

BẢN TIN ETF

Dự báo thay đổi danh mục VN30 và VNFIN LEAD kỳ Q3/2023

Trần Quang Huy, ACCA - Chuyên viên

Email: huy.tranquang@abs.vn

Chúng tôi thực hiện dự báo thay đổi danh mục VN30 và VNFIN LEAD kỳ Q3/2023 như sau:

- Trong kỳ này, hai chỉ số VN30 và VNFIN LEAD sẽ thực hiện cập nhật/thay đổi với các cổ phiếu thành phần. Trong khi đó, các chỉ số như VNDiamond, VNFIN Select... sẽ cập nhật số liệu, cập nhật thay đổi tỉ trọng danh mục.
- Một số mốc thời gian cần chú ý:** ngày chốt dữ liệu là 30/6/2023, ngày công bố danh mục là 17/7/2023, ngày chỉ số mới có hiệu lực là 07/8/2023.
- Dựa theo số liệu cập nhật đến hết ngày 29/6/2023**, ABS Research dự báo về việc thay đổi danh mục các chỉ số như sau:

1) Với chỉ số VNFIN LEAD: Chúng tôi dự báo **SSB** (do không đạt điều kiện về thanh khoản) và **BVH** (do không đáp ứng về điều kiện vốn hóa) có thể bị loại khỏi rổ chỉ số. Chiều ngược lại, chúng tôi dự báo không có cổ phiếu thêm mới vào rổ chỉ số trong đợt điều chỉnh này.

STT	Cổ phiếu	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Chg (+/-)	SLCP mua bán	KLGD trung bình 20 phiên	Số phiên GD tương đương
1	VPB	13,56%	14,83%	-1,27%	(2.716.233)	20.932.334	0,13
2	TCB	10,83%	14,99%	-4,16%	(5.436.524)	8.659.377	0,63
3	ACB	10,49%	7,15%	3,34%	6.490.691	10.375.436	0,63
4	STB	8,08%	14,95%	-6,87%	(9.909.882)	17.728.761	0,56
5	VCB	7,69%	3,63%	4,06%	1.699.281	1.036.731	1,64
6	MBB	7,34%	11,04%	-3,70%	(7.765.221)	14.208.252	0,55
7	HDB	4,69%	2,03%	2,66%	6.167.368	6.405.498	0,96
8	SHB	4,48%	4,39%	0,09%	315.364	31.977.471	0,01
9	SSI	3,87%	6,44%	-2,57%	(4.298.501)	21.353.367	0,20
10	EIB	4,04%	1,58%	2,46%	4.999.990	14.464.875	0,35
11	VIB	3,62%	1,28%	2,34%	5.053.926	8.303.167	0,61
12	TPB	3,47%	2,32%	1,15%	2.701.774	7.747.399	0,35
13	LPB	3,23%	2,23%	1,00%	2.810.678	8.159.828	0,34
14	MSB	3,14%	1,32%	1,82%	6.094.786	8.773.582	0,69
15	CTG	3,13%	2,90%	0,23%	321.805	7.622.127	0,04
16	VND	2,49%	3,88%	-1,39%	(3.150.475)	35.826.924	0,09
17	OCB	2,01%	0,37%	1,64%	3.797.364	1.959.919	1,94
18	VCI	1,61%	1,14%	0,47%	554.381	5.340.433	0,10
19	BID	1,31%	0,54%	0,77%	733.424	1.300.093	0,56
20	HCM	0,93%	0,55%	0,38%	575.777	7.067.747	0,08
	SSB	0,00%	2,23%	-2,23%	(3.500.534)	3.255.667	1,08
	BVH	0,00%	0,18%	-0,18%	(173.168)	973.937	0,18

2) Với chỉ số VN30: Chúng tôi dự báo **NVL** (do rơi vào diện cảnh báo) và **PDR** (do không đáp ứng về điều kiện vốn hóa) có thể bị loại khỏi rổ chỉ số. Chiều ngược lại, **SSB** và **SHB** là hai cổ phiếu có cơ hội được thêm vào rổ chỉ số này. Các cổ phiếu dự phòng có thể sẽ bao gồm: EIB, PNJ, REE, DGC, MSB (trong đó EIB đang sát nút SHB để đủ điều kiện vào rổ VN30).

