

Các quỹ ETF sẽ mua bán gì trong phiên hôm nay?

09:03 16/09/2022

Hôm nay, ngày 16/09 là phiên tái cơ cấu (review) danh mục đầu tư quý III của 02 quỹ ETF ngoại là Vaneck Vectors Vietnam ETF (VNM ETF) và DB x-trackers FTSE Vietnam UCITS ETF (FTSE ETF).

Theo CTCK Bảo Việt (BVSC), VNM ETF xây dựng danh mục dựa trên chỉ số MVIS Vietnam Index. FTSE ETF xây dựng danh mục dựa trên chỉ số FTSE Vietnam Index Series bao gồm FTSE Vietnam All-Share Index và FTSE Vietnam Index.

VNM ETF loại APH và CEO

Đối với những CP đã nằm trong danh mục của MVIS Vietnam Index tiêu chí đặt ra để các CP không bị loại khỏi danh mục là: tỷ lệ CP tự do chuyển nhượng dành cho NĐTNN (tỷ lệ room còn lại) phải lớn hơn 5%, quy mô vốn hóa thị trường lớn hơn 75 triệu USD, giá trị giao dịch bình quân hàng ngày trong 3 tháng gần nhất phải đạt tối thiểu 0,2 triệu USD tại ít nhất 2 trong 3 kỳ review gần nhất, giá trị giao dịch bình quân mỗi phiên trong 3 tháng gần nhất lớn hơn 0,6 triệu USD hoặc có ít nhất 200.000 CP giao dịch hàng tháng trong vòng 6 tháng gần nhất.

Nếu dựa trên tiêu chí trên thì trong kỳ review quý III này, 2 mã APH và CEO sẽ bị loại ra khỏi danh mục đầu tư của VNM ETF.



Ảnh minh họa.

Với những CP nằm ngoài danh mục của MVIS Vietnam Index, tiêu chí đặt ra để được thêm vào rõ là: tỷ lệ CP tự do chuyển nhượng dành cho NĐTNN còn lại phải lớn hơn 10%, quy mô vốn hóa thị trường lớn hơn 150 triệu USD và giá trị giao dịch bình quân mỗi phiên trong 3 tháng gần nhất lớn hơn 1 triệu USD tại kỳ xem xét và trong 2 kỳ review gần nhất.

Theo BVSC, với các tiêu chí trên, trong kỳ review lần này, mã HAG sẽ được thêm mới vào danh mục của quỹ VNM ETF.

Hiện tại tỷ trọng CP Việt Nam trong danh mục của quỹ VNM ETF đang chiếm khoảng 81,4%. Trong kỳ review lần này, tỷ trọng mới của CP Việt Nam trong danh mục ở mức tương đương 80%.

Do vậy, dự báo VNM ETF sẽ bán ra hàng loạt mã CP để giảm tỷ lệ nắm giữ về mức tỷ trọng yêu cầu là 80%. Theo đó, những mã bị bán ra với số lượng lớn gồm: VIC, HPG, STB, DGC, THD, IDC, VJC, GEX, KBC, HUT, HDG, HSG, SHS, KDC, DXG, CEO, APH

FTSE ETF không thêm CP mới

Đối với những CP đã nằm trong danh mục của FTSE Vietnam Index, tiêu chí đặt ra để các CP không bị loại khỏi danh mục là: không thuộc diện cảnh báo, kiểm soát hay kiểm soát đặc biệt; vốn hóa thị trường thuộc top bao phủ 92% thị trường; tỷ lệ CP tự do chuyển nhượng dành cho NĐTNN phải lớn hơn 15%; giá trị giao dịch bình quân hàng ngày trong 3 tháng gần nhất phải đạt tối thiểu 20%

giá trị giao dịch bình quân hàng ngày trong 3 tháng của cả danh mục và tỷ lệ đầu tư của NĐTNN còn lại tối thiểu 2%.

Theo tiêu chí kể trên, BVSC dự báo trong kỳ review lần này, 2 mã SBT và KDH sẽ bị loại ra khỏi danh mục do vi phạm tiêu chí thanh khoản.

Phía ngược lại, những CP nằm ngoài danh mục, tiêu chí đặt ra để được đưa vào rõ là: không thuộc diện cảnh báo, kiểm soát hay kiểm soát đặc biệt; vốn hóa thị trường thuộc top bao phủ 88% thị trường; tỷ lệ CP tự do chuyển nhượng dành cho NĐTNN lớn hơn 15%; giá trị giao dịch bình quân hàng ngày trong 3 tháng gần nhất phải đạt tối thiểu 40% giá trị giao dịch bình quân hàng ngày trong 3 tháng của cả danh mục; tỷ lệ đầu tư của NĐTNN còn lại tối thiểu 2%.

Với các tiêu chí trên, sẽ không có CP nào được thêm mới vào danh mục của quỹ FTSE ETF trong kỳ review lần này. Tuy nhiên, trong kỳ review quý III này, FTSE ETF sẽ giảm tỷ trọng nắm giữ tại các mã CP như: HPG, VRE, VJC, KBC, GEX, STB, SBT, KDH.

Theo saigondautu.com.vn