

DỰ BÁO THAY ĐỔI CỦA CHỈ SỐ VN30, VNFINLEAD KỲ THÁNG 01/2025

- Thời gian thực hiện:**

- Ngày chốt dữ liệu: 31/12/2024
- Ngày công bố thông tin: 20/01/2025
- Ngày danh mục mới có hiệu lực: 03/02/2025

→ Chỉ số VN30

- Trong kỳ review lần này, theo tính toán của BVSC, cổ phiếu **LPB** **hiều khả năng sẽ được thêm vào** rổ chỉ số VN30 trong kỳ 1/2025 do cổ phiếu này đã đáp ứng đủ các điều kiện về thanh khoản, tỷ lệ cổ phiếu chuyển nhượng tự do và vốn hóa lọt top 20 cổ phiếu có vốn hóa trung bình lớn nhất sàn HOSE.
- Ở chiều ngược lại, BVSC cho rằng cổ phiếu **POW** **hiều khả năng sẽ là cổ phiếu bị loại ra** khỏi rổ chỉ số VN30 do vốn hóa trung bình của cổ phiếu này đang thấp nhất trong rổ VN30.

→ Dự báo tỷ trọng danh mục mới của quỹ ETF sử dụng chỉ số VN30 làm chỉ số tham chiếu

- Hiện tại có 4 quỹ ETF đang xây dựng danh mục dựa trên chỉ số tham chiếu VN30 là: quỹ DCVFMVN30, quỹ SSIAM VN30, quỹ MAFM VN30 và quỹ KIM GROWTH VN30. Trong đó, quỹ DCVFMVN30 ETF có giá trị tài sản ròng lớn nhất, khoảng 6,8 nghìn tỷ đồng. Ước tính theo dữ liệu ngày 31/12/2024, quỹ DCVFMVN30 ETF sẽ mua vào 12,5 triệu cổ phiếu LPB trong kỳ thực hiện cơ cấu danh mục lần này, chiếm khoảng 5,9% tỷ trọng danh mục. Đồng thời, quỹ sẽ bán ra toàn bộ số lượng cổ phiếu POW đang nắm giữ là 2,8 triệu cổ phiếu.
- Các quỹ ETFs này sẽ phải hoàn tất việc tái cơ cấu danh mục của mình trước ngày 03/02/2025.
- Dưới đây là dự báo khối lượng và giá trị mua bán các cổ phiếu của DCVFMVN30 ETF dựa trên dữ liệu giá đóng cửa phiên giao dịch ngày 31/12/2024:

Cổ phiếu	Tên công ty	Giá	Tỷ trọng trước review	Tỷ trọng sau review	Thay đổi	Khối lượng mua/bán	Giá trị mua/bán
FPT	FPT Corp	152,500	9.88%	10.00%	0.12%	52,626	8,025,478,065
TCB	Techcombank	24,650	8.05%	7.92%	-0.13%	(348,018)	(8,578,644,143)
ACB	ACB	25,800	7.47%	7.26%	-0.21%	(548,916)	(14,162,043,379)
HPG	Hòa Phát	26,650	7.03%	6.56%	-0.47%	(1,176,896)	(31,364,274,099)
LPB	LPBank	31,250	0.00%	5.88%	5.88%	12,583,373	393,230,405,420
VPB	VPBank	19,200	7.10%	5.86%	-1.24%	(4,307,939)	(82,712,438,288)
MBB	MBBank	25,100	5.34%	5.13%	-0.21%	(569,001)	(14,281,932,843)
MWG	Thế giới di động	61,000	5.64%	4.99%	-0.65%	(711,384)	(43,394,453,469)
STB	Sacombank	36,900	4.65%	4.87%	0.22%	395,589	14,597,227,128
HDB	HDBank	25,500	4.25%	4.68%	0.43%	1,122,026	28,611,665,948
VHM	Vinhomes	40,000	4.23%	4.02%	-0.21%	(344,040)	(13,761,595,656)

VCB	Vietcombank	91,200	4.36%	3.92%	-0.44%	(319,819)	(29,167,475,305)
VNM	VINAMILK	63,400	4.05%	3.71%	-0.34%	(359,567)	(22,796,546,695)
VIC	VinGroup	40,550	3.39%	3.26%	-0.13%	(222,319)	(9,015,025,335)
MSN	Tập đoàn Masan	70,000	3.69%	3.17%	-0.52%	(496,097)	(34,726,785,878)
SSI	Chứng khoán SSI	26,050	2.54%	2.50%	-0.04%	(93,477)	(2,435,075,950)
SHB	SHB	10,250	2.43%	2.23%	-0.20%	(1,285,115)	(13,172,426,361)
SSB	SeABank	16,750	2.15%	2.16%	0.01%	40,208	673,486,818
CTG	VietinBank	37,800	2.09%	2.13%	0.04%	72,192	2,728,869,130
VJC	Vietjet Air	100,000	2.23%	2.08%	-0.15%	(97,196)	(9,719,600,615)
VIB	VIBBank	19,700	1.81%	2.05%	0.24%	826,929	16,290,503,473
TPB	TPBank	16,650	1.70%	1.54%	-0.16%	(645,874)	(10,753,799,133)
VRE	Vincom Retail	17,150	1.25%	1.09%	-0.16%	(620,483)	(10,641,286,037)
BID	BIDV	37,550	0.82%	0.73%	-0.09%	(169,168)	(6,352,248,878)
GAS	PV Gas	68,100	0.61%	0.56%	-0.05%	(50,839)	(3,462,132,297)
SAB	SABECO	55,500	0.48%	0.55%	0.07%	81,897	4,545,259,965
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	30,350	0.42%	0.34%	-0.08%	(176,656)	(5,361,499,581)
PLX	Petrolimex	37,500	0.36%	0.33%	-0.03%	(47,359)	(1,775,976,781)
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	50,700	0.19%	0.26%	0.07%	96,800	4,907,765,812
BCM	Becamex IDC	70,900	0.28%	0.21%	-0.07%	(70,355)	(4,988,135,389)
POW	Điện lực Dầu khí VN	12,000	0.51%	0.00%	-0.51%	(2,842,357)	(34,108,281,774)

