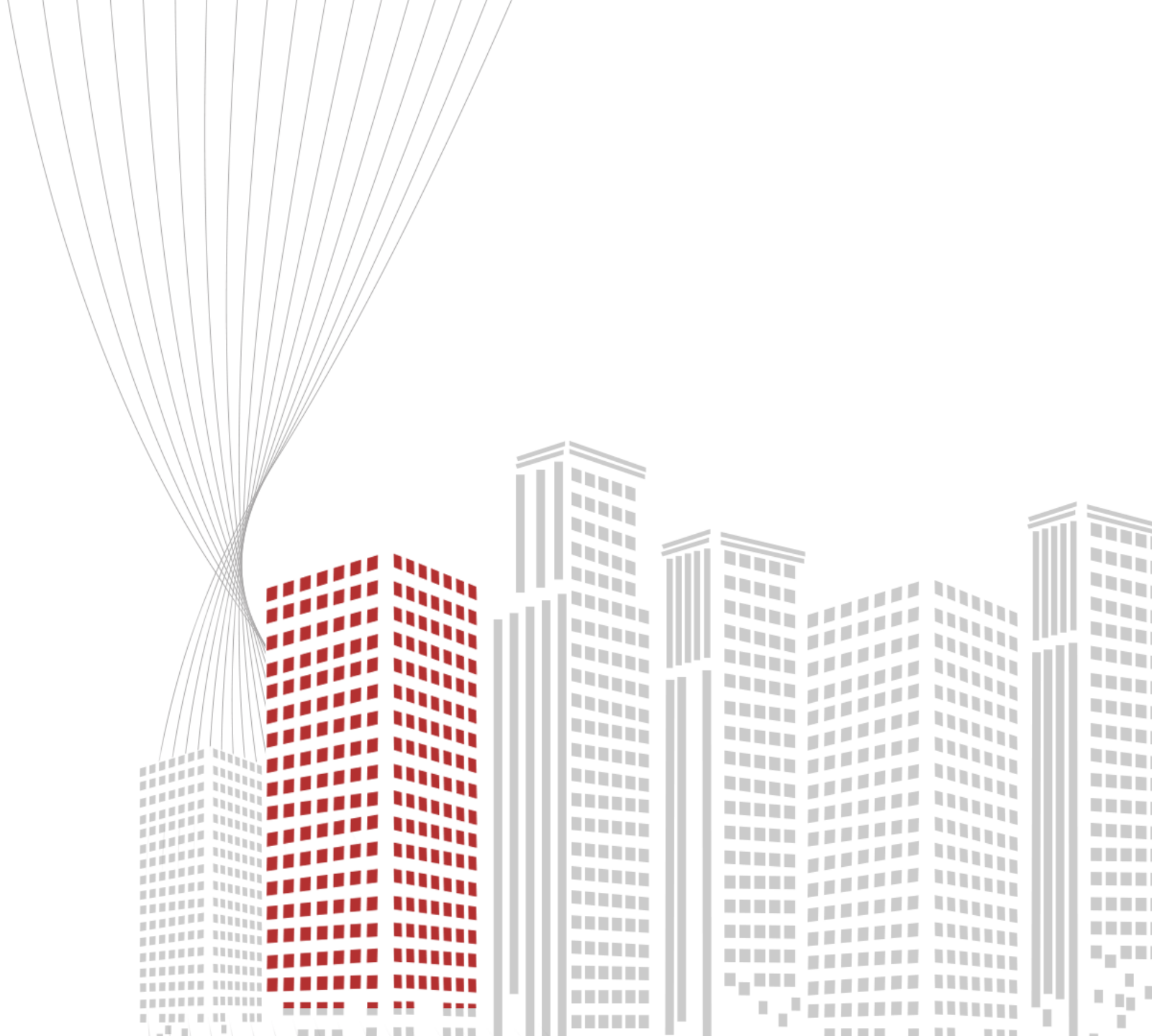




SSIAM VN30 ETF

Tháng 05/2024





Asset
Management

QUỸ SSIAM VN30 ETF





QUY TẮC XÂY DỰNG CHỈ SỐ VN30

VN All Shares Index

Các cổ phiếu có tỷ lệ cổ phiếu tự do chuyển nhượng $\geq 10\%$

Cổ phiếu được chọn:

