

1. CHỈ SỐ VN30 VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN30 ETF

Ngày chốt dữ liệu: 30/06/2023
Ngày công bố: 17/07/2023
Ngày cơ cấu danh mục: 04/08/2023

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 30/06, chúng tôi dự báo chỉ số VN30 sẽ loại ra hai cổ phiếu trong kỳ review tháng 7/2023 là NVL và PDR. Đối với NVL, cổ phiếu này bị loại ra do nằm trong diện cảnh báo của HoSE. Trong khi đó, PDR bị loại do vốn hóa nằm ngoài top 40 của danh sách xem xét cuối cùng. Ở chiều ngược lại, bộ đôi SSB và SHB sẽ là những cổ phiếu được lựa chọn để thay thế. Với giả định như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ DCVFMVN30 ETF – quỹ ETF nội có quy mô lớn nhất mô phỏng bộ chỉ số VN30 như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VPB	8.56%	8.13%	-0.43%	(1,732,104)	
2	HPG	7.69%	7.29%	-0.40%	(1,221,781)	
3	FPT	7.39%	7.04%	-0.36%	(330,286)	
4	TCB	6.80%	6.45%	-0.35%	(859,272)	
5	ACB	6.70%	6.35%	-0.35%	(1,260,696)	
6	VHM	5.51%	5.22%	-0.29%	(414,175)	
7	VNM	5.45%	5.17%	-0.28%	(314,160)	
8	VIC	5.38%	5.09%	-0.29%	(455,848)	
9	STB	5.16%	4.90%	-0.27%	(710,991)	
10	VCB	4.79%	4.54%	-0.25%	(202,149)	
11	MBB	4.63%	4.39%	-0.24%	(942,673)	
12	SSB		4.34%	4.34%	12,786,593	Thêm
13	MSN	4.44%	4.20%	-0.24%	(254,968)	
14	MWG	4.38%	4.14%	-0.24%	(436,152)	
15	HDB	3.01%	2.85%	-0.16%	(674,155)	
16	SHB		2.67%	2.67%	17,047,468	Thêm
17	SSI	2.49%	2.36%	-0.13%	(407,652)	
18	VJC	2.35%	2.23%	-0.13%	(106,845)	
19	VIB	2.29%	2.17%	-0.12%	(506,344)	
20	VRE	2.24%	2.12%	-0.11%	(341,717)	
21	TPB	2.18%	2.07%	-0.11%	(495,402)	
22	CTG	1.96%	1.85%	-0.10%	(277,158)	
23	SAB	1.01%	0.94%	-0.07%	(34,668)	
24	GAS	0.82%	0.78%	-0.04%	(33,615)	
25	BID	0.80%	0.76%	-0.04%	(72,816)	
26	POW	0.72%	0.68%	-0.04%	(230,854)	
27	PLX	0.44%	0.41%	-0.03%	(53,807)	
28	BCM	0.27%	0.29%	0.02%	16,555	
29	BVH	0.31%	0.29%	-0.02%	(35,620)	
30	GVR	0.29%	0.27%	-0.02%	(66,288)	
	NVL	1.46%		-1.46%	(7,862,041)	Loại
	PDR	0.47%		-0.47%	(2,229,815)	Loại

Nguồn: PHS