

Vào ngày 16/10 vừa qua, HoSE đã công bố thông tin danh mục định kỳ của các bộ chỉ số. Những thay đổi này sẽ chính thức có hiệu lực kể từ ngày 06/11/2023. Trước đó, các quỹ ETF mô phỏng theo các bộ chỉ số này sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 03/11/2023.

1. DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN DIAMOND ETF

Chỉ số VN Diamond: Thêm HDB, VRE - Loại DHC

Hiện có 3 quỹ ETF nội mô phỏng bộ chỉ số VN Diamond với tổng quy mô tài sản khoảng 19,200 tỷ đồng. Trong đó, DCVFMVN DIAMOND ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với 18,850 tỷ đồng. Với kết quả như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ DCVFMVN DIAMOND ETF như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	FPT	17.8%	15.0%	-2.81%	(5,551,684)	
2	MWG	14.1%	15.0%	0.89%	3,524,636	
3	GMD	8.0%	9.6%	1.66%	4,854,744	
4	TCB	7.6%	8.9%	1.26%	7,594,372	
5	PNJ	10.7%	8.8%	-1.88%	(4,496,731)	
6	MBB	7.2%	6.4%	-0.87%	(9,161,082)	
7	VPB	7.4%	6.2%	-1.11%	(9,478,443)	
8	REE	5.8%	5.4%	-0.39%	(1,191,804)	
9	ACB	5.2%	4.8%	-0.47%	(3,973,301)	
10	VIB	3.3%	3.3%	-0.06%	(640,808)	
11	MSB	1.7%	2.9%	1.14%	15,888,816	
12	TPB	3.1%	2.7%	-0.33%	(3,808,347)	
13	NLG	2.4%	2.3%	-0.14%	(770,964)	
14	KDH	2.3%	2.2%	-0.12%	(705,098)	
15	CTG	2.2%	1.9%	-0.25%	(1,693,851)	
16	VRE		1.7%	1.71%	12,251,195	Thêm
17	HDB		1.6%	1.61%	17,724,271	Thêm
18	OCB	1.0%	1.3%	0.32%	4,819,495	
	DHC		0.2%	-0.16%	(674,915)	Loại

Nguồn: PHS

2. DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN30 ETF

Chỉ số VN30: không thay đổi danh mục trong kỳ này mà chỉ điều chỉnh thông tin của các cổ phiếu thành phần.

Hiện có 4 quỹ ETF nội mô phỏng bộ chỉ số VN30 với tổng quy mô khoảng 8,700 tỷ đồng. Trong đó, DCVFMVN30 ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với 7,600 tỷ đồng. Với kết quả như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ DCVFMVN30 ETF như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	FPT	8.98%	8.64%	-0.34%	(264,197)	
2	VPB	9.05%	8.63%	-0.42%	(1,410,565)	
3	HPG	6.88%	6.86%	-0.01%	(42,218)	
4	ACB	6.40%	6.60%	0.20%	660,205	
5	TCB	6.25%	6.13%	-0.11%	(272,720)	
6	VNM	5.40%	5.28%	-0.12%	(118,090)	