

QUỸ ETF SSIAM VN30

BÁO CÁO HOẠT ĐỘNG QUỸ



THÁNG 01 NĂM 2021

GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG

	NAV/CCQ (đồng)	Tăng trưởng (%)		
		1 tháng	3 tháng	Từ ngày thành lập
ETF SSIAM VN30	13.105,39	-0,84%	18,78%	31,05%
VN30 Index		-2,10%	17,45%	29,43%
VN-Index		-4,28%	14,17%	21,27%

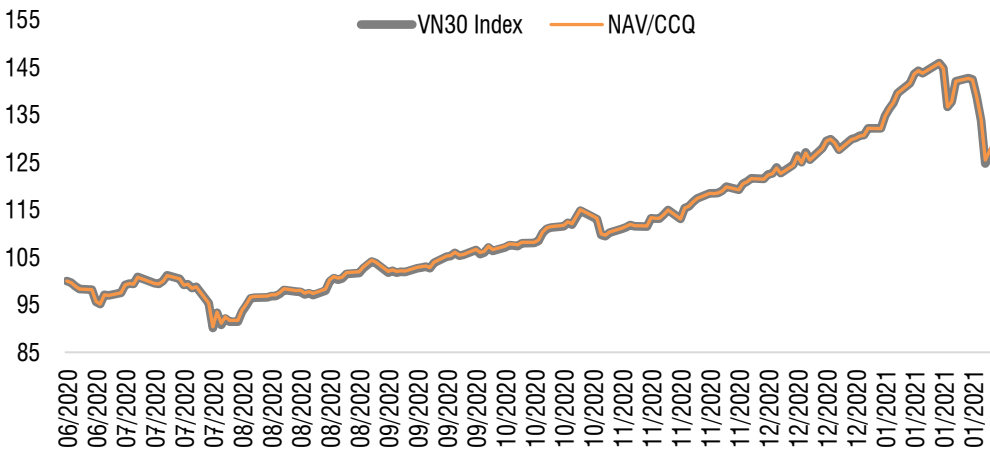
(*) Ngày thành lập: 22/06/2020.

Dữ liệu hoạt động đề cập ở đây thể hiện hiệu quả hoạt động trong quá khứ, không đảm bảo kết quả trong tương lai. Giá trị lợi nhuận và số tiền gốc của khoản đầu tư sẽ thay đổi, theo đó giá trị chứng khoán của nhà đầu tư khi bán có thể cao hơn hoặc thấp hơn giá trị vốn ban đầu.

