

1. CHỈ SỐ VN30 VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DC VFMVN30 ETF (E1VFN30)

Ngày chốt dữ liệu: 31/12/2022
 Ngày công bố: 16/01/2023
 Ngày cơ cấu danh mục: 03/02/2022

Dựa vào số liệu tính toán đến ngày 20/12/2022, chúng tôi dự báo cổ phiếu BCM sẽ được thêm vào rổ chỉ số VN30 trong lần cập nhật định kỳ tháng 1/2023 do đã đáp ứng được các tiêu chí chọn lọc, đồng thời vốn hóa lọt top 20 cổ phiếu lớn nhất của tập hợp được chọn. Do đó, để duy trì danh mục 30 cổ phiếu trong rổ, KDH – cổ phiếu vốn hóa thấp nhất trong rổ sẽ bị loại ra để thay thế. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ DC VFMVN30 ETF – quỹ mô phỏng chỉ số VN30 có quy mô lớn nhất như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VPB	8.13%	7.74%	-0.39%	(1,312,010)	
2	FPT	7.15%	7.32%	0.17%	133,053	
3	VNM	6.62%	6.74%	0.13%	94,431	
4	ACB	6.51%	6.64%	0.13%	331,533	
5	TCB	6.37%	6.49%	0.12%	261,898	
6	HPG	6.12%	6.23%	0.10%	318,031	
7	MSN	6.09%	6.17%	0.08%	50,210	
8	VIC	5.28%	5.46%	0.18%	189,521	
9	VHM	6.27%	5.38%	-0.89%	(1,074,519)	
10	MWG	4.80%	5.23%	0.43%	535,583	
11	MBB	4.41%	4.50%	0.09%	302,617	
12	STB	4.28%	4.34%	0.06%	156,884	
13	VCB	4.11%	4.22%	0.10%	73,988	
14	VJC	3.02%	3.09%	0.07%	35,855	
15	HDB	2.92%	3.00%	0.09%	304,707	
16	VRE	2.31%	2.40%	0.09%	200,555	
17	VIB	2.30%	2.34%	0.04%	110,338	
18	SSI	2.09%	2.12%	0.02%	65,969	
19	CTG	2.02%	2.07%	0.05%	98,030	
20	TPB	1.75%	1.96%	0.21%	550,496	
21	NVL	1.26%	1.30%	0.05%	170,251	
22	SAB	1.20%	1.25%	0.05%	15,660	
23	GAS	1.02%	1.03%	0.01%	5,851	
24	BID	0.76%	0.80%	0.04%	56,329	
25	POW	0.63%	0.51%	-0.12%	(639,539)	
26	PLX	0.38%	0.38%	-0.002%	(4,361)	
27	BVH	0.36%	0.37%	0.0003%	304	
28	PDR	0.35%	0.36%	0.002%	8,073	
29	BCM		0.34%	0.34%	247,235	Thêm
30	GVR	0.23%	0.23%	0.003%	13,096	
	KDH	1.25%		-1.25%	(2,815,464)	Loại

Nguồn: PHS