

1. CHỈ SỐ VN DIAMOND VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN DIAMOND ETF

Ngày chốt dữ liệu: 31/03/2023

Ngày công bố:..... 17/04/2023

Ngày cơ cấu danh mục: 28/04/2023

Dựa trên số liệu ước tính đến ngày 06/04/2023, chúng tôi dự báo chỉ số VN Diamond sẽ loại cổ phiếu EIB trong kỳ thay đổi danh mục tháng 4 này. Theo ước tính, có đến 3 cổ phiếu không thỏa mãn tiêu chí FOL trong kỳ này bao gồm EIB, KDH và DHC. Tuy nhiên, KDH và DHC vẫn sẽ được giữ lại trong rổ để đáp ứng tiêu chí có ít nhất 8 cổ phiếu không thuộc ngành bị áp dụng giới hạn tỷ trọng (hiện là ngành ngân hàng). Với giả định như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ DCVFMVN DIAMOND ETF – mô phỏng bộ chỉ số VN Diamond như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	FPT	15.82%	15.00%	-0.82%	(1,901,245)	
2	MWG	14.10%	15.00%	0.90%	4,289,609	
3	PNJ	12.66%	12.72%	0.06%	155,869	
4	TCB	9.24%	9.74%	0.50%	3,121,427	
5	VPB	6.76%	7.07%	0.31%	2,758,238	
6	REE	7.26%	7.00%	-0.26%	(691,782)	
7	GMD	5.29%	6.68%	1.39%	4,943,286	
8	MBB	6.29%	6.64%	0.35%	3,470,970	
9	ACB	7.34%	5.14%	-2.19%	(16,326,631)	
10	VIB	3.01%	3.18%	0.17%	1,540,514	
11	TPB	2.99%	3.15%	0.16%	1,314,661	
12	CTG	1.51%	2.30%	0.79%	4,973,488	
13	KDH	1.97%	2.10%	0.12%	810,337	
14	MSB	2.69%	1.44%	-1.25%	(18,571,843)	
15	OCB	1.59%	1.33%	-0.25%	(2,879,135)	
16	NLG	0.71%	1.15%	0.44%	2,815,766	
17	DHC	0.21%	0.35%	0.14%	677,547	
	EIB	0.57%		-0.57%	(5,507,160)	Loại

Nguồn: PHS

Trong khi đó, các bộ chỉ số VN30 và VNFIN Lead chỉ cập nhật các thông tin như khối lượng lưu hành, free-float, các giới hạn trọng số trong lần thay đổi danh mục 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

Đảm bảo phân tích

Báo cáo được thực hiện bởi Phạm Quang Chương, Chuyên viên phân tích – Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng. Mỗi nhân viên phụ trách về phân tích, chiến lược hay nghiên cứu chịu trách nhiệm cho sự chuẩn bị và nội dung của tất cả các phần có trong bản báo cáo nghiên cứu này đảm bảo rằng, tất cả các ý kiến của những người phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đều phản ánh trung thực và chính xác ý kiến cá nhân của họ về những vấn đề trong bản báo cáo. Mỗi nhân viên phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đảm bảo rằng họ không được hưởng bất cứ khoản chi trả nào trong quá khứ, hiện tại cũng như tương lai liên quan đến các khuyến cáo hay ý kiến thể hiện trong bản báo cáo này.

Miễn trừ trách nhiệm

Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng không chịu trách nhiệm về sự hoàn chỉnh hay tính chính xác của báo cáo. Đây không phải là bản chào hàng hay sự nài khẩn mua của bất cứ cổ phiếu nào. Chứng khoán Phú Hưng và các chi nhánh và văn phòng và nhân viên của mình có thể có hoặc không có vị trí liên quan đến các cổ phiếu được nhắc tới ở đây. Chứng khoán Phú Hưng (hoặc chi nhánh) đôi khi có thể có đầu tư hoặc các dịch vụ khác hay thu hút đầu tư hoặc các hoạt động kinh doanh khác cho bất kỳ công ty nào được nhắc đến trong báo cáo này. Tất cả các ý kiến và dự đoán có trong báo cáo này được tạo thành từ các đánh giá của Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng vào ngày này và có thể thay đổi không cần báo trước.

© Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng

Tầng 21, Phú Mỹ Hưng Tower, 8 Hoàng Văn Thái, phường Tân Phú, quận 7, Tp.HCM

Điện thoại: (+84-28) 5 413 5479

Customer Service: (+84-28) 5 411 8855

E-mail: info@phs.vn / support@phs.vn

Fax: (+84-28) 5 413 5472

Call Center: (+84-28) 5 413 5488

Web: www.phs.vn

PGD Phú Mỹ Hưng

Tòa nhà CR2-08, 107 Tôn Dật Tiên, Phường Tân Phú, Quận 7, Tp.HCM

Điện thoại: (+84-28) 5 413 5478

Fax: (+84-28) 5 413 5473

Chi nhánh Quận 1

Phòng 1003A, Tầng 10, Tòa nhà Ruby

81-83-83B-85 Hàm Nghi,

Phường Nguyễn Thái Bình, Quận 1, Tp.HCM

Điện thoại: (+84-28) 3 535 6060

Fax: (+84-28) 3 535 2912

Chi nhánh Quận 3

Tầng 2, Tòa nhà Phương Nam, 157 Võ Thị

Sáu, Phường 6, Quận 3, Tp.HCM

Điện thoại: (+84-28) 3 820 8068

Fax: (+84-28) 3 820 8206

Chi nhánh Tân Bình

Tòa nhà Park Legend,

251 Hoàng Văn Thụ, Phường 2, Quận Tân Bình,

Tp.HCM.

Điện thoại: (+84-28) 3 813 2401

Fax: (+84-28) 3 813 2415

Chi Nhánh Thanh Xuân

Tầng 5, Tòa nhà UDIC Complex, N04 Hoàng

Đạo Thúy, Phường Trung Hòa, Quận Cầu

Giấy, Hà Nội.

Điện thoại: (+84-24) 6 250 9999

Fax: (+84-24) 6 250 6666

Chi Nhánh Hà Nội

Tầng 5, Tòa nhà Vinafor,

127 Lò Đúc, Phường Đồng Mác, Quận Hai Bà

Trung, Hà Nội

Điện thoại: (+84-24) 3 933 4566

Fax: (+84-24) 3 933 4820

Chi nhánh Hải Phòng

Tầng 2, Tòa nhà Eliteco, 18 Trần Hưng Đạo,

Quận Hồng Bàng, Hải Phòng

Điện thoại: (+84-22) 384 1810

Fax: (+84-22) 384 1801