

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

DANH MỤC CỔ PHIẾU YS30

Danh mục cổ phiếu YS30 là danh mục được thiết kế bởi đội ngũ Phân tích của Công ty Chứng khoán Yuanta Việt Nam. Danh mục bao gồm 30 cổ phiếu trên cả 3 sàn HSX, HNX và Upcom. Điểm nổi bật của danh mục YS30 là hội tụ các cổ phiếu thỏa tiêu chí tăng trưởng theo hệ thống xếp hạng cổ phiếu Stock Rating của YSRadar được phát triển độc quyền bởi YSVN. Đồng thời, danh mục YS30 cũng đáp ứng các tiêu chí vốn hóa và thanh khoản như nhóm danh mục VN30.

Danh mục YS30 được xây dựng với mục tiêu là danh mục mẫu cho các nhà đầu tư tham khảo nhằm tăng tính tối ưu hiệu quả đầu tư với trường phái đầu tư tìm kiếm các cổ phiếu tăng trưởng và có tính thanh khoản cao.

ĐẶC ĐIỂM CHUNG

BẢNG SO SÁNH ĐẶC ĐIỂM CỦA DANH MỤC VN30 & YS30

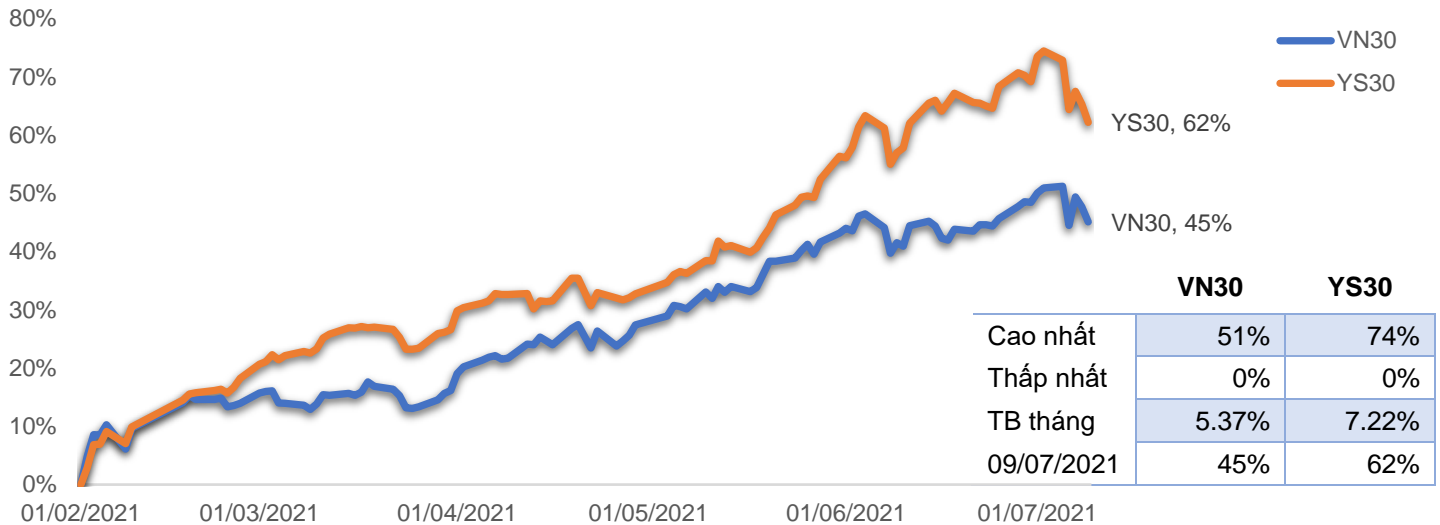
Tên chỉ số	VN30 ^(*)	YS30
Đặc điểm chung	Gồm những công ty niêm yết trên HoSE và đáp ứng các quy tắc cùng điều kiện sàng lọc	Gồm những công ty niêm yết trên 3 sàn HoSE, HNX, UPCOM và đáp ứng các quy tắc cùng điều kiện sàng lọc
Số lượng cổ phiếu	30	
Phương pháp tính	Giá trị vốn hóa điều chỉnh theo free-float	
Tiêu chí chọn lọc	Tư cách cổ phiếu, tỷ lệ free-float, thanh khoản	Tư cách cổ phiếu, tỷ lệ free-float, thanh khoản, Điểm cơ bản và Sức mạnh giá trung bình 6 tháng của YSRadar ≥ 80
Thanh Khoản	Tỷ suất xoay vòng chứng khoán $\geq 0.05\%$	
Tỷ lệ FreeFloat	$\geq 10\%$, trừ một vài trường hợp ^(*)	
Giới hạn tỷ trọng vốn hóa	10% đối với cổ phiếu đơn lẻ, 15% đối với nhóm cổ phiếu liên quan	10% đối với cổ phiếu đơn lẻ
Các kỳ xem xét	<p>Ngày chốt data: Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 12 và tháng 6</p> <p>Ngày công bố thay đổi cổ phiếu thành phần: Thứ Hai lần thứ 3 của tháng 1 và tháng 7 hàng năm</p> <p>Ngày có hiệu lực áp dụng: Thứ Hai lần thứ 1 của tháng 2, 5, 8, 11 hàng năm</p> <p>Ngày công bố cập nhật free-float, SLCPLH: Thứ Hai lần thứ 3 của tháng 1, 4, 7, 10 hàng năm</p>	<p>Ngày chốt data: Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 1, 4, 7, 10 hàng năm</p> <p>Ngày công bố thay đổi cổ phiếu thành phần: Ngày giao dịch cuối cùng +2 ngày của tháng 1, 4, 7, 10 hàng năm</p> <p>Ngày có hiệu lực áp dụng: Thứ Hai lần thứ 1 của tháng 2, 5, 8, 11 hàng năm</p>
Tần suất xem xét	Kỳ xem xét chính: 6 tháng/lần Cập nhật free-float và SLCPLH: theo quý	Kỳ xem xét chính: 3 tháng/lần

