

1. CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ XTRACKERS FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF

Ngày chốt dữ liệu: 25/11/2022
 Ngày công bố: 02/12/2022
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/12/2022

Dựa vào số liệu tính toán đến ngày 23/11/2022, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ loại ra một cổ phiếu HSG do vi phạm tiêu chí vốn hóa có thể đầu tư. Ngược lại, không có cổ phiếu nào thỏa mãn điều kiện để thêm vào. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap Ucits ETF – quỹ mô phỏng chỉ số FTSE Vietnam Index như sau.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VIC	15.52%	15.00%	-0.52%	(448,865)	
2	MSN	12.52%	12.67%	0.15%	82,284	
3	VHM	12.28%	12.42%	0.15%	168,836	
4	VNM	12.14%	12.28%	0.14%	93,350	
5	HPG	8.31%	8.41%	0.10%	367,766	
6	VRE	6.15%	6.23%	0.07%	143,716	
7	VCB	5.80%	5.87%	0.07%	48,196	
8	SSI	3.58%	3.63%	0.04%	138,498	
9	VJC	3.45%	3.49%	0.04%	20,972	
10	NVL	3.31%	3.35%	0.04%	85,569	
11	STB	2.09%	2.12%	0.02%	73,000	
12	DGC	2.00%	2.02%	0.02%	23,480	
13	VND	1.34%	1.35%	0.02%	77,024	
14	KBC	1.22%	1.23%	0.01%	44,616	
15	DPM	1.20%	1.21%	0.01%	20,205	
16	VCI	1.19%	1.20%	0.01%	37,756	
17	PLX	1.09%	1.11%	0.01%	25,076	
18	GEX	1.08%	1.10%	0.01%	53,854	
19	POW	1.04%	1.05%	0.01%	60,630	
20	PDR	1.03%	1.05%	0.01%	42,479	
21	PVD	0.74%	0.75%	0.01%	33,285	
22	VCG	0.65%	0.66%	0.01%	30,516	
23	DIG	0.64%	0.64%	0.01%	32,102	
24	DXG	0.60%	0.61%	0.01%	51,891	
25	TCH	0.55%	0.56%	0.01%	42,262	
	HSG	0.48%		-0.48%	(2,857,275)	Loại

Nguồn: PHS

2. CHỈ SỐ MVIS VIETNAM INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ VANECK VECTORS VIETNAM ETF

Ngày chốt dữ liệu: 30/11/2022
 Ngày công bố: 09/12/2022
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/12/2022

Với chỉ số MVIS Vietnam Index, chúng tôi cho rằng danh mục của bộ chỉ số này sẽ có sự biến động mạnh trong kỳ cơ cấu tới đây. Cụ thể, HNG, HSG, BCG, DXG, ITA là những cổ phiếu có thể bị loại ra do không đáp ứng được tiêu chí vốn hóa điều chỉnh free-float. Ngoài ra, một số trường hợp khác như HUT, SHS và HDG cũng đang ở ngưỡng báo động và có khả năng bị loại nếu vốn hóa giảm mạnh hơn cho đến ngày chốt dữ liệu. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra bảng cơ cấu của quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF – mô phỏng bộ chỉ số MVIS Vietnam Index như sau.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VNM	8.00%	8.00%	-0.004%	(3,926)	
2	MSN	8.44%	8.00%	-0.44%	(376,769)	
3	VHM	7.60%	7.00%	-0.60%	(1,055,271)	
4	VIC	7.90%	6.50%	-1.40%	(1,843,179)	
5	VCB	5.13%	5.83%	0.70%	754,298	
6	VRE	3.50%	3.98%	0.48%	1,452,438	
7	HPG	3.43%	3.90%	0.47%	2,691,643	
8	NVL	2.51%	3.08%	0.58%	1,921,668	
9	SSI	2.25%	2.56%	0.31%	1,545,310	
10	SAB	1.72%	1.96%	0.23%	101,138	
11	STB	1.46%	1.66%	0.20%	904,095	
12	VND	1.41%	1.60%	0.19%	1,435,412	
13	KDH	1.15%	1.31%	0.16%	570,850	
14	SHB	0.92%	1.20%	0.28%	2,478,727	
15	DGC	1.02%	1.19%	0.17%	252,199	
16	VJC	1.04%	1.18%	0.14%	113,357	
17	THD	1.02%	1.14%	0.12%	236,955	
18	VHC	0.89%	1.02%	0.13%	149,396	
19	VPI	0.86%	0.98%	0.12%	172,757	
20	DPM	0.83%	0.95%	0.12%	252,900	
21	VCI	0.78%	0.88%	0.11%	437,904	
22	POW	0.72%	0.82%	0.10%	746,690	
23	IDC	0.66%	0.75%	0.09%	248,270	
24	PVS	0.66%	0.75%	0.09%	373,384	
25	GEX	0.60%	0.68%	0.08%	526,559	
26	PDR	0.59%	0.67%	0.08%	427,686	
27	KBC	0.59%	0.67%	0.08%	377,389	
28	KDC	0.57%	0.66%	0.09%	115,754	
29	PVD	0.56%	0.63%	0.08%	441,335	
30	BVH	0.53%	0.61%	0.07%	117,529	
31	SBT	0.52%	0.59%	0.07%	502,777	
32	DIG	0.50%	0.57%	0.07%	455,183	
33	HAG	0.48%	0.55%	0.07%	764,385	
34	VIX	0.42%	0.48%	0.06%	703,643	
35	TCH	0.37%	0.43%	0.06%	546,289	
36	VCG	0.37%	0.43%	0.05%	309,863	
37	HUT	0.34%	0.39%	0.05%	274,671	
38	SHS	0.34%	0.39%	0.05%	543,078	
39	HDG	0.34%	0.38%	0.05%	137,792	
	HNG	0.32%		-0.32%	(6,172,600)	Loại
	HSG	0.32%		-0.32%	(2,909,640)	Loại
	BCG	0.19%		-0.19%	(2,782,600)	Loại
	DXG	0.18%		-0.18%	(1,482,800)	Loại
	ITA	0.18%		-0.18%	(4,569,600)	Loại
	Tỷ trọng cp Việt Nam	72.22%	74.38%	2.16%		

Nguồn: PHS

3. CHỈ SỐ FTSE VIETNAM 30 INDEX

Với FTSE Vietnam 30 Index, bộ chỉ số này sẽ không thực hiện thay đổi danh mục cổ phiếu thành phần trong kỳ cập nhật tháng 12 tới đây. Tuy nhiên, quỹ Fubon FTSE Vietnam ETF – quỹ mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam 30 Index cũng sẽ thực hiện cơ cấu danh mục thành phần định kỳ cùng thời điểm với các quỹ ETF ngoại khác.

Đảm bảo phân tích

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