

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

Vào ngày 30/09 vừa qua, HoSE đã ban hành bộ quy tắc mới phiên bản 2.1 về xây dựng và quản lý bộ chỉ số VN Diamond, thay thế cho phiên bản 2.0 được ban hành vào ngày 15/06/2021. Trong đó, thay đổi đáng chú ý nhất là điều chỉnh cách tính hệ số tỷ lệ nước ngoài tối đa đối với các cổ phiếu không thuộc ngành ngân hàng. Từ đó làm thay đổi giá trị hệ số FOL của các cổ phiếu này(*). Bộ quy tắc mới chính thức được áp dụng cho lần xem xét định kỳ vào tháng 10/2022. Theo công bố từ HoSE, chỉ số VN Diamond sẽ loại ra TCM, đồng thời thêm vào NLG. Với kết quả trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND – quỹ mô phỏng chỉ số VN Diamond như sau.

STT	MCK	ETF VFMVN DIAMOND			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Tỷ trọng (%)				
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	MWG	16.70%	15.00%	-1.71%	(3,996,921)	
2	FPT	15.50%	15.00%	-0.50%	(954,497)	
3	PNJ	15.69%	14.52%	-1.17%	(1,563,988)	
4	TCB	7.36%	8.80%	1.45%	7,903,840	
5	REE	10.38%	8.17%	-2.22%	(4,022,541)	
6	ACB	7.70%	6.74%	-0.96%	(6,445,159)	
7	MBB	5.72%	6.66%	0.95%	7,453,324	
8	VPB	7.26%	5.29%	-1.97%	(17,137,154)	
9	GMD	2.56%	4.27%	1.71%	5,032,823	
10	MSB	2.52%	3.15%	0.63%	7,513,520	
11	TPB	2.10%	2.69%	0.59%	4,026,364	
12	VIB	2.20%	2.64%	0.43%	3,011,789	
13	KDH	1.65%	2.04%	0.39%	2,070,960	
14	OCB	0.64%	1.50%	0.86%	9,080,202	
15	EIB	1.07%	1.28%	0.21%	785,835	
16	CTG	0.53%	1.23%	0.70%	4,316,257	
17	NLG		0.57%	0.57%	3,000,603	Thêm
18	DHC	0.25%	0.44%	0.19%	488,254	
	TCM	0.15%		-0.15%	(474,450)	Loại

Nguồn: PHS

(*): Thay đổi này chưa được áp dụng trong lần dự báo trước của chúng tôi

2. CHỈ SỐ VN30 VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN30 (E1VFN30)

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

Trong lần xem xét định kỳ tháng 10, bộ chỉ số VN30 chỉ cập nhật thông tin khối lượng lưu hành, free-float và giới hạn tỷ trọng vốn hóa. Với kết quả trên, chúng tôi đưa ra bảng cơ cấu của quỹ ETF DCVFMVN30 – mô phỏng bộ chỉ số VN30 như sau.