(*) Chi tiết trong Quy tắc xây dựng và quản lý Bộ chỉ số HOSE-Index – Phiên bản 3.0

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

THÔNG TIN DANH MỤC



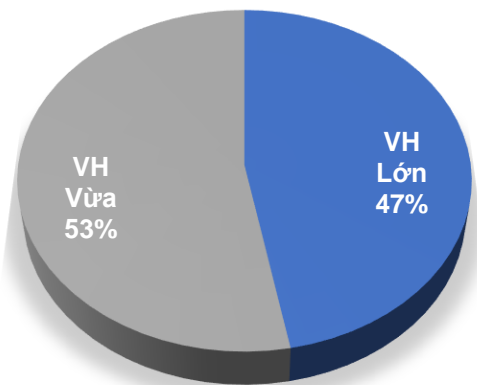
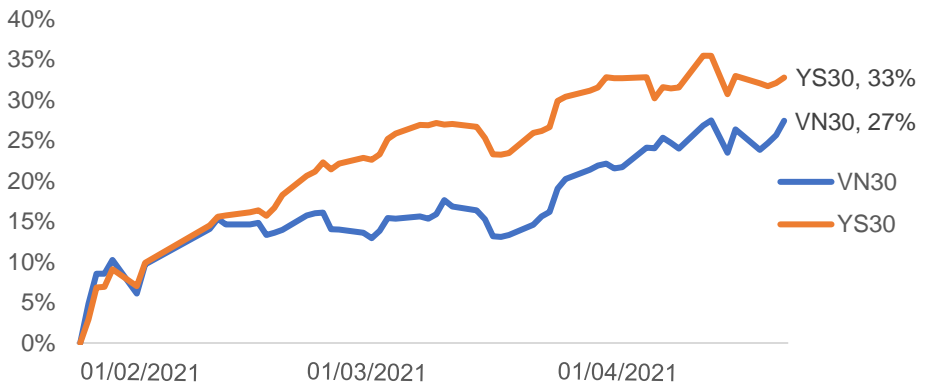
DANH MỤC YS30 – KỲ Q1/2021

Ngày chốt data: 29/01/2021

Ngày công bố: 31/01/2021

Ngày hiệu lực: 01/02/2021

	VN30	YS30
Cao nhất	27%	35%
Thấp nhất	0%	0%
TB tháng	7.12%	7.12%
29/04/2021	27%	33%



TT	Nhóm cổ phiếu	Số CP	Vốn hóa thị trường (MKC)
1	Vốn hóa lớn	5	MKC > 10.000 tỷ đồng
2	Vốn hóa vừa	25	1.000 < MKC <= 10.000 tỷ đồng
3	Vốn hóa nhỏ	-	100 < MKC <= 1.000 tỷ đồng
4	Vốn hóa siêu nhỏ	-	MKC <= 100 tỷ đồng