CHỈ SỐ CƠ BẢN CỦA QUỸ

Số lượng cổ phiếu	30
Hệ số P/E	13,76x
Hệ số P/B	2,35x

Nguồn: Bloomberg, SSIAM



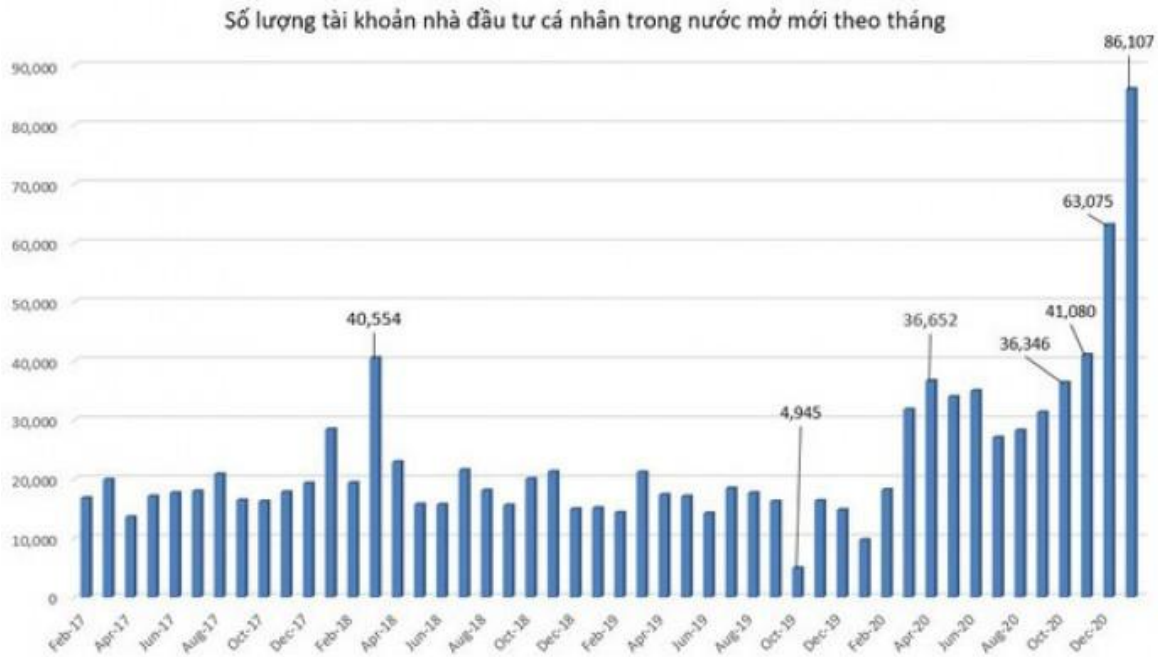
HOẠT ĐỘNG QUỸ TRONG THÁNG

Năm 2021, khởi đầu năm với sự hào hứng sau Tết dương lịch và chỉ số chứng khoán tăng khá mạnh nửa đầu tháng 1, nhưng bắt đầu sụt giảm mạnh vào cuối tháng 1 sau khi dịch bệnh bùng phát trở lại cũng như tình trạng căng cứng hạn mức cho vay tại các công ty chứng khoán (margin), thêm vào đó rất nhiều các hình thức cho vay bên thứ 3 (kho tiền, kho hàng) nở rộ cung cấp các dịch vụ cho vay vượt quy định của UBCK như cho vay với đòn bẩy lớn 1:9, 2:8, 3:7, 4:6 hay cho vay phái sinh để giảm tỷ lệ ký quỹ... đã thu hút rất nhiều nhà đầu cơ năng động cao tham gia nhằm thu lợi nhuận lớn trên vốn đầu tư. Hoạt động này thu được lợi nhuận rất lớn nhưng khi thị trường biến động trong tháng 1 vừa qua đã gây ra tình trạng call margin dây chuyền tại các kho tiền và rất nhiều cổ phiếu có sự sụt giảm rất mạnh 30 - 40% dù VN-Index giảm mạnh nhất khoảng gần 17% so với đỉnh.

Cú giảm đột tháng 1/2021 vừa rồi chúng tôi thấy có nhiều nét tương tự như cú giảm vào tháng 2/2018 khi thị trường cũng chứng kiến đợt giảm mạnh sau đó phục hồi với thanh khoản thấp hơn. Hiện nay đợt phục hồi vào tháng 2/2021 cũng diễn ra với thanh khoản thấp hơn so với trước đây, cũng có thể do đúng dịp Tết Nguyên đán nhưng rõ ràng thể hiện sự dè dặt trong giao dịch hơn sau cú giảm mạnh vừa qua.

Thông tin đáng chú ý nhất trên thị trường là dòng tiền vào thị trường vẫn diễn ra rất mạnh mẽ trong tháng 1 vừa qua khi số lượng tài khoản chứng khoán mở mới tiếp tục tạo kỷ lục mới khi có tới 86.107 tài khoản được mở mới, tăng 36,5% so với đỉnh tháng 4/2018

thì số lượng này gấp 2 lần thời điểm đó. Tổng số tài khoản giao dịch hiện tại đang khoảng 2,9 triệu tài khoản chiếm khoảng 3% dân số Việt Nam. Tuy nhiên số tài khoản chứng khoán thực tế hoạt động (active) không quá nhiều và vẫn còn nhiều tiềm năng trong tương lai khi hoạt động đầu tư chứng khoán được quan tâm thích đáng hơn so với hiện tại.



Nguồn: VSD, SSIAM

Nỗi ám ảnh margin call đã kéo thị trường 1 phiên mà các cổ phiếu lớn cũng sàn toàn bộ với dư bán rất lớn là điều rất ít gặp lâu nay khi mà thanh khoản thị trường lên cao và tâm lý nhà đầu tư khá tốt nên dù cổ phiếu có điều chỉnh cũng chưa xảy ra tình trạng trắng bên mua như vừa qua.

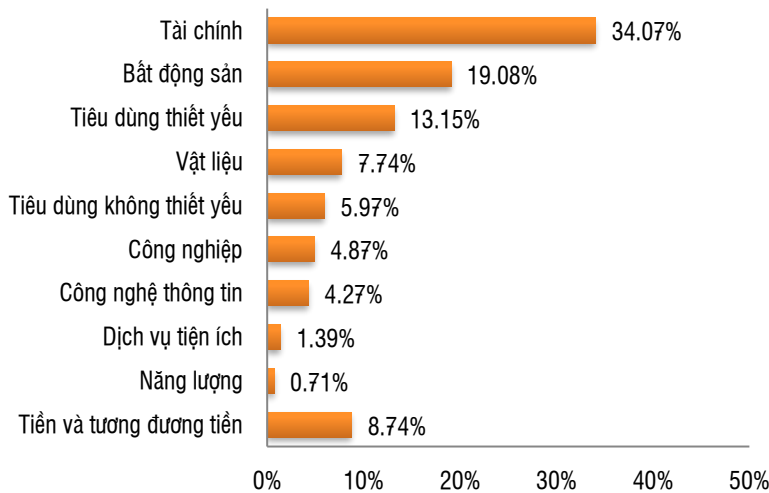
Nhờ đợt phục hồi vào những ngày cuối tháng 1/2021 nên kết thúc tháng 1, danh mục của quỹ đã tương đối phục hồi lại so với đầu năm 2021 và mức giảm không quá lớn.

