

QUỸ ETF SSIAM VN30

BÁO CÁO HOẠT ĐỘNG QUỸ



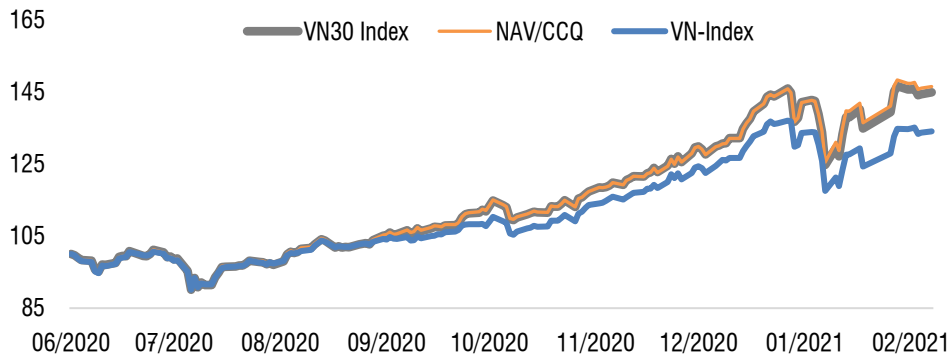
THÁNG 02 NĂM 2021

GIÁ TRỊ TÀI SẢN RÒNG

	NAV/CCQ (đồng)	Tăng trưởng (%)			
		1 tháng	3 tháng	Từ đầu năm	Từ ngày thành lập*
ETF SSIAM VN30	14.648,89	11,78%	22,88%	10,84%	46,49%
VN30 Index		11,95%	21,50%	9,60%	44,89%
VN-Index		10,59%	16,49%	5,85%	34,11%

(*) 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.



HOẠT ĐỘNG QUỸ TRONG THÁNG

Trong tháng 2/2021, thị trường có đã sự phục hồi mạnh mẽ sau sự suy giảm mạnh của những ngày cuối tháng 1 và trước kỳ nghỉ Tết âm lịch. Đáng chú ý là lực bán ròng liên tục và rất mạnh của nhà đầu tư nước ngoài rơi vào nhiều cổ phiếu có vốn hóa lớn đặc biệt trong nhóm VN30. Động thái này có vẻ ảnh hưởng nhiều bởi 1 số quỹ bán cổ phiếu cụ thể và hoạt động rút tiền từ chỉ số VN30 của 1 số nhà đầu tư nước ngoài trên thị trường.

Trong khi đó, việc chờ đợi dòng tiền sớm trở lại Việt Nam hiện nay vẫn chưa thành hiện thực khi xu hướng vẫn đang là rút ròng. Sự thiếu đồng thuận trên thị trường giai đoạn này đã tạo ra tình trạng thị trường giảm mạnh và phục hồi với thanh khoản thấp, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng mạnh và gây ra 1 số lo ngại về lịch sử có thể lặp lại vào giai đoạn hiện tại mặc dù ở hiện tại tâm lý nhà đầu tư không quá tích cực như giai đoạn đầu năm 2018.

Với sự gia tăng mạnh của độ biến động thị trường khi trong 1 thời gian ngắn, thị trường suy giảm tới 17% rồi nhanh chóng phục hồi gần như trở lại mức trước suy giảm rồi đi ngang và khá nhạy cảm với các biến động ở bên ngoài đã làm gia tăng mức độ rủi ro của thị trường ở giai đoạn hiện tại. Nhìn chỉ số PE chung của thị trường thì chưa ở mức đỉnh do nhiều nhóm cổ phiếu như ngân hàng, sắt thép, bất động sản có mức lợi nhuận lớn kéo theo mức tổng lợi nhuận thị trường tăng mạnh làm giảm PE thị trường chung. Nhưng rất nhiều cổ phiếu vốn hóa lớn chủ chốt trên thị trường đang vẫn giao dịch ở mức định giá quá cao và thị trường khó có thể vượt được 1.200 điểm ở mức bền vững đi lên dài hạn. Nhìn chung, mức 1.200 điểm vẫn là 1 vùng chưa thể dễ dàng vượt qua được trong ngắn hạn sắp tới. Mặc dù vậy, thị trường vẫn có thể hoàn toàn vượt qua mức điểm mà được coi là cản cứng 1.200 điểm ở 1 mức nào đó trước khi có sự sụt giảm mạnh trở lại về điểm cân bằng.

CHỈ SỐ CƠ BẢN CỦA QUỸ

Số lượng cổ phiếu	30
Hệ số P/E	15,28x
Hệ số P/B	2,62x

Nguồn: Bloomberg, SSIAM

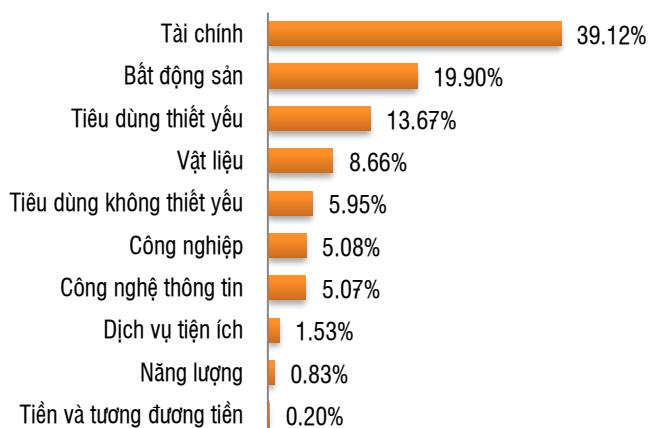
Theo đà phục hồi từ cuối tháng 1/2021, tháng 2 tiếp tục có sự tăng trưởng mạnh mẽ đặc biệt giai đoạn sau nghỉ Tết nguyên đán năm 2021 nhà đầu tư cá nhân trong nước rất hào hứng quay lại thị trường. Các quỹ chỉ số cũng có sự tăng trưởng mạnh mẽ trong tháng 2/2021 này.

Trong tháng 2/2021, chỉ số tham chiếu VN30 Index có sự tăng trưởng mạnh mẽ 11,95% và lũy kế 3 tháng gần đây tăng 21.50% và lũy kế từ đầu năm 2021 tăng 9,60%. Trong cùng giai đoạn đó, quỹ ETF SSIAM VN30 có sự tăng trưởng 11,78% trong tháng 1 và lần lượt có sự tăng trưởng 22,88% và 10,84% tương tự như chỉ số tham chiếu VN30 Index.

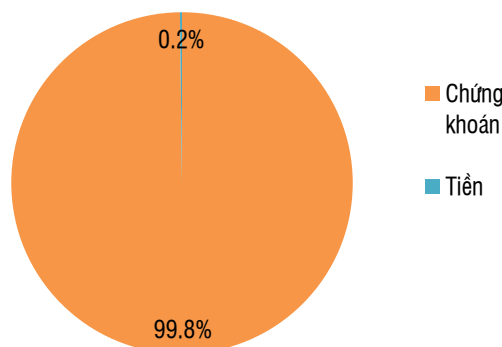
Trong tháng, thanh khoản trên sàn đạt tổng khối lượng giao dịch là 286.900 ccq, bình quân mỗi phiên đạt 19.127 ccq/phiên tăng 9,7% so với tháng 1/2021.

Dòng tiền vào quỹ VN30 trong kỳ không đổi với số lượng chứng chỉ quỹ đạt 5,2 triệu đơn vị, với giá trị tài sản ròng đạt 76,2 tỷ đồng.

CƠ CẤU DANH MỤC THEO NGÀNH (% NAV)



PHÂN BỐ TÀI SẢN TẠI NGÀY 28/02/2021



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)	76,17 tỷ
TỔNG SỐ LƯỢNG CCQ LƯU HÀNH	5.200.000
NAV/1CCQ (VND)	14.648,89
SAI LỆCH SO VỚI CHỈ SỐ THAM CHIẾU	0,91%
GIÁ ĐÓNG CỬA CỦA CCQ (VND)	14.470
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 66% 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: huybn@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	TCB	Ngân hàng TMCP Kỹ Thương Việt Nam	9,3%	16	CTG	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Công thương Việt Nam	2,2%
2	VNM	Công ty Cổ phần Sữa Việt Nam	9,2%	17	VRE	CTCP Vincom Retail	1,8%
3	HPG	Công ty cổ phần Tập đoàn Hòa Phát	8,7%	18	TPB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Tiên Phong	1,8%
4	VIC	Tập đoàn Vingroup - Công ty Cổ phần	7,8%	19	PNJ	Công ty Cổ phần Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	1,7%
5	VPB	Ngân hàng TMCP Việt Nam Thịnh Vượng	7,8%	20	SSI	Công ty cổ phần Chứng khoán SSI	1,3%
6	FPT	Công ty Cổ phần FPT	5,1%	21	KDH	Công ty Cổ phần Đầu tư Kinh doanh nhà Khang Điền	1,2%
7	VHM	CTCP Vinhomes	5,1%	22	PDR	Công ty cổ phần Phát triển Bất động sản Phát Đạt	1,1%
8	MBB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Quân đội	4,9%	23	GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam	0,9%
9	VCB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Ngoại thương Việt Nam	4,3%	24	REE	Công ty Cổ phần Cơ điện lạnh	0,8%
10	MWG	Công ty cổ phần Đầu tư Thế giới Di động	4,2%	25	PLX	Tập đoàn Xăng Dầu Việt Nam	0,8%
11	MSN	Công ty Cổ phần Tập đoàn MaSan	3,9%	26	BID	Ngân hàng Thương mại cổ phần Đầu tư và Phát triển Việt Nam	0,7%
12	VJC	CTCP Hàng không VietJet	3,8%	27	POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	0,6%
13	STB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Sài Gòn Thương Tín	3,3%	28	SBT	Công ty cổ phần Mía đường Thành Thành Công Tây Ninh	0,5%
14	HDB	Ngân hàng Phát triển TPHCM	3,0%	29	TCH	Công ty Cổ phần Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	0,5%
15	NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	2,9%	30	BVH	Tập đoàn Bảo Việt	0,5%

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.