- Cổ phiếu không thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng chứng khoán $\geq 0,05\%$
- Cổ phiếu thuộc thành phần của chỉ số kỳ trước có tỷ suất quay vòng chứng khoán $\geq 0,04\%$

Tỷ lệ cổ phiếu tự do chuyển nhượng và thanh khoản

Điều kiện niêm yết

Vốn hóa

Các cổ phiếu không được vi phạm công bố thông tin, kiểm soát đặc biệt, bị tạm ngưng giao dịch trong vòng 6 tháng tính đến thời điểm xét duyệt

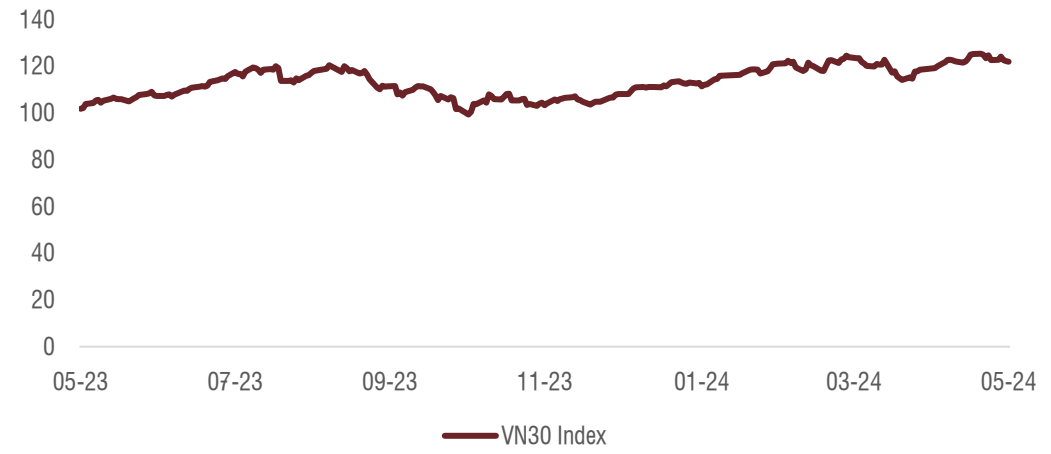
Các cổ phiếu với tỷ lệ vốn hóa bình quân hàng ngày cao nhất trong vòng 6 tính đến thời điểm xét duyệt

