

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

Ngày chốt dữ liệu: 26/05/2023
 Ngày công bố: 02/06/2023
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/06/2023

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 22/05, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ thêm vào 1 cổ phiếu trong kỳ review lần này là KDC. Ngược lại, VJC là cổ phiếu bị loại ra do không đáp ứng được tiêu chí về thanh khoản. Với giả định như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ Xtracker FTSE Vietnam Swap Ucits ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index như trong bảng dưới đây

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VHM	13.67%	13.86%	0.19%	276,045	
2	VIC	12.38%	12.56%	0.17%	259,602	
3	HPG	12.06%	12.22%	0.17%	601,293	
4	VNM	9.53%	9.66%	0.13%	152,626	
5	MSN	8.87%	8.99%	0.12%	134,533	
6	VCB	8.68%	8.80%	0.12%	101,835	
7	SSI	5.15%	5.22%	0.07%	245,536	
8	VRE	4.86%	4.93%	0.07%	190,224	
9	SHB	2.13%	2.16%	0.03%	194,168	
10	KBC	1.98%	2.01%	0.03%	79,377	
11	VCI	1.93%	1.96%	0.03%	61,730	
12	VND	1.87%	1.89%	0.03%	125,934	
13	DGC	1.81%	1.84%	0.03%	39,272	
14	KDC		1.77%	1.77%	2,152,662	Thêm
15	NVL	1.71%	1.73%	0.02%	139,905	
16	EIB	1.68%	1.70%	0.02%	93,403	
17	PVD	1.24%	1.26%	0.02%	57,483	
18	POW	1.23%	1.25%	0.02%	99,130	
19	GEX	1.19%	1.21%	0.02%	89,848	
20	DIG	1.18%	1.20%	0.02%	63,063	
21	DPM	1.16%	1.18%	0.02%	40,467	
22	HSG	0.91%	0.92%	0.01%	61,236	
23	DXG	0.84%	0.85%	0.01%	64,283	
24	VCG	0.81%	0.82%	0.01%	43,180	
	VJC	3.11%		-3.11%	(2,466,391)	Loại

Nguồn: Bloomberg, PHS

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

Ngày chốt dữ liệu: 31/05/2023
 Ngày công bố: 09/06/2023
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/06/2023

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 22/05, chúng tôi dự báo EIB sẽ là cổ phiếu được thêm vào trong kỳ review lần này, đồng thời không có cổ phiếu nào bị loại ra. Với giả định như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ Vaneck Vectors Vietnam ETF – mô phỏng bộ chỉ số MarketVector Vietnam Local Index như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VHM	8.41%	8.00%	-0.41%	(899,010)	
2	VIC	7.40%	8.00%	0.60%	1,354,066	
3	VNM	6.71%	7.00%	0.29%	498,500	
4	HPG	6.32%	6.50%	0.18%	976,677	
5	VCB	5.70%	6.00%	0.30%	377,833	
6	SSI	5.44%	5.50%	0.06%	301,634	
7	MSN	4.63%	5.00%	0.37%	596,589	
8	VND	4.37%	4.12%	-0.25%	(1,792,899)	
9	NVL	3.35%	3.16%	-0.19%	(1,668,272)	
10	VRE	3.23%	3.04%	-0.18%	(768,566)	
11	SAB	3.09%	2.91%	-0.17%	(127,612)	
12	VCI	2.94%	2.78%	-0.17%	(571,706)	
13	SHB	2.64%	2.49%	-0.15%	(1,464,327)	
14	VJC	2.09%	1.97%	-0.12%	(140,086)	
15	POW	1.91%	1.80%	-0.11%	(931,772)	
16	DGC	1.89%	1.78%	-0.11%	(249,375)	
17	EIB		1.75%	1.75%	10,502,531	Thêm
18	KBC	1.82%	1.72%	-0.10%	(442,858)	
19	VPI	1.72%	1.62%	-0.10%	(213,200)	
20	DIG	1.65%	1.55%	-0.09%	(533,870)	
21	VIX	1.62%	1.52%	-0.09%	(1,088,710)	
22	VHC	1.56%	1.48%	-0.09%	(182,437)	
23	IDC	1.55%	1.47%	-0.09%	(262,686)	
24	GEX	1.44%	1.36%	-0.08%	(660,659)	
25	KDC	1.39%	1.31%	-0.08%	(144,735)	
26	SBT	1.34%	1.27%	-0.08%	(549,032)	
27	BVH	1.27%	1.19%	-0.07%	(191,982)	
28	PDR	1.21%	1.14%	-0.07%	(601,312)	
29	PVS	1.19%	1.12%	-0.07%	(275,695)	
30	DPM	1.14%	1.07%	-0.06%	(241,335)	
31	SHS	1.14%	1.07%	-0.06%	(679,468)	
32	HSG	1.13%	1.06%	-0.06%	(464,107)	
33	VCG	1.11%	1.04%	-0.06%	(358,387)	
34	PVD	1.02%	0.96%	-0.06%	(287,556)	
35	HAG	1.02%	0.96%	-0.06%	(867,163)	
36	DCM	0.93%	0.88%	-0.05%	(263,359)	
37	HUT	0.88%	0.83%	-0.05%	(332,898)	
38	TCH	0.83%	0.78%	-0.05%	(638,160)	
39	KDH	0.83%	0.78%	-0.05%	(185,414)	
40	HDG	0.77%	0.73%	-0.04%	(146,021)	
41	DXG	0.73%	0.69%	-0.04%	(339,885)	
42	HNG	0.59%	0.56%	-0.03%	(1,058,535)	

Nguồn: Bloomberg PHS

3. CHỈ SỐ FTSE VIETNAM 30 INDEX

Với FTSE Vietnam 30 Index, chỉ số này chỉ thay đổi danh mục định kỳ trong các đợt review tháng 3 và tháng 9 hàng năm.

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 trừ trách nhiệm

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

Fax: (+84-28) 5 413 5472

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

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

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

Web: www.phs.vn

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 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 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 Hà Nội

Tầng 5, Tòa nhà Vinafor,

127 Lò Đúc, Phường Đồng Mác, Quận Hai

Bà Trưng, Hà Nội

Điện thoại: (+84-24) 3 933 4566

Fax: (+84-24) 3 933 4820

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 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 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