

### 1. Chỉ số VN Diamond và dự báo cơ cấu quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND (FUEVFNVD)

Ngày công bố: 17/10/2022  
 Ngày cơ cấu danh mục: 04/11/2022

Trong lần cập nhật thông tin định kỳ quý 3 tới đây, HoSE sẽ công bố thay đổi danh mục mới của bộ chỉ số VN Diamond. Dựa theo dữ liệu đến ngày 23/09/2022, chúng tôi dự báo KDH và TCM sẽ là những cổ phiếu bị loại ra. Trong đó, TCM vi phạm tiêu chí vốn hóa điều chỉnh free-float còn KDH vi phạm tiêu chí FOL. Để đảm bảo quy định duy trì ít nhất 8 cổ phiếu không thuộc nhóm ngành bị giới hạn vốn hóa, chúng tôi cho rằng HCM và SAB sẽ là những cổ phiếu được lựa chọn để thay thế dựa trên giá trị FOL từ cao xuống thấp của danh sách sau sàng lọc. Với dự báo trên, chúng tôi đưa ra bảng cơ cấu của quỹ ETF DCVFMVN DIAMOND – quỹ mô phỏng chỉ số VN Diamond như sau.

STT	MCK	Hiện tại		Mới		SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Tỷ trọng (%)	SLCP	Tỷ trọng (%)	SLCP		
1	FPT	15.1%	30,106,934	15.0%	30,003,660	(103,274)	
2	MWG	17.0%	40,310,140	15.0%	35,623,943	(4,686,197)	
3	PNJ	14.8%	21,388,128	15.0%	21,705,897	317,769	
4	TCB	8.5%	41,168,000	9.0%	43,373,713	2,205,713	
5	REE	9.8%	19,302,484	8.5%	16,854,456	(2,448,028)	
6	MBB	5.9%	46,200,520	6.8%	53,675,557	7,475,037	
7	ACB	7.3%	53,094,116	6.4%	46,344,786	(6,749,330)	
8	VPB	7.5%	43,123,211	5.9%	33,716,362	(9,406,849)	
9	GMD	2.3%	7,729,250	4.0%	13,498,393	5,769,143	
10	MSB	2.5%	23,773,006	3.0%	27,946,912	4,173,906	
11	TPB	2.2%	14,658,825	2.6%	17,023,272	2,364,447	
12	VIB	2.1%	15,692,804	2.5%	18,713,751	3,020,947	
13	OCB	0.7%	6,963,900	1.6%	16,217,347	9,253,447	
14	CTG	0.5%	3,354,915	1.2%	7,758,114	4,403,199	
15	<b>SAB</b>			<b>1.1%</b>	<b>929,251</b>	<b>929,251</b>	<b>Thêm</b>
16	EIB	0.9%	4,179,300	1.0%	4,961,806	782,506	
17	<b>HCM</b>			<b>1.0%</b>	<b>6,022,950</b>	<b>6,022,950</b>	<b>Thêm</b>
18	DHC	0.2%	674,200	0.4%	1,198,667	524,467	
	<b>KDH</b>	<b>1.7%</b>	<b>9,125,202</b>			<b>(9,125,202)</b>	<b>Loại</b>
	<b>TCM</b>	<b>0.1%</b>	<b>489,950</b>			<b>(489,950)</b>	<b>Loại</b>

Nguồn: Bloomberg, PHS

Trong khi đó, các bộ chỉ số VN30 và VNFIND chỉ cập nhật thông tin khối lượng lưu hành, free-float trong lần cập nhật thông tin quý 3 này. Do đó, chúng tôi sẽ đưa ra dự báo cơ cấu của các quỹ ETF tương ứng mô phỏng các bộ chỉ số trên trong bài báo cáo ETF tiếp theo, sau khi có kết quả công bố thông tin từ HoSE.