VN30

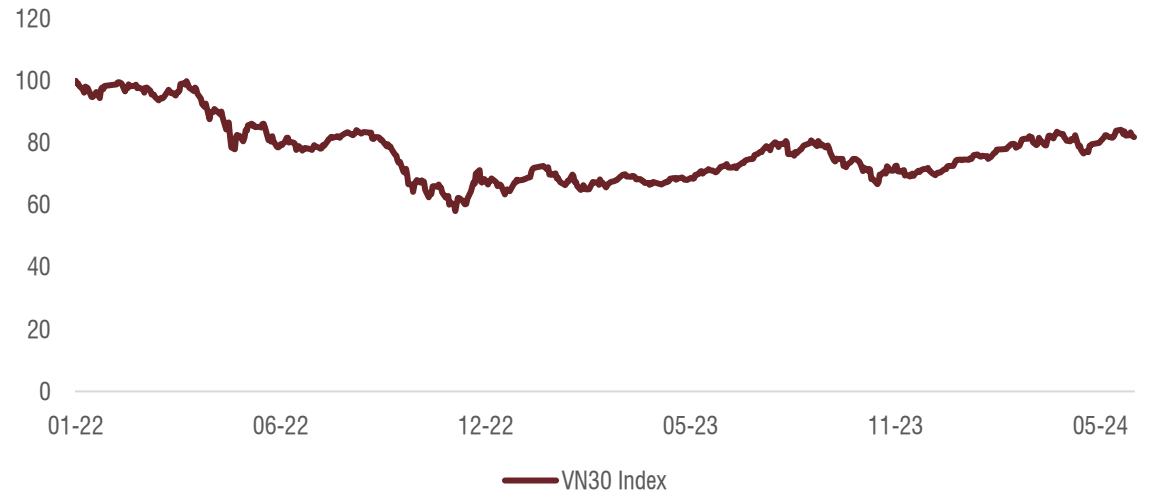


HIỆU QUẢ HOẠT ĐỘNG CHỈ SỐ VN30

1 năm



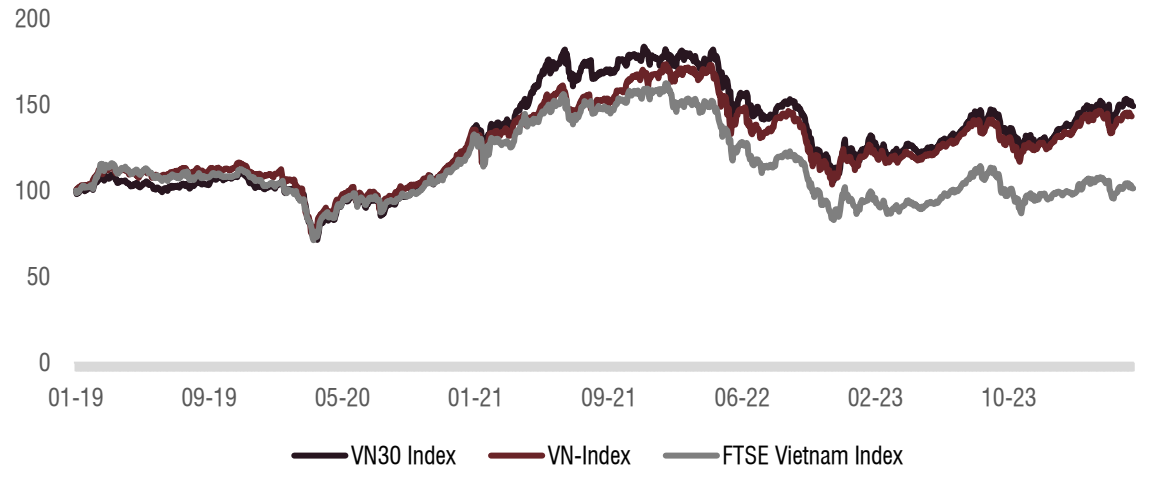
2 năm



3 năm



5 năm



SSI QUỸ ETF SSIAM VN30 (FUSSV30)

Thông Tin Chung về Quỹ

Tên Quỹ: Quỹ ETF SSIAM VN30

Thành lập: 22/06/2020



Loại quỹ
Quỹ ETF



Quy mô
147,2 tỷ Đồng
(~5,7 triệu USD)

Ngân hàng lưu ký và giám sát: Ngân hàng Vietcombank

Chỉ số tham chiếu: Chỉ số VN30 là chỉ số bao gồm các cổ phiếu được niêm yết trên Sở giao dịch chứng khoán thành phố Hồ Chí Minh có giá trị vốn hóa và thanh khoản cao nhất thị trường, Chỉ số VN30 có giới hạn trọng lượng 10% đối với cổ phiếu riêng lẻ và 15% đối với nhóm cổ phiếu liên quan,

Mục Tiêu Và Chiến lược đầu tư: Bám sát mức sinh lời thực tế của Chỉ Số VN30 trong tất cả các giai đoạn, Quỹ không hướng tới đạt hiệu quả vượt trội so với Chỉ số VN30 hoặc đưa ra các biện pháp phòng thủ khi TTCK Việt Nam giảm điểm,