STT	Cổ phiếu	Tỷ trọng mới	Tỷ trọng cũ	Chg (+/-)	SLCP mua bán	KLGD trung bình 20 phiên	Số phiên GD tương đương
1	VPB	8,13%	8,84%	-0,71%	(3.241.562)	20.955.967	0,15
2	FPT	7,06%	7,31%	-0,25%	(260.922)	1.322.824	0,20
3	TCB	6,49%	6,23%	0,26%	738.138	8.870.100	0,08
4	ACB	6,29%	6,96%	-0,67%	(2.800.848)	10.466.862	0,27
5	VIC	5,16%	5,07%	0,09%	151.603	3.119.645	0,05
6	HPG	7,18%	6,28%	0,90%	3.183.790	25.230.829	0,13
7	VNM	5,23%	6,44%	-1,21%	(1.541.299)	5.000.684	0,31
8	MSN	4,20%	5,90%	-1,70%	(2.060.101)	2.727.387	0,76
9	VHM	5,21%	5,42%	-0,21%	(352.047)	3.987.547	0,09
10	MWG	4,08%	4,46%	-0,38%	(823.270)	4.880.872	0,17
11	MBB	4,40%	4,47%	-0,07%	(299.025)	13.772.927	0,02
12	SSB	4,35%	0,00%	4,35%	14.647.011	3.113.001	4,71
13	STB	4,85%	4,66%	0,19%	576.227	17.636.888	0,03
14	VCB	4,61%	4,41%	0,20%	183.699	1.044.180	0,18
15	HDB	2,81%	2,89%	-0,08%	(396.134)	6.532.049	0,06
16	VJC	2,22%	2,82%	-0,60%	(586.518)	1.062.871	0,55
17	SHB	2,69%	0,00%	2,69%	19.527.833	32.770.393	0,60
18	VRE	2,13%	2,51%	-0,38%	(1.271.258)	4.062.614	0,31
19	VIB	2,17%	2,28%	-0,11%	(497.168)	8.497.368	0,06
20	TPB	2,08%	2,02%	0,06%	302.959	7.004.404	0,04
21	SSI	2,32%	1,96%	0,36%	1.306.015	21.602.137	0,06
22	CTG	1,87%	2,10%	-0,23%	(688.542)	7.559.132	0,09
23	SAB	0,95%	1,29%	-0,34%	(204.964)	170.215	1,20
24	GAS	0,79%	0,96%	-0,17%	(166.809)	653.289	0,26
25	BID	0,78%	0,88%	-0,10%	(198.856)	1.203.301	0,17
26	POW	0,69%	0,67%	0,02%	135.772	7.071.683	0,02
27	PLX	0,41%	0,45%	-0,04%	(86.644)	744.691	0,12
28	BVH	0,29%	0,35%	-0,06%	(132.038)	987.191	0,13
29	BCM	0,29%	0,33%	-0,04%	(51.716)	334.911	0,15
30	GVR	0,27%	0,24%	0,03%	120.784	3.798.619	0,03
	NVL	0,00%	1,42%	-1,42%	(8.661.419)	40.417.162	0,21
	PDR	0,00%	0,40%	-0,40%	(2.218.033)	15.887.616	0,14

- Tổng khối lượng giao dịch ảnh hưởng từ việc cập nhật 2 rõ chỉ số dự kiến như sau:

