

Cơ cấu danh mục tháng 1/2022

VN30 Index

31/12/2021

Trong kỳ cơ cấu danh mục tháng 1/2022, SAB và PNJ sẽ bị loại khỏi danh mục chỉ số VN30 Index do không đạt tỷ lệ yêu cầu về thanh khoản, SHB và SSB được dự kiến sẽ thay thế hai mã trên. Cụ thể, giá trị giao dịch khớp lệnh của PNJ và SAB chỉ đạt lần lượt 51 tỷ đồng và 23.4 tỷ đồng trong năm 2021, rơi khỏi top 50 cổ phiếu có giá trị giao dịch nhiều nhất trong rổ VNALLSHARE. SHB và SSB đã vượt qua các ngân hàng khác như OCB, MSB, LPB,... để lọt vào vị trí thứ 22 và 23 trong danh sách 50 cổ phiếu có vốn hoá lớn nhất thị trường.

Tác động dự kiến trong kì review tháng 1:

Cổ phiếu được mua vào đáng kể: SSI, POW, FPT, VJC, MWG

Cổ phiếu bị bán ra đáng kể: VPB, ACB, TCB, STB, MBB

VN30 sẽ công bố cơ cấu danh mục quý 1 của chỉ số vào ngày 17/1/2022 và hoàn thành cơ cấu lại danh mục vào ngày 07/02/2021. Chúng tôi ước tính dòng tiền tác động lên cổ phiếu dựa trên giá trị tài sản NAV của 3 quỹ ETF DCVFMVN30, MAFM VN30 và SSIAM VN30 là 509 triệu USD.

Bảng 1. Dự báo danh mục cổ phiếu thành phần chỉ số VN30 Index kì tháng 1/2022 (% , tỷ đồng, cổ phiếu, số ngày)

| | Mã cổ phiếu | Thêm/ Loại | Tỷ trọng hiện tại (%) | Tỷ trọng mới (%) | Thay đổi tỷ trọng (%) | Dự báo dòng tiền (tỷ đồng) | Dự báo số lượng cổ phiếu (cổ phiếu) | Số ngày giao dịch (TB phiên) |
|----|--------------------|-----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|---|--|--|
| 1 | SSI | | 2.47% | 9.04% | 6.57% | 764.01 | 14,524,920 | 0.78 |
| 2 | POW | | 0.55% | 1.59% | 1.04% | 120.80 | 6,922,613 | 0.22 |
| 3 | FPT | | 5.13% | 10.00% | 4.87% | 566.22 | 6,049,377 | 3.56 |
| 4 | HPG | | 7.87% | 10.00% | 2.13% | 247.65 | 5,419,022 | 0.28 |
| 5 | BVH | | 0.22% | 2.78% | 2.56% | 298.02 | 5,408,623 | 5.82 |
| 6 | SHB | Thêm | 0.00% | 0.95% | 0.95% | 110.17 | 5,124,073 | 0.39 |
| 7 | MWG | | 4.21% | 10.00% | 5.79% | 673.19 | 5,012,566 | 4.08 |
| 8 | VJC | | 2.47% | 7.30% | 4.83% | 561.24 | 4,454,254 | 5.55 |
| 9 | SSB | Thêm | 0.00% | 0.98% | 0.98% | 113.76 | 2,525,098 | 1.12 |
| 10 | GVR | | 0.43% | 1.15% | 0.72% | 83.82 | 2,265,448 | 0.73 |
| 11 | PLX | | 0.42% | 1.33% | 0.91% | 106.26 | 1,967,763 | 1.63 |
| 12 | MSN | | 6.04% | 8.90% | 2.86% | 332.85 | 1,940,845 | 0.49 |
| 13 | VNM | | 5.01% | 6.10% | 1.09% | 126.40 | 1,481,839 | 0.73 |
| 14 | GAS | | 0.76% | 1.80% | 1.04% | 121.46 | 1,252,199 | 1.41 |
| 15 | BID | | 0.55% | 0.66% | 0.11% | 12.51 | 353,441 | 0.20 |
| 16 | KDH | | 1.63% | 1.46% | -0.17% | (20.20) | (387,665) | 0.17 |
| 17 | PDR | | 1.48% | 0.90% | -0.58% | (67.57) | (715,800) | 0.15 |
| 18 | VRE | | 1.55% | 1.17% | -0.38% | (43.98) | (1,441,906) | 0.19 |
| 19 | VCB | | 2.76% | 1.70% | -1.06% | (122.87) | (1,567,256) | 1.35 |
| 20 | NVL | | 4.06% | 2.82% | -1.24% | (144.56) | (1,675,130) | 0.37 |
| 21 | CTG | | 1.72% | 1.04% | -0.68% | (78.61) | (2,325,690) | 0.28 |
| 22 | VHM | | 6.07% | 4.29% | -1.78% | (206.85) | (2,534,875) | 0.30 |
| 23 | VIC | | 7.44% | 4.37% | -3.07% | (357.46) | (3,762,695) | 1.07 |
| 24 | TPB | | 2.87% | 0.65% | -2.22% | (258.00) | (6,331,382) | 1.03 |
| 25 | HDB | | 3.00% | 0.78% | -2.22% | (257.70) | (8,421,585) | 1.38 |
| 26 | STB | | 3.82% | 1.06% | -2.76% | (321.39) | (10,537,320) | 0.65 |
| 27 | MBB | | 4.23% | 1.18% | -3.05% | (354.12) | (12,447,116) | 1.48 |
| 28 | TCB | | 7.92% | 2.54% | -5.38% | (625.22) | (12,681,970) | 1.22 |
| 29 | ACB | | 5.58% | 1.43% | -4.15% | (482.56) | (14,234,751) | 3.07 |
| 30 | VPB | | 7.21% | 2.02% | -5.19% | (603.11) | (17,037,087) | 0.95 |
| 31 | SAB | Loại | 0.58% | 0.00% | -0.58% | (67.44) | (452,888) | 2.41 |
| 32 | PNJ | Loại | 1.09% | 0.00% | -1.09% | (126.73) | (1,370,069) | 2.02 |