DANH MỤC YS30

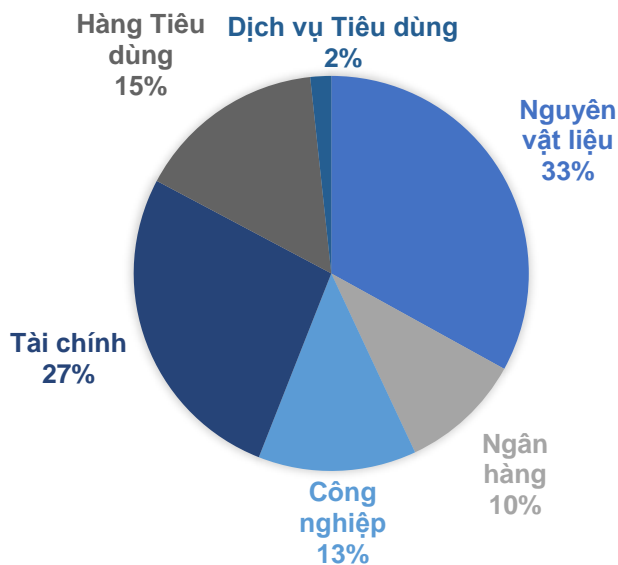
Báo cáo lần đầu_09/07/2021

CÁC CỔ PHIẾU THÀNH PHẦN (31/01/2021)

Mã CP	Sàn	Giá đóng cửa	Tỷ trọng
HPG	HOSE	28,251	10.00%
CTG	HOSE	24,793	10.00%
VCG	HOSE	43,303	10.00%
HSG	HOSE	20,000	8.62%
PDR	HOSE	44,356	8.41%
SHS	HNX	21,100	5.06%
DGC	HOSE	42,261	4.47%
DBC	HOSE	40,909	4.21%
KDC	HOSE	38,500	4.14%
VCI	HOSE	23,056	3.15%
DIG	HOSE	20,824	3.04%
DPM	HOSE	14,847	2.53%
VIX	HOSE	22,900	2.40%
TCM	HOSE	66,348	2.26%
DHC	HOSE	61,500	2.16%

Mã CP	Sàn	Giá đóng cửa	Tỷ trọng
SZC	HOSE	39,100	2.09%
DCM	HOSE	11,950	1.96%
CTR	UPCOM	57,690	1.79%
GTN	HOSE	22,300	1.75%
DGW	HOSE	70,600	1.71%
NKG	HOSE	14,450	1.61%
HDC	HOSE	27,680	1.45%
GIL	HOSE	46,325	1.41%
KSB	HOSE	22,409	1.23%
LCG	HOSE	11,400	1.17%
HHS	HOSE	5,250	0.89%
FMC	HOSE	28,350	0.87%
AGR	HOSE	9,180	0.61%
LHG	HOSE	29,800	0.56%
PLC	HNX	21,974	0.45%

CƠ CẤU CỔ PHIẾU THEO NGÀNH (31/01/2021)



Ngành	Vốn hóa (tỷ đồng)	Tỷ trọng	Số CP
Nguyên vật liệu	170,179	33%	9
Ngân hàng	113,564	10%	1
Công nghiệp	27,948	13%	3
Tài chính	56,229	27%	9
Hàng Tiêu dùng	29,664	16%	7
Dịch vụ Tiêu dùng	2,974	2%	1

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

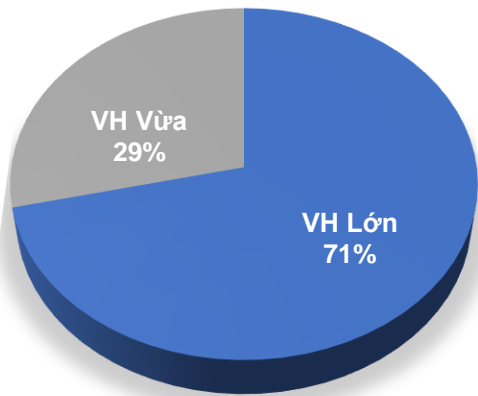
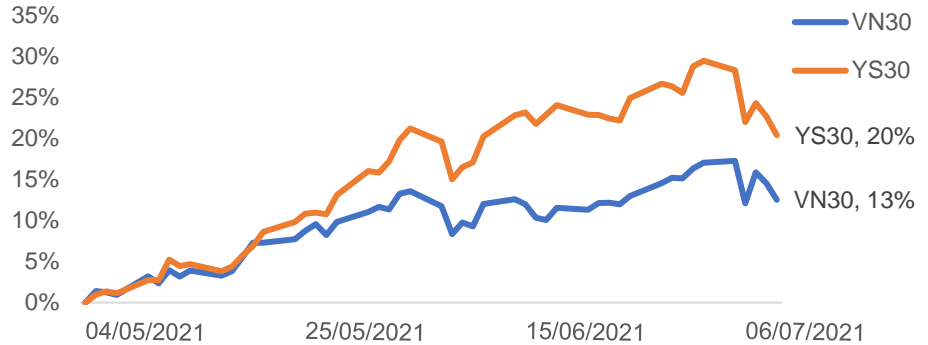
DANH MỤC YS30 – KỲ Q2/2021