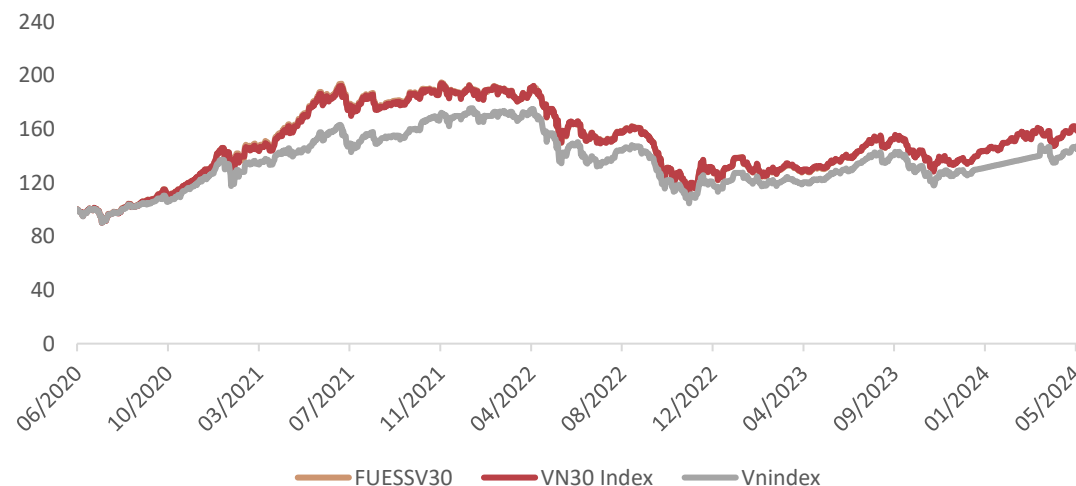
HIỆU QUẢ ĐẦU TƯ

Tại ngày 31/05/2024

	NAV/CCQ (VND)	Tăng trưởng (%)						Từ khi thành lập
		2022	2021	2023	1 tháng	3 tháng	YTD	
SSIAM VN30 ETF	15.833,82	32.17	43.85	12.70	3,78	1,58	13,42	58,34
VN30 Index	1.275,97	32.20	43.42	12.56	2,86	0,81	12,77	57,54

*Ngày thành lập: 22/06/2020

Dữ liệu hoạt động để 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.





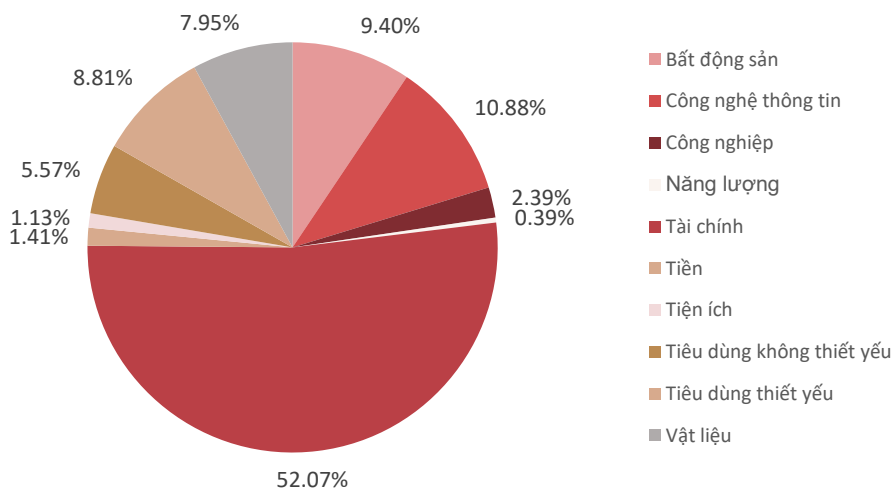
QUỸ ETF SSIAM VN30 (FUSSV30)

Chỉ số quỹ

	VN30 Index	VNIndex Index
Fund Metrics	VN30	VN-Index
P/E (x)	12,51	16,04
Fwd PE (x)	8,40	0,57
PB (x)	1,69	1,78
ROE (%)	14,30	12,12
Dividend yield (%)	1,84	1,64

30 Constituents	Mkt Cap (USD)	Avg, Daily Trading Value (USD)
Min	1.114.934.523	1.154.388
Max	22.113.361.080	31.809.585
Median	4.200.417.618	8.435.516
Avg	5.161.593.763	9.483.783

FOL Limits	Fund Weight (%)
MWG	5,39
TPB	1,50
FPT	10,77
MBB	4,95
VIB	1,88
ACB	7,32
TCB	8,28
VPB	6,88
Total	46,97



Investment Thesis:

