>Loại</b>
	<b>TCM</b>	<b>0.1%</b>	<b>489,950</b>			<b>(489,950)</b>	<b>Loại</b>

Nguồn: Bloomberg, PHS

Trong khi đó, các bộ chỉ số VN30 và VNFIN Lead chỉ cập nhật thông tin khối lượng lưu hành, free-float trong lần cập nhật thông tin quý 3 này. Do đó, chúng tôi sẽ đưa ra dự báo cơ cấu của các quỹ ETF tương ứng mô phỏng các bộ chỉ số trên trong bài báo cáo ETF tiếp theo, sau khi có kết quả công bố thông tin từ HoSE.