Báo cáo được thực hiện bởi Phạm Quang Chương, Chuyên viên phân tích – Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng. Mỗi nhân viên phụ trách về phân tích, chiến lược hay nghiên cứu chịu trách nhiệm cho sự chuẩn bị và nội dung của tất cả các phần có trong bản báo cáo nghiên cứu này đảm bảo rằng, tất cả các ý kiến của những người phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đều phản ánh trung thực và chính xác ý kiến cá nhân của họ về những vấn đề trong bản báo cáo. Mỗi nhân viên phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đảm bảo rằng họ không được hưởng bất cứ khoản chi trả nào trong quá khứ, hiện tại cũng như tương lai liên quan đến các khuyến cáo hay ý kiến thể hiện trong bản báo cáo này.

## **Miễn trách**

---

Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng không chịu trách nhiệm về sự hoàn chỉnh hay tính chính xác của báo cáo. Đây không phải là bản chào hàng hay sự nài khẩn mua của bất cứ cổ phiếu nào. Chứng khoán Phú Hưng và các chi nhánh và văn phòng và nhân viên của mình có thể có hoặc không có vị trí liên quan đến các cổ phiếu được nhắc tới ở đây. Chứng khoán Phú Hưng (hoặc chi nhánh) đôi khi có thể có đầu tư hoặc các dịch vụ khác hay thu hút đầu tư hoặc các hoạt động kinh doanh khác cho bất kỳ công ty nào được nhắc đến trong báo cáo này. Tất cả các ý kiến và dự đoán có trong báo cáo này được tạo thành từ các đánh giá của Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng vào ngày này và có thể thay đổi không cần báo trước.

### **© Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng**

Tầng 21, Phú Mỹ Hưng Tower, 8 Hoàng Văn Thái, phường Tân Phú, quận 7, Tp.HCM

**Điện thoại:** (+84-28) 5 413 5479

**Customer Service:** (+84-28) 5 411 8855

**E-mail:** info@phs.vn / support@phs.vn

**Fax:** (+84-28) 5 413 5472

**Call Center:** (+84-28) 5 413 5488

**Web:** www.phs.vn

### **PGD Phú Mỹ Hưng**

Tòa nhà CR2-08, 107 Tôn Dật Tiên, Phường

Tân Phú, Quận 7, Tp.HCM

**Điện thoại:** (+84-28) 5 413 5478

**Fax:** (+84-28) 5 413 5473

### **Chi nhánh Quận 1**

Phòng 1003A, Tầng 10, Tòa nhà Ruby

81-83-83B-85 Hàm Nghi,

Phường Nguyễn Thái Bình, Quận 1, Tp.HCM

**Điện thoại:** (+84-28) 3 535 6060

**Fax:** (+84-28) 3 535 2912

### **Chi nhánh Quận 3**

Tầng 2, Tòa nhà Phương Nam, 157 Võ Thị

Sáu, Phường 6, Quận 3, Tp.HCM

**Điện thoại:** (+84-28) 3 820 8068

**Fax:** (+84-28) 3 820 8206

### **Chi nhánh Tân Bình**

Tòa nhà Park Legend,

251 Hoàng Văn Thụ, Phường 2, Quận Tân Bình,

Tp.HCM.

**Điện thoại:** (+84-28) 3 813 2401

**Fax:** (+84-28) 3 813 2415

### **Chi Nhánh Thanh Xuân**

Tầng 5, Tòa nhà UDIC Complex, N04 Hoàng

Đạo Thúy, Phường Trung Hòa, Quận Cầu

Giấy, Hà Nội.

**Điện thoại:** (+84-24) 6 250 9999

**Fax:** (+84-24) 6 250 6666

### **Chi Nhánh Hà Nội**

Tầng 5, Tòa nhà Vinafor,

127 Lò Đúc, Phường Đồng Mác, Quận Hai Bà

Trung, Hà Nội

**Điện thoại:** (+84-24) 3 933 4566

**Fax:** (+84-24) 3 933 4820

### **Chi nhánh Hải Phòng**

Tầng 2, Tòa nhà Eliteco, 18 Trần Hưng Đạo,

Quận Hồng Bàng, Hải Phòng

**Điện thoại:** (+84-22) 384 1810

**Fax:** (+84-22) 384 1801