Trong tháng 1/2021, chỉ số tham chiếu VN30 Index có sự sụt giảm 2,10% và lũy kế 3 tháng gần đây tăng 17,45% và lũy kế từ đầu năm 2021 giảm 2,10%. Trong cùng giai đoạn đó, quỹ ETF SSIAM VN30 có sự giảm 0,84% trong tháng 1 và lần lượt có sự tăng trưởng 18,78% và giảm 0,85% tương tự như chỉ số tham chiếu VN30 Index. Tháng 1/2021, mức độ biến động của quỹ khác so với chỉ số do có kỳ cơ cấu danh mục rơi vào đúng giai đoạn cuối tháng 1/2021 vừa qua.

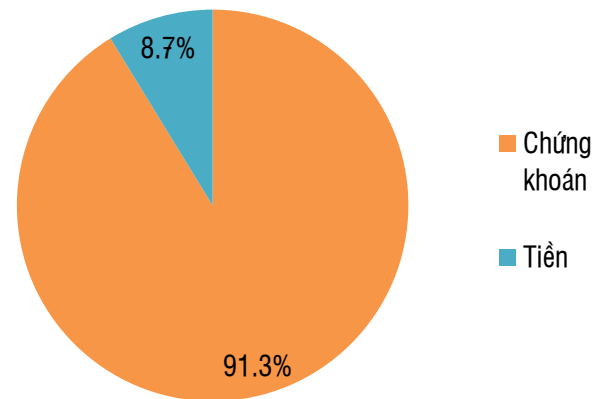
Trong tháng, thanh khoản trên sàn đạt tổng khối lượng giao dịch là 648.150 chứng chỉ quỹ (CCQ), bình quân mỗi phiên đạt 28.180 CCQ/phiên giảm 38,1% so với tháng 12/2020.

Dòng tiền vào quỹ VN30 trong kỳ có sự thay đổi với số lượng chứng chỉ quỹ tăng nhẹ lên 5,2 triệu đơn vị (+6,12%), với giá trị tài sản ròng đạt 68,1 tỷ đồng.

CƠ CẤU DANH MỤC THEO NGÀNH (% NAV)



PHÂN BỐ TÀI SẢN TẠI NGÀY 31/01/2021



THÔNG TIN CHUNG VỀ QUỸ

TÊN QUỸ	QUỸ ETF SSIAM VN30
CHỈ SỐ	Chỉ số VN30
MÃ QUỸ	FUESSV30
SÀN NIÊM YẾT	HSX
BẮT ĐẦU HOẠT ĐỘNG	22/06/2020
TỔNG NAV (VND)	74,4 tỷ
TỔNG SỐ LƯỢNG CCQ LƯU HÀNH	5.200.000
NAV/1CCQ (VND)	13.105,39
SAI LỆCH SO VỚI CHỈ SỐ THAM CHIẾU	0,65%
GIÁ ĐÓNG CỬA CỦA CCQ (VND)	13.170
GIÁ THỊ TRƯỜNG CCQ CAO NHẤT THẤP NHẤT TRONG 52 TUẦN GẦN NHẤT (VND)	14.910/ 9.770
ISIN	VN0FUESSV306
MÃ BLOOMBERG	FUESSV30 VN Equity

MỤC TIÊU VÀ CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Mục tiêu đầu tư của Quỹ ETF SSIAM VN30 là hướng tới đạt hiệu quả đầu tư bám sát mức sinh lời thực tế của Chỉ Số VN30 trong tất cả các giai đoạn.

Quỹ sẽ áp dụng chiến lược đầu tư thụ động với mục tiêu lợi nhuận bám sát tỷ lệ lợi nhuận của Chỉ Số VN30. Tùy vào từng thời điểm, Quỹ sẽ áp dụng phương pháp đầu tư mô phỏng toàn bộ hoặc một phần rổ cổ phiếu VN30 để giảm thiểu mức sai lệch so với Chỉ Số Tham Chiếu.

CHỈ SỐ THAM CHIẾU VN30

Chỉ số VN30 là chỉ số giá bao gồm những cổ phiếu niêm yết trên Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh đáp ứng đủ tư cách tham gia vào Bộ chỉ số và các điều kiện sàng lọc. Chỉ số VN30 có giới hạn tỷ trọng vốn hóa là 10% đối với cổ phiếu đơn lẻ và 15% đối với nhóm cổ phiếu có liên quan.

Chỉ số VN30 đại diện cho 67,1% vốn hóa của thị trường chứng khoán Việt Nam.

Chỉ số được xem xét điều chỉnh theo khối lượng cổ phiếu tự do chuyển nhượng định kỳ 3 tháng/lần và các cổ phiếu thành phần 6 tháng/lần.

NGƯỜI ĐIỀU HÀNH QUỸ

Nguyễn Minh Hạnh - Giám đốc đầu tư

E: hanhnm2@ssi.com.vn

Nguyễn Bá Huy – Phó giám đốc đầu tư

E: huynb@ssi.com.vn

DANH MỤC ĐẦU TƯ CỦA QUỸ (% NAV)

STT	Cổ phiếu	Tên công ty	% NAV	STT	Cổ phiếu	Tên công ty	% NAV
1	VNM	Công ty Cổ phần Sữa Việt Nam	8,8%	16	CTG	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Công thương Việt Nam	1,9%
2	TCB	Ngân hàng TMCP Kỹ Thương Việt Nam	7,9%	17	PNJ	Công ty Cổ phần Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	1,7%
3	HPG	Công ty cổ phần Tập đoàn Hòa Phát	7,7%	18	KDH	Công ty Cổ phần Đầu tư Kinh doanh nhà Khang Điền	1,3%
4	VIC	Tập đoàn Vingroup - Công ty Cổ phần	7,3%	19	SSI	Công ty cổ phần Chứng khoán SSI	1,1%
5	VPB	Ngân hàng TMCP Việt Nam Thịnh Vượng	6,0%	20	GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam	0,8%
6	VHM	CTCP Vinhomes	4,8%	21	REE	Công ty Cổ phần Cơ điện lạnh	0,8%
7	MBB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Quân đội	4,3%	22	PLX	Tập đoàn Xăng Dầu Việt Nam	0,7%
8	FPT	Công ty Cổ phần FPT	4,3%	23	BID	Ngân hàng Thương mại CP Đầu tư và Phát triển Việt Nam	0,7%
9	MWG	Công ty cổ phần Đầu tư Thế giới Di động	4,2%	24	POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	0,6%
10	VCB	Ngân hàng Thương mại CP Ngoại thương Việt Nam	4,1%	25	TCH	Công ty Cổ phần Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	0,5%
11	MSN	Công ty Cổ phần Tập đoàn MaSan	3,8%	26	SBT	Công ty cổ phần Mía đường Thành Thành Công Tây Ninh	0,5%
12	VJC	CTCP Hàng không VietJet	3,6%	27	EIB	Ngân hàng TMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	0,1%
13	STB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Sài Gòn Thương Tín	3,1%	28	SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước giải khát Sài Gòn	0,1%
14	NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	3,0%	29	ROS	CTCP Xây dựng FLC Faros	0,0%
15	HDB	Ngân hàng Phát triển TPHCM	2,7%	30	VRE	CTCP Vincom Retail	0,0%

KHUYẾN CÁO

Tài liệu này được viết và phát hành bởi công ty TNHH Quản Lý Quỹ SSI (SSIAM). Tài liệu này chỉ mang tính chất tham khảo và có thể thay đổi mà không cần thông báo. Tài liệu này không phải là bản cáo bạch, lời đề nghị hay là bất kỳ cam kết nào của SSIAM. SSIAM không có nghĩa vụ phải cập nhật, sửa đổi tài liệu này dưới mọi hình thức khi các vấn đề thuộc về quan điểm, dự báo và ước tính trong tài liệu này thay đổi hoặc trở nên không chính xác.

Trong trường hợp có bất kỳ thay đổi về thông tin nhà đầu trong Phần A của Hồ Sơ Nhà Đầu Tư đã gửi SSIAM, kính đề nghị Quý Nhà Đầu Tư cập nhật cho chúng tôi trong thời gian sớm nhất.

Tài liệu này không nên được sử dụng cho mục đích ghi nhận kế toán, thuế hay để đưa ra các quyết định đầu tư. Nhà Đầu Tư nên chú ý rằng kết quả hoạt động trong quá khứ không hàm ý đảm bảo cho kết quả hoạt động của Quỹ trong tương lai. Giá trị của một chứng chỉ quỹ và thu nhập của Quỹ có thể tăng hoặc giảm nên không thể được bảo đảm bởi Công Ty Quản Lý Quỹ. Trường hợp Nhà Đầu Tư nghi ngờ về quyết định đầu tư của mình thì nên tìm hiểu thêm thông tin hoặc tham khảo ý kiến chuyên gia để có quyết định đầu tư thích hợp.