STT	Cổ phiếu	VN30	VNFIN LEAD	Tổng SLCP giao dịch dự kiến
1	SHB	19.527.833	315.364	19.843.197
2	SSB	14.647.011	(3.500.534)	11.146.478
3	MSB	-	6.094.786	6.094.786
4	HDB	(396.134)	6.167.368	5.771.234
5	EIB	-	4.999.990	4.999.990
6	VIB	(497.168)	5.053.926	4.556.758
7	OCB	-	3.797.364	3.797.364
8	ACB	(2.800.848)	6.490.691	3.689.843
9	HPG	3.183.790	-	3.183.790
10	TPB	302.959	2.701.774	3.004.733
11	LPB	-	2.810.678	2.810.678
12	VCB	183.699	1.699.281	1.882.980
13	HCM	-	575.777	575.777
14	VCI	-	554.381	554.381
15	BID	(198.856)	733.424	534.568
16	VIC	151.603	-	151.603
17	POW	135.772	-	135.772
18	GVR	120.784	-	120.784
19	BCM	(51.716)	-	(51.716)
20	PLX	(86.644)	-	(86.644)
21	GAS	(166.809)	-	(166.809)
22	SAB	(204.964)	-	(204.964)
23	FPT	(260.922)	-	(260.922)
24	BVH	(132.038)	(173.168)	(305.206)
25	VHM	(352.047)	-	(352.047)
26	CTG	(688.542)	321.805	(366.737)
27	VJC	(586.518)	-	(586.518)
28	MWG	(823.270)	-	(823.270)
29	VRE	(1.271.258)	-	(1.271.258)
30	VNM	(1.541.299)	-	(1.541.299)
31	MSN	(2.060.101)	-	(2.060.101)
32	PDR	(2.218.033)	-	(2.218.033)
33	SSI	1.306.015	(4.298.501)	(2.992.486)
34	VND	-	(3.150.475)	(3.150.475)
35	TCB	738.138	(5.436.524)	(4.698.387)
36	VPB	(3.241.562)	(2.716.233)	(5.957.795)
37	MBB	(299.025)	(7.765.221)	(8.064.247)
38	NVL	(8.661.419)	-	(8.661.419)
39	STB	576.227	(9.909.882)	(9.333.656)

KHUYẾN CÁO

Báo cáo này được viết và phát hành bởi Phòng Phân tích Đầu tư - Công ty Cổ phần Chứng khoán An Bình (ABS). Thông tin trình bày trong báo cáo dựa trên các nguồn được cho là đáng tin cậy vào thời điểm công bố. Các nguồn tin này bao gồm thông tin trên sàn giao dịch chứng khoán hoặc trên thị trường nơi cổ phiếu được phân tích niêm yết, thông tin trên báo cáo được công bố của công ty, thông tin được công bố rộng rãi khác và các thông tin theo nghiên cứu của chúng tôi.

Báo cáo này chỉ nhằm mục đích cung cấp thông tin cho các nhà đầu tư của ABS tham khảo và không mang tính chất mời chào mua hay bán bất kỳ chứng khoán nào được thảo luận trong báo cáo. Các nhà đầu tư nên có các nhận định độc lập về thông tin trong báo cáo, xem xét các mục tiêu đầu tư cá nhân, tình hình tài chính và nhu cầu đầu tư của mình, tham khảo ý kiến tư vấn từ các chuyên gia về các vấn đề quy phạm pháp luật, tài chính, thuế và các khía cạnh khác trước khi tham gia vào bất kỳ giao dịch nào với cổ phiếu của (các) công ty được đề cập trong báo cáo. ABS sẽ không chịu trách nhiệm đối với bất kỳ tổn thất tài chính nào hoặc bất kỳ quyết định nào được thực hiện trên cơ sở thông tin được trình bày trong báo cáo này. Bản báo cáo này là sản phẩm thuộc sở hữu của ABS, người sử dụng không được phép sao chép, chuyển giao, sửa đổi, đăng tải lên các phương tiện truyền thông mà không có sự đồng ý bằng văn bản của ABS.

Thông tin liên hệ

Công ty Cổ phần Chứng khoán An Bình

Trụ sở chính: Tầng 16, tòa nhà Geleximco, 36 Hoàng Cầu, Đống Đa, Hà Nội

Điện thoại: (024) 3562 4626

Website: www.abs.vn

Trung tâm Phân tích

Điện thoại: (024) 3562 4626 – Ext: 151

Email: abs-research@abs.vn

Nguyễn Thị Thùy Linh - Giám đốc

Email: linh.ngthithuy@abs.vn

Trần Quang Huy, ACCA - Chuyên viên

Email: huy.tranquang@abs.vn