

- Các quỹ ETF nội dự kiến sẽ thực hiện cơ cấu quý 1 vào ngày 02/02/2024.
- Chúng tôi dự báo VN30 & VNFIN Lead sẽ không thay đổi danh mục trong kỳ cơ cấu định kỳ lần này.
- Do đây không phải là kỳ thay đổi định kỳ, chỉ số VN Diamond sẽ không thay đổi danh mục trong lần này mà chỉ cập nhật lại dữ liệu liên quan của các cổ phiếu thành phần.

Chỉ số	Ngày thông báo	Ngày cơ cấu của quỹ	Ngày hiệu lực của chỉ số	Dự báo của PHS
VN30	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	Không thay đổi
VNFIN Lead	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	Không thay đổi

1. VN30 và cơ cấu quỹ DCVFMVN30 ETF

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 28/12, chúng tôi dự báo chỉ số VN30 sẽ giữ nguyên danh mục cổ phiếu thành phần trong kỳ cơ cấu lần này. Các quỹ ETF mô phỏng bộ chỉ số VN30 sẽ thực hiện tái cơ cấu trước khi bộ chỉ số có hiệu lực. Hiện có 4 quỹ ETF nội mô phỏng bộ chỉ số VN30 (bao gồm DCVFMVN30 ETF, KIM GROWTH VN30 ETF, SSIAM VN30 ETF, MAFM VN30 ETF) với tổng quy mô tài sản khoảng 8,600 tỷ đồng. Trong đó, DCVFMVN30 ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với khoảng 7,500 tỷ đồng. Chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ DCVFMVN30 ETF như sau:

MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
	Hiện tại	Mới	Thay đổi		
VPB	7.66%	8.87%	1.21%	4,822,599	
FPT	9.00%	8.86%	-0.14%	(107,090)	
HPG	7.71%	7.59%	-0.12%	(313,854)	
ACB	7.16%	7.05%	-0.11%	(343,370)	
TCB	6.28%	6.13%	-0.15%	(367,055)	
VNM	4.94%	4.87%	-0.08%	(83,358)	
VHM	4.89%	4.85%	-0.04%	(73,986)	
MBB	4.59%	4.52%	-0.07%	(286,118)	
STB	4.49%	4.42%	-0.07%	(182,469)	
VIC	4.39%	4.33%	-0.06%	(93,931)	
VCB	4.39%	4.32%	-0.07%	(58,909)	
MWG	4.34%	4.28%	-0.06%	(111,035)	
MSN	3.73%	3.67%	-0.06%	(66,917)	
HDB	3.38%	3.33%	-0.05%	(203,645)	
SSI	2.99%	2.94%	-0.04%	(98,931)	
SSB	2.75%	2.76%	0.01%	18,183	
VJC	2.77%	2.73%	-0.04%	(28,864)	
SHB	2.70%	2.66%	-0.04%	(284,866)	
VIB	2.18%	2.33%	0.14%	551,653	
TPB	1.97%	1.94%	-0.03%	(131,099)	
CTG	1.88%	1.85%	-0.03%	(79,367)	
VRE	1.86%	1.81%	-0.05%	(157,650)	
BID	0.84%	0.83%	-0.01%	(17,924)	
SAB	0.75%	0.75%	-0.01%	(9,945)	
GAS	0.75%	0.74%	-0.01%	(11,879)	
POW	0.45%	0.45%	-0.01%	(48,343)	
PLX	0.38%	0.37%	-0.01%	(11,867)	
GVR	0.28%	0.28%	-0.01%	(19,063)	
BVH	0.25%	0.25%	0.00%	(4,822)	
BCM	0.22%	0.22%	0.00%	(2,497)	

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

Nguồn: PHS