

01/08/2024

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương
chuongpham@pfs.vn

DỰ BÁO CƠ CẤU DANH MỤC ĐỊNH KỲ CỦA CÁC QUỸ ETF NỘI KỲ QUÝ 3/2024

- HOSE công bố kết quả thay đổi của bộ chỉ số VNFIN Lead với việc thêm vào 3 cổ phiếu mới là VIX, SSB, NAB và không loại ra cổ phiếu nào.
- Trong khi đó, chỉ số VN30 sẽ giữ nguyên danh mục trong kì đánh giá này.
- Mặc dù không phải là thời điểm thay đổi danh mục định kỳ, chỉ số VN Diamond cũng điều chỉnh tỷ trọng của các cổ phiếu thành phần thông qua điều chỉnh các hệ số giới hạn.
- Các quỹ ETF nội dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 02/08 tới đây, trước khi thay đổi của các bộ chỉ số chính thức có hiệu lực vào ngày 05/08.

DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ SSIAM VNFIN LEAD ETF

HOSE đã công bố kết quả thay đổi của các bộ chỉ số VNFIN Lead vào ngày 15/07/2024. Cụ thể, **VNFIN Lead sẽ thêm mới 3 cổ phiếu là VIX, SSB, NAB và không loại ra cổ phiếu nào**. Kết quả này phù hợp với dự báo trước đó của chúng tôi. Số lượng cổ phiếu trong danh mục sau thay đổi tăng lên thành 23 mã.

Dựa trên số liệu tính đến ngày 29/07/2024, chúng tôi dự báo quỹ SSIAM VNFIN LEAD ETF – mô phỏng bộ chỉ số VNFIN Lead sẽ mua vào khoảng 880 nghìn cổ phiếu VIX, 146 nghìn cổ phiếu SSB, 94 nghìn cổ phiếu NAB. Ngược lại, STB, SHB là những cổ phiếu bị bán ra nhiều nhất với lần lượt 505 nghìn cổ phiếu và 362 nghìn cổ phiếu.

Bảng 1: Dự báo cơ cấu danh mục của quỹ SSIAM VNFINLEAD ETF

Mã CK	Tỷ trọng hiện tại	Tỷ trọng mới	Thay đổi tỷ trọng	SLCP mua/bán ròng	Chú thích
TCB	12.6%	13.9%	1.3%	377,555	
VPB	13.4%	12.6%	-0.8%	-273,304	
STB	13.5%	11.2%	-2.3%	-505,160	
SSI	10.7%	9.8%	-0.9%	-176,105	
MBB	9.0%	9.0%	0.0%	-10,564	
ACB	8.6%	8.4%	-0.3%	-66,463	
LPB	2.7%	5.7%	3.0%	646,580	
SHB	4.8%	4.2%	-0.6%	-362,171	
HDB	3.8%	3.7%	-0.1%	-32,496	
EIB	4.1%	3.6%	-0.5%	-181,350	
VND	4.4%	3.6%	-0.8%	-336,965	
VCB	2.9%	2.7%	-0.1%	-10,179	
CTG	2.2%	2.2%	0.0%	-7,662	
VIX		1.9%	1.9%	880,802	Thêm
MSB	1.7%	1.6%	0.0%	-10,255	
VCI	1.6%	1.5%	-0.1%	-10,162	
TPB	1.4%	1.2%	-0.2%	-58,911	
VIB	1.2%	1.1%	-0.1%	-20,786	
HCM	0.8%	0.7%	-0.1%	-22,091	
SSB		0.5%	0.5%	146,070	Thêm
BID	0.3%	0.3%	0.0%	-783	