Ngày chốt data: 30/04/2021

Ngày công bố: 02/05/2021

Ngày hiệu lực: 03/05/2021

	VN30	YS30
Cao nhất	17%	29%
Thấp nhất	0%	0%
TB tháng	3.22%	4.59%
09/07/2021	13%	20%



TT	Nhóm cổ phiếu	Số CP	Vốn hóa thị trường (MKC)
1	Vốn hóa lớn	13	MKC > 10.000 tỷ đồng
2	Vốn hóa vừa	17	1.000 < MKC <= 10.000 tỷ đồng
3	Vốn hóa nhỏ	-	100 < MKC <= 1.000 tỷ đồng
4	Vốn hóa siêu nhỏ	-	MKC <= 100 tỷ đồng

CÁC CỔ PHIẾU THÀNH PHẦN (29/04/2021)

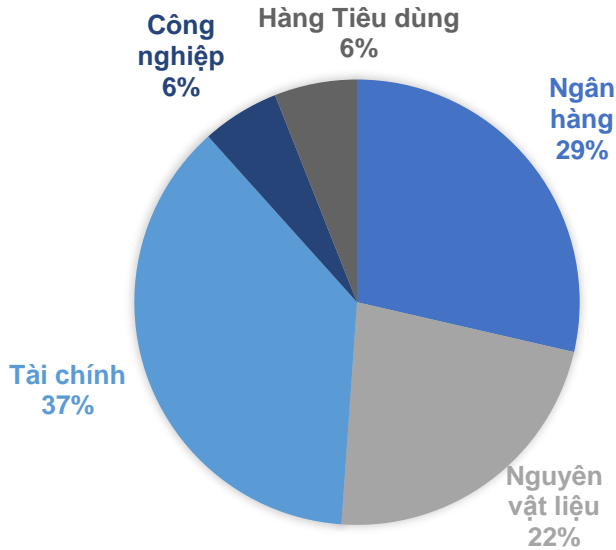
Mã CP	Sàn	Giá đóng cửa	Tỷ trọng
VPB	HOSE	58,500	10.00%
HPG	HOSE	42,799	10.00%
STB	HOSE	23,900	10.00%
PDR	HOSE	70,200	7.00%
SSI	HOSE	31,985	6.17%
KBC	HOSE	37,450	5.86%
HSG	HOSE	28,864	5.38%
GMD	HOSE	34,200	5.14%
DXG	HOSE	23,450	4.76%
VGT	UPCOM	15,000	2.93%
SHS	HNX	27,400	2.84%
DGC	HOSE	60,696	2.74%
KDC	HOSE	51,200	2.38%
HCM	HOSE	30,066	2.24%
DBC	HOSE	48,818	2.17%

Mã CP	Sàn	Giá đóng cửa	Tỷ trọng
VND	HNX	22,656	1.88%
VCI	HOSE	31,050	1.83%
GVR	HOSE	25,750	1.81%
DIG	HOSE	22,863	1.69%
IJC	HOSE	26,350	1.57%
PC1	HOSE	26,000	1.54%
TCM	HOSE	95,652	1.37%
HDG	HOSE	38,800	1.29%
PVT	HOSE	16,200	1.26%
DCM	HOSE	16,000	1.13%
CTR	UPCOM	64,739	0.87%
HDC	HOSE	31,600	0.86%
SZC	HOSE	34,500	0.80%
NDN	HNX	22,800	0.65%
LCG	HOSE	12,778	0.61%

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

CƠ CẤU CỔ PHIẾU THEO NGÀNH (29/04/2021)



Ngành	Vốn hóa (tỷ đồng)	Tỷ trọng	Số CP
Ngân hàng	186,710	35%	2
Nguyên vật liệu	328,473	28%	5
Tài chính	146,633	46%	14
Công nghiệp	28,137	7%	5
Hàng Tiêu dùng	31,658	7%	4

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

THÔNG TIN LIÊN HỆ

Phòng phân tích khối khách hàng cá nhân

Nguyễn Thế Minh
Giám đốc Nghiên cứu Phân tích
+84 28 3622 6868 ext 3826
minh.nguyen@yuanta.com.vn

