

19/04/2024

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

DỰ BÁO CƠ CẤU DANH MỤC ĐỊNH KỲ CỦA CÁC QUỸ ETF NỘI KỲ QUÝ 2/2024

- HOSE công bố kết quả thay đổi của chỉ số VN Diamond với việc loại ra MWG và đồng thời thêm vào BMP. Tỷ trọng của các cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số VN Diamond có sự thay đổi đáng kể sau khi chỉ số mới có hiệu lực.
- Các quỹ ETF nội dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 3/6 tới đây.

DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ DCVFMVN DIAMOND ETF

Vào ngày 15/04 vừa qua, HOSE vừa công bố thay đổi định kỳ của một số bộ chỉ số. Trong đó, chỉ số VN Diamond sẽ chính thức loại ra MWG đồng thời thêm vào BMP. **Tỷ trọng dự kiến của BMP sau khi được thêm vào rổ khoảng 0.4%, thấp hơn nhiều so với mức tỷ trọng khoảng 15% của MWG bị loại ra. Do đó, đa phần các cổ phiếu còn lại sẽ được gia tăng tỷ trọng. Trong đó, GMD, PNJ, VRE, REE là những cổ phiếu hưởng lợi đáng kể.**

Hiện có 3 quỹ ETF nội mô phỏng theo bộ chỉ số VN Diamond (bao gồm DCVFMVN Diamond ETF, MAFM VNDIAMOND ETF, BVFVN DIAMOND ETF) với tổng quy mô tài sản khoảng 15.9 nghìn tỷ đồng. Trong đó, VFMVN Diamond ETF là quỹ có quy mô lớn nhất với khoảng 15.4 nghìn tỷ đồng. Dựa trên danh mục của quỹ tính đến ngày 16/04, chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ DCVFMVN Diamond như sau:

Bảng 1: Dự báo cơ cấu danh mục của quỹ DCVFMVN Diamond ETF

Mã CK	Tỷ trọng hiện tại	Tỷ trọng mới	Thay đổi tỷ trọng	SLCP mua/bán ròng	Chú thích
PNJ	11.6%	15.0%	3.4%	5,466,801	
FPT	16.0%	15.0%	-1.0%	(1,332,237)	
GMD	9.2%	13.8%	4.6%	8,989,519	
TCB	7.7%	8.1%	0.5%	1,654,580	
ACB	7.0%	8.1%	1.2%	6,585,600	
REE	4.2%	6.3%	2.1%	5,293,233	
MBB	6.9%	6.0%	-1.0%	(6,143,200)	
HDB	2.5%	4.4%	1.9%	12,563,578	
VPB	4.4%	4.0%	-0.5%	(3,715,681)	
NLG	2.2%	3.5%	1.3%	5,076,415	
VRE	1.1%	3.4%	2.3%	15,785,971	
KDH	1.7%	2.7%	0.9%	4,201,267	
VIB	2.8%	2.3%	-0.5%	(3,664,789)	
MSB	2.3%	2.1%	-0.2%	(1,878,183)	
CTG	2.0%	1.8%	-0.2%	(906,855)	
TPB	2.3%	1.7%	-0.6%	(4,805,255)	
OCB	1.1%	1.4%	0.3%	3,107,222	
BMP		0.4%	0.4%	463,479	Thêm
MWG	15.0%		-15.0%	(46,049,140)	Loại

Nguồn: PHS dự báo