Lưu ý: Đây chỉ là danh mục dự kiến theo kịch bản nhiều khả năng xảy ra nhất và được ước tính dựa trên mức giá đóng cửa ngày 30/12/2021. Số ngày giao dịch được tính dựa trên giá trị giao dịch khớp lệnh trung bình 20 phiên giao dịch gần nhất của cổ phiếu.

Nguồn: HOSE, KB Securities Vietnam

KHỐI PHÂN TÍCH CÔNG TY CHỨNG KHOÁN KB VIỆT NAM

Nguyễn Xuân Bình
Giám đốc Khối Phân tích
binhnx@kbsec.com.vn

Phân tích Doanh nghiệp

Dương Đức Hiếu
Giám đốc Phân tích Doanh nghiệp
hieudd@kbsec.com.vn

Nguyễn Anh Tùng
Chuyên viên cao cấp – Tài chính & Công nghệ
tungna@kbsec.com.vn

Phạm Hoàng Bảo Nga
Chuyên viên cao cấp – Bất động sản nhà ở
ngaphb@kbsec.com.vn

Lê Anh Tùng
Chuyên viên cao cấp – Dầu Khí & Ngân hàng
tungla@kbsec.com.vn

Nguyễn Ngọc Hiếu
Chuyên viên phân tích – Năng lượng & Vật liệu xây dựng
hieunn@kbsec.com.vn

Phạm Nhật Anh
Chuyên viên phân tích – Bất động sản công nghiệp & Logistics
anhpn@kbsec.com.vn

Lương Ngọc Tuấn Dũng
Chuyên viên phân tích – Bán lẻ & Hàng tiêu dùng
dunglnt@kbsec.com.vn

Khối Phân tích
research@kbsec.com.vn

Phân tích Vĩ mô & Chiến lược đầu tư

Trần Đức Anh
Giám đốc Vĩ mô & Chiến lược Đầu tư
anhtd@kbsec.com.vn

Lê Hạnh Quyên
Chuyên viên phân tích – Vĩ mô & Ngân hàng
quyenlh@kbsec.com.vn

Thái Hữu Công
Chuyên viên phân tích – Chiến lược, Mid cap & Semi bluechips
congth@kbsec.com.vn

Trần Thị Phương Anh
Chuyên viên phân tích – Chiến lược, Mid cap & Semi bluechips
anhhttp@kbsec.com.vn

Bộ phận Hỗ trợ

Nguyễn Cẩm Thơ
Chuyên viên hỗ trợ
thonc@kbsec.com.vn

Nguyễn Thị Hương
Chuyên viên hỗ trợ
huongnt3@kbsec.com.vn

CTCP CHỨNG KHOÁN KB VIỆT NAM (KBSV)

Trụ sở chính:

Địa chỉ: Tầng G, tầng M, tầng 2 và 7, Tòa nhà Sky City số 88 Láng Hạ, Đống Đa, Hà Nội
Điện thoại: (+84) 24 7303 5333 - Fax: (+84) 24 3776 5928

Chi nhánh Hà Nội:

Địa chỉ: Tầng 1, Tòa nhà VP, số 5 Điện Biên Phủ, Quận Ba Đình, Hà Nội
Điện thoại: (+84) 24 7305 3335 - Fax: (+84) 24 3822 3131

Chi nhánh Hồ Chí Minh:

Địa chỉ: Tầng 2, TNR Tower Nguyễn Công Trứ, 180-192 Nguyễn Trứ, Q1, TP Hồ Chí Minh
Điện thoại: (+84) 28 7303 5333 - Fax: (+84) 28 3914 1969

Chi nhánh Sài Gòn:

Địa chỉ: Tầng 1, Saigon Trade Center, 37 Tôn Đức Thắng, Phường Bến Nghé, Q1, Hồ Chí Minh
Điện thoại: (+84) 28 7306 3338 - Fax: (+84) 28 3910 1611

LIÊN HỆ

Trung Tâm Khách hàng Tổ chức: (+84) 28 7303 5333 – Ext: 2656

Trung Tâm Khách hàng Cá nhân: (+84) 24 7303 5333 – Ext: 2276

Email: ccc@kbsec.com.vn

Website: www.kbsec.com.vn

Hệ thống khuyến nghị

Hệ thống khuyến nghị đầu tư cổ phiếu

(dựa trên kỳ vọng tăng giá tuyệt đối trong 6 tháng tới)

| Mua: | Năm giữ: | Bán: |
|-------------------|---------------------------|--------------------|
| +15% hoặc cao hơn | trong khoảng +15% và -15% | -15% hoặc thấp hơn |

Hệ thống khuyến nghị đầu tư ngành

(dựa trên kỳ vọng tăng giá tuyệt đối trong 6 tháng tới)

| Khả quan: | Trung lập: | Kém khả quan: |
|--------------------------|--------------------|--------------------|
| Vượt trội hơn thị trường | Phù hợp thị trường | Kém hơn thị trường |

Ý kiến trong báo cáo này phản ánh đánh giá chuyên môn của (các) chuyên viên phân tích kể từ ngày phát hành và dựa trên thông tin và dữ liệu thu được từ các nguồn mà KBSV cho là đáng tin cậy. KBSV không tuyên bố rằng thông tin và dữ liệu là chính xác hoặc đầy đủ và các quan điểm được trình bày trong báo cáo này có thể thay đổi mà không cần thông báo trước. Khách hàng nên đọc lập xem xét các trường hợp và mục tiêu cụ thể của riêng mình và tự chịu trách nhiệm về các quyết định đầu tư của mình và chúng tôi sẽ không có trách nhiệm đối với các khoản đầu tư hoặc kết quả của chúng. Những tài liệu này là bản quyền của KBSV và không được sao chép, phân phối lại hoặc sửa đổi mà không có sự đồng ý trước bằng văn bản của KBSV. Nhận xét và quan điểm trong báo cáo này có tính chất chung và chỉ nhằm mục đích tham khảo và không được phép sử dụng cho bất kỳ mục đích nào khác.