- Chỉ số VN30 tương tự như Dow Jones Industrial hay Nasdaq-100, được ví như là một khoản đầu tư blue-chip trên thị trường Chứng khoán Việt Nam
- Chỉ số VN Index đa dạng ngành
- Nhà đầu tư có khả năng tiếp cận nhiều cổ phiếu với giới hạn sở hữu nước ngoài (FOL)
- Chiếm >60% thị trường vốn của Việt Nam, Beta cao và tỷ lệ tương quan tốt với tăng trưởng thị trường
- Chỉ số duy nhất trên thị trường Việt Nam có hợp đồng tương lai
- Lựa chọn: 30 cổ phiếu có tính thanh khoản cao nhất từ top 50 cổ phiếu có vốn hóa điều chỉnh tự do chuyển nhượng lớn nhất niêm yết trên HSX



DANH MỤC HIỆN TẠI CỦA SSIAM VN30 ETF

STT	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)	Ngành	Vốn hóa (Triệu USD)	P/E (x)	P/B (x)	Hiệu quả từ đầu năm đến nay	% room nước ngoài còn lại	Giá trị giao dịch (VND)
1	FPT	11.19	Công nghệ thông tin	7,680.55	26.07	6.58	-0.52%	0%	8,385,670
2	TCB	8.12	Tài chính	7,290.07	8.49	1.23	10.69%	0%	10,666,683
3	HPG	7.68	Vật liệu	8,148.28	20.13	1.78	0.18%	39%	27,572,869
4	ACB	7.34	Tài chính	4,757.96	6.92	1.46	8.58%	0%	13,627,495
5	VPB	6.46	Tài chính	6,278.15	11.97	1.04	2.60%	3%	12,002,355
6	MWG	5.56	Tiêu dùng không thiết yếu	4,056.14	89.14	3.69	6.07%	1%	16,978,558
7	MBB	4.88	Tài chính	5,172.15	5.81	1.21	18.50%	0%	20,712,304
8	STB	4.21	Tài chính	2,454.88	7.12	1.18	9.84%	7%	23,644,125
9	MSN	4.13	Tiêu dùng thiết yếu	4,821.32	358.80	4.15	-1.34%	49%	7,376,706
10	VNM	4.11	Tiêu dùng thiết yếu	5,997.26	16.74	4.33	-1.04%	140%	6,497,285
11	VCB	4.06	Tài chính	21,554.45	15.19	2.86	13.32%	26%	5,472,340
12	HDB	3.87	Tài chính	3,032.85	6.25	1.45	7.64%	3%	7,335,795
13	VHM	3.83	Bất động sản	7,459.22	7.68	1.00	-2.78%	127%	10,154,346
14	VIC	3.77	Bất động sản	7,331.46	18.17	1.26	-4.26%	108%	5,198,068
15	SSI	2.79	Tài chính	2,322.76	20.78	2.22	4.12%	67%	29,438,117



DANH MỤC HIỆN TẠI CỦA SSIAM VN30 ETF

STT	Mã cổ phiếu	Tỷ trọng (%)	Ngành	Vốn hóa tt (USD mn)	P/E (x)	P/B (x)	Hiệu quả từ đầu năm đến nay	% room nước ngoài còn lại	Giá trị giao dịch (USD)
16	SHB	2.65	Tài chính	1,839.17	5.46	0.79	13.89%	31%	20.486.386
17	VJC	2.41	Công nghiệp	2,552.64	98.79	3.66	-2.22%	25%	3.649.192
18	SSB	2.21	Tài chính	2,343.79	13.42	1.71	-3.77%	6%	2.553.096
19	CTG	1.97	Tài chính	7,658.08	8.78	1.36	18.82%	10%	11.539.786
20	VIB	1.91	Tài chính	2,470.63	6.76	1.48	9.70%	0%	4.748.411
21	VRE	1.50	Bất động sản	2,183.40	11.24	1.29	0.43%	85%	6.117.643
22	TPB	1.48	Tài chính	1,727.80	8.81	1.16	5.17%	3%	9.022.876
23	BID	0.81	Tài chính	11,797.42	12.42	2.19	11.64%	13%	3.609.446
24	GAS	0.69	Dịch vụ tiện ích	8,068.55	16.66	2.79	1.19%	1107%	2.344.722
25	SAB	0.65	Tiêu dùng thiết yếu	3,423.88	19.22	3.13	-7.01%	378%	1.888.142
26	POW	0.49	Dịch vụ tiện ích	1,425.49	41.91	1.05	2.22%	223%	2.165.393
27	GVR	0.42	Vật liệu	6,104.35	55.09	2.76	8.25%	391%	2.499.681
28	PLX	0.39	Năng lượng	2,303.64	16.25	1.96	0.72%	61%	1.115.565
29	BVH	0.25	Tài chính	1,479.80	18.48	1.55	3.80%	65%	682.990
30	BCM	0.19	Vật liệu	2,803.50	27.98	3.46	3.82%	1468%	1.670.034