➔ Chỉ số VNFINLEAD

- Trong kỳ cơ cấu lần này, theo tính toán của BVSC, nhiều khả năng sẽ **không có cổ phiếu nào bị loại ra cũng như thêm mới** vào rổ chỉ số VNFINLEAD.

➔ Dự báo tỷ trọng danh mục mới của quỹ ETF sử dụng chỉ số VNFINLEAD làm chỉ số tham chiếu

- Hiện nay, quỹ ETF SSIAM VNFINLEAD đang xây dựng danh mục dựa trên chỉ số tham chiếu VNFINLEAD. Quỹ ETF SSIAM VNFINLEAD đang có giá trị tài sản ròng 480 tỷ đồng.
- Quỹ ETF này sẽ phải hoàn tất việc tái cơ cấu danh mục của mình trước ngày 03/02/2025.
- Dưới đây là dự báo khối lượng và giá trị mua bán các cổ phiếu của ETF SSIAM VNFINLEAD dựa trên dữ liệu giá đóng cửa phiên giao dịch ngày 31/12/2024:

BẢN TIN ETFs

Ngày 02 tháng 01 năm 2025

Cổ phiếu	Tên công ty	Giá	Tỷ trọng trước review	Tỷ trọng sau review	Thay đổi	Khối lượng mua/bán	Giá trị mua/bán
TCB	Techcombank	24,650	15.17%	15.00%	-0.17%	(32,635)	(804,458,394)
VPB	VPBank	19,200	10.68%	11.33%	0.65%	160,485	3,081,305,041
MBB	MBBank	25,100	10.53%	10.92%	0.39%	73,998	1,857,347,001
STB	Sacombank	36,900	10.93%	10.48%	-0.45%	(57,388)	(2,117,600,639)
ACB	ACB	25,800	8.70%	9.47%	0.77%	140,429	3,623,070,034
LPB	LPBank	31,250	6.41%	7.08%	0.67%	100,861	3,151,901,830
SSI	Chứng khoán SSI	26,050	8.08%	6.62%	-1.46%	(265,570)	(6,918,095,357)
HDB	HDBank	25,500	5.46%	5.88%	0.42%	78,143	1,992,640,446
EIB	Eximbank	19,300	3.34%	3.16%	-0.18%	(44,749)	(863,663,259)
SHB	SHB	10,250	3.18%	3.05%	-0.13%	(60,678)	(621,953,731)
VCB	Vietcombank	91,200	2.49%	2.93%	0.44%	22,627	2,063,616,171
CTG	VietinBank	37,800	2.41%	2.75%	0.34%	42,146	1,593,123,760
VIX	Chứng khoán VIX	9,850	2.02%	1.59%	-0.43%	(206,502)	(2,034,048,273)
VND	Chứng khoán VNDIRECT	12,600	2.07%	1.51%	-0.56%	(209,285)	(2,636,985,286)
TPB	TPBank	16,650	1.29%	1.50%	0.21%	59,005	982,435,098
VIB	VIBBank	19,700	1.17%	1.48%	0.31%	75,187	1,481,185,407
VCI	Chứng khoán Vietcap	33,200	1.21%	1.47%	0.26%	36,495	1,211,623,623
MSB	MSB Bank	11,650	1.38%	1.45%	0.07%	26,976	314,274,784
HCM	Chứng khoán HSC	29,400	0.67%	0.81%	0.14%	22,138	650,845,819
SSB	SeABank	16,750	0.69%	0.71%	0.02%	4,406	73,803,365
BID	BIDV	37,550	0.17%	0.37%	0.20%	24,611	924,134,056
NAB	Ngân hàng Nam Á	15,950	0.29%	0.25%	-0.04%	(13,133)	(209,476,059)
OCB	Ngân hàng Phương Đông	11,400	0.16%	0.22%	0.06%	26,591	303,136,867



KHUYẾN CÁO SỬ DỤNG

Tất cả những thông tin nêu trong báo cáo phân tích này đã được xem xét cẩn trọng, tuy nhiên báo cáo chỉ nhằm mục tiêu cung cấp thông tin mà không hàm ý khuyến cáo người đọc mua, bán hay nắm giữ chứng khoán. Người đọc chỉ nên sử dụng báo cáo phân tích này như một nguồn thông tin tham khảo. Mọi quan điểm cũng như nhận định phân tích trong báo cáo cũng có thể được thay đổi mà không cần báo trước. Công ty Cổ phần Chứng khoán Bảo Việt (BVSC) có thể có những hoạt động hợp tác kinh doanh với các đối tượng được đề cập đến trong báo cáo. Người đọc cần lưu ý rằng BVSC có thể có những xung đột lợi ích đối với các nhà đầu tư khi thực hiện báo cáo phân tích này.

Báo cáo này có bản quyền và là tài sản của BVSC. Mọi hành vi sao chép, sửa đổi, in ấn mà không có sự đồng ý của BVSC đều trái luật. Bản quyền thuộc Công ty Cổ phần Chứng khoán Bảo Việt.