Lý Thị Hiền
Trưởng phòng NC-PT
+84 28 3622 6868 ext 3908
hien.ly@yuanta.com.vn

Quách Đức Khánh
Phó phòng NC-PT
+84 28 3622 6868 ext 3833
khanh.quach@yuanta.com.vn

Khổng Hữu Hiệp
Chuyên viên phân tích cao cấp
+84 28 3622 6868 ext 3912
hiep.khong@yuanta.com.vn

Nguyễn Trịnh Ngọc Hồng
Chuyên viên phân tích cao cấp
+84 28 3622 6868 ext 3832
hong.nguyen@yuanta.com.vn

Phạm Tấn Phát
Chuyên viên phân tích cao cấp
+84 28 3622 6868 ext 3880
phat.pham@yuanta.com.vn

Phòng Môi giới khách hàng cá nhân

Nguyễn Thanh Tùng
Giám đốc Môi giới Hội Sở
+84 28 3622 6868 ext 3609
tung.nguyen@yuanta.com.vn

Phạm Đắc Thành
Giám đốc Khu vực Miền Bắc
+84 28 3622 6868 ext 3416
thanh.pham@yuanta.com.vn

Nguyễn Mạnh Hoạt
Giám đốc Khu vực Miền Nam (KV TP.HCM)
+84 28 3622 6868 ext 3847
hoat.nguyen@yuanta.com.vn

Lương Kỳ Ty
Giám đốc chi nhánh Chợ Lớn
+84 28 3622 6868 ext 3653
ty.luong@yuanta.com.vn

Bùi Quốc Phong
Giám đốc chi nhánh Đồng Nai
+84 28 3622 6868 ext 3701
phong.bui@yuanta.com.vn

Võ Thị Thu Thủy
Giám đốc chi nhánh Bình Dương
+84 28 3622 6868 ext 3505
thuy.vo@yuanta.com.vn

Nguyễn Việt Quang
Giám đốc chi nhánh Hà Nội
+84 28 3622 6868 ext 3404
quang.nguyen@yuanta.com.vn

Võ Đình Tuấn
Giám đốc chi nhánh Đà Nẵng
+84 28 3622 6868 ext 3301
tuan.vo@yuanta.com.vn

Đinh Thị Thu Cúc
Giám đốc chi nhánh Vũng Tàu
+84 28 3622 6868 ext 3203
cuc.dinh@yuanta.com.vn

DANH MỤC YS30

Báo cáo lần đầu_09/07/2021

Important Disclosures

Analyst Certification

Each research analyst primarily responsible for the content of this research report, in whole or in part, certifies that with respect to each security or issuer that the analyst covered in this report: (1) all of the views expressed accurately reflect his or her personal views about those securities or issuers; and (2) no part of his or her compensation was, is, or will be, directly or indirectly, related to the specific recommendations or views expressed by that research analyst in the research report.

Global Disclaimer

© 2018 Yuanta. All rights reserved. The information in this report has been compiled from sources we believe to be reliable, but we do not hold ourselves responsible for its completeness or accuracy. It is not an offer to sell or solicitation of an offer to buy any securities. All opinions and estimates included in this report constitute our judgment as of this date and are subject to change without notice.

This report provides general information only. Neither the information nor any opinion expressed herein constitutes an offer or invitation to make an offer to buy or sell securities or other investments. This material is prepared for general circulation to clients and is not intended to provide tailored investment advice and does not take into account the individual financial situation and objectives of any specific person who may receive this report. Investors should seek financial advice regarding the appropriateness of investing in any securities, investments or investment strategies discussed or recommended in this report. The information contained in this report has been compiled from sources believed to be reliable but no representation or warranty, express or implied, is made as to its accuracy, completeness or correctness. This report is not (and should not be construed as) a solicitation to act as securities broker or dealer in any jurisdiction by any person or company that is not legally permitted to carry on such business in that jurisdiction.

Yuanta research is distributed in the United States only to Major U.S. Institutional Investors (as defined in Rule 15a-6 under the Securities Exchange Act of 1934, as amended and SEC staff interpretations thereof). All transactions by a US person in the securities mentioned in this report must be effected through a registered broker-dealer under Section 15 of the Securities Exchange Act of 1934, as amended. Yuanta research is distributed in Taiwan by Yuanta Securities Investment Consulting. Yuanta research is distributed in Hong Kong by Yuanta Securities (Hong Kong) Co. Limited, which is licensed in Hong Kong by the Securities and Futures Commission for regulated activities, including Type 4 regulated activity (advising on securities). In Hong Kong, this research report may not be redistributed, retransmitted or disclosed, in whole or in part or any form or manner, without the express written