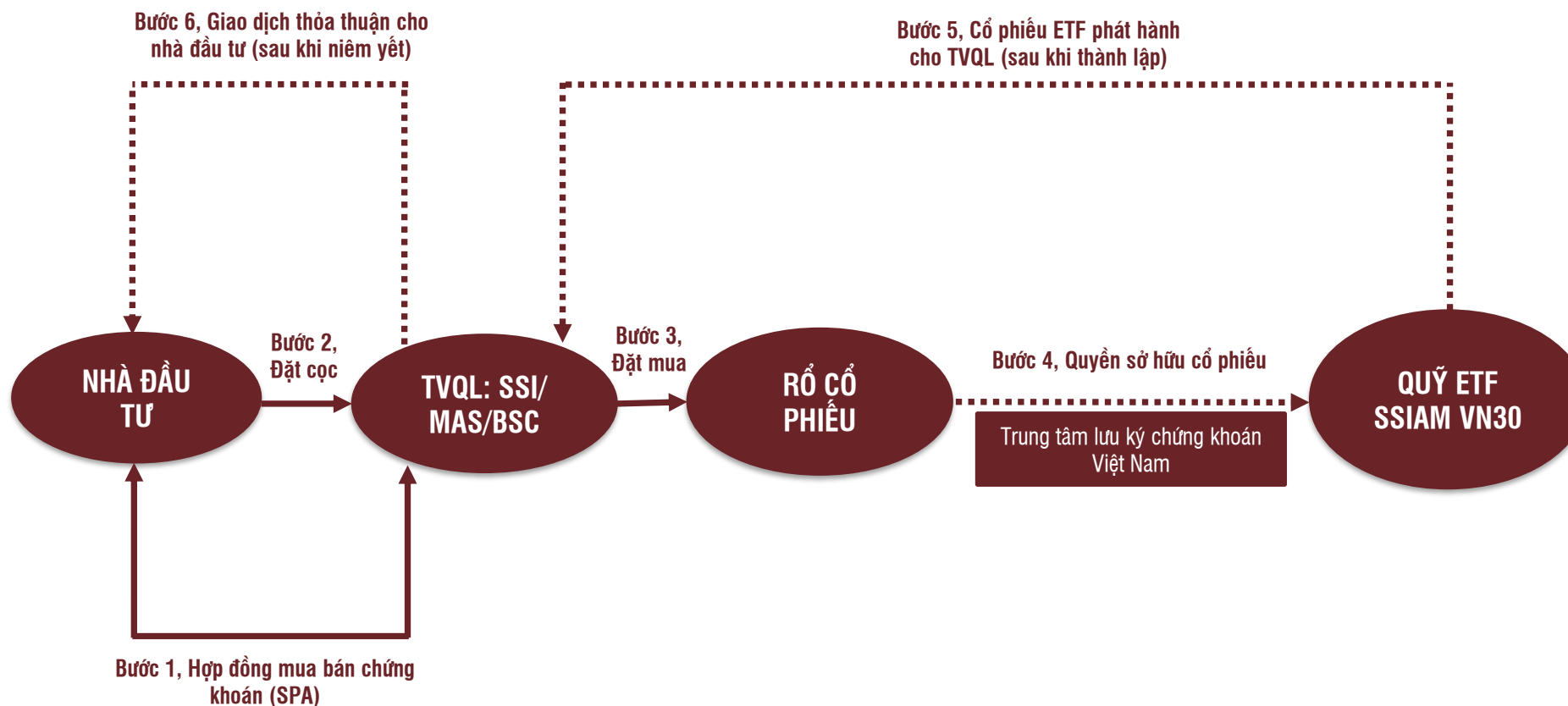
Asset
Management

PHƯƠNG THỨC ĐĂNG KÝ GIAO DỊCH



