

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

Ngày chốt dữ liệu: 29/09/2023 Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 22/09, chúng tôi dự báo chỉ số VN Diamond sẽ thêm vào hai cổ phiếu mới (HDB và BMP), đồng thời loại ra DHC. Mặc dù không thỏa mãn tiêu chí FOL, BMP được thêm vào để duy trì số lượng ít nhất 8 cổ phiếu không thuộc nhóm ngành bị giới hạn vốn hóa (Ngành Tài chính).

DCVFMVN Diamond ETF hiện là quỹ lớn đang mô phỏng theo bộ chỉ số VN Diamond với quy mô tổng tài sản khoảng 19,700 tỷ đồng (quy mô lớn nhất trong số các quỹ ETF đang đầu tư danh mục vào cổ phiếu Việt Nam).

Dự báo hoạt động tái cơ cấu của quỹ DCVFMVN Diamond ETF:

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	MWG	14.78%	15.00%	0.22%	848,159	
2	FPT	17.34%	15.00%	-2.34%	(4,941,641)	
3	GMD	7.53%	9.84%	2.31%	7,358,472	
4	PNJ	10.59%	9.46%	-1.13%	(2,842,215)	
5	TCB	7.93%	8.87%	0.94%	5,639,584	
6	ACB	5.19%	6.30%	1.11%	10,181,905	
7	MBB	7.28%	6.12%	-1.17%	(12,722,033)	
8	REE	5.85%	5.80%	-0.06%	(177,637)	
9	VPB	6.79%	5.69%	-1.09%	(10,474,215)	
10	MSB	1.76%	2.96%	1.19%	16,889,834	
11	VIB	3.49%	2.94%	-0.56%	(5,591,965)	
12	TPB	3.33%	2.79%	-0.53%	(5,846,005)	
13	NLG	2.46%	2.52%	0.06%	354,820	
14	KDH	2.10%	2.15%	0.05%	316,291	
15	CTG	2.32%	1.95%	-0.37%	(2,400,586)	
16	OCB	1.09%	1.37%	0.28%	4,078,686	
17	HDB		1.01%	1.01%	11,785,719	Thêm
18	BMP		0.23%	0.23%	525,053	Thêm
	DHC	0.17%		-0.17%	(723,915)	Loại

Nguồn: PHS

Trong kỳ đánh giá vào tháng 10 này, chỉ số VN30 và VNFIN Lead sẽ không thay đổi danh mục cổ phiếu thành phần mà chỉ cập nhật một số thông tin liên quan như số lượng cổ phiếu lưu hành, tỷ lệ free-float, trọng số giới hạn... Do đó, chúng tôi sẽ cập nhật dự báo cơ cấu của các quỹ ETF liên quan trong lần báo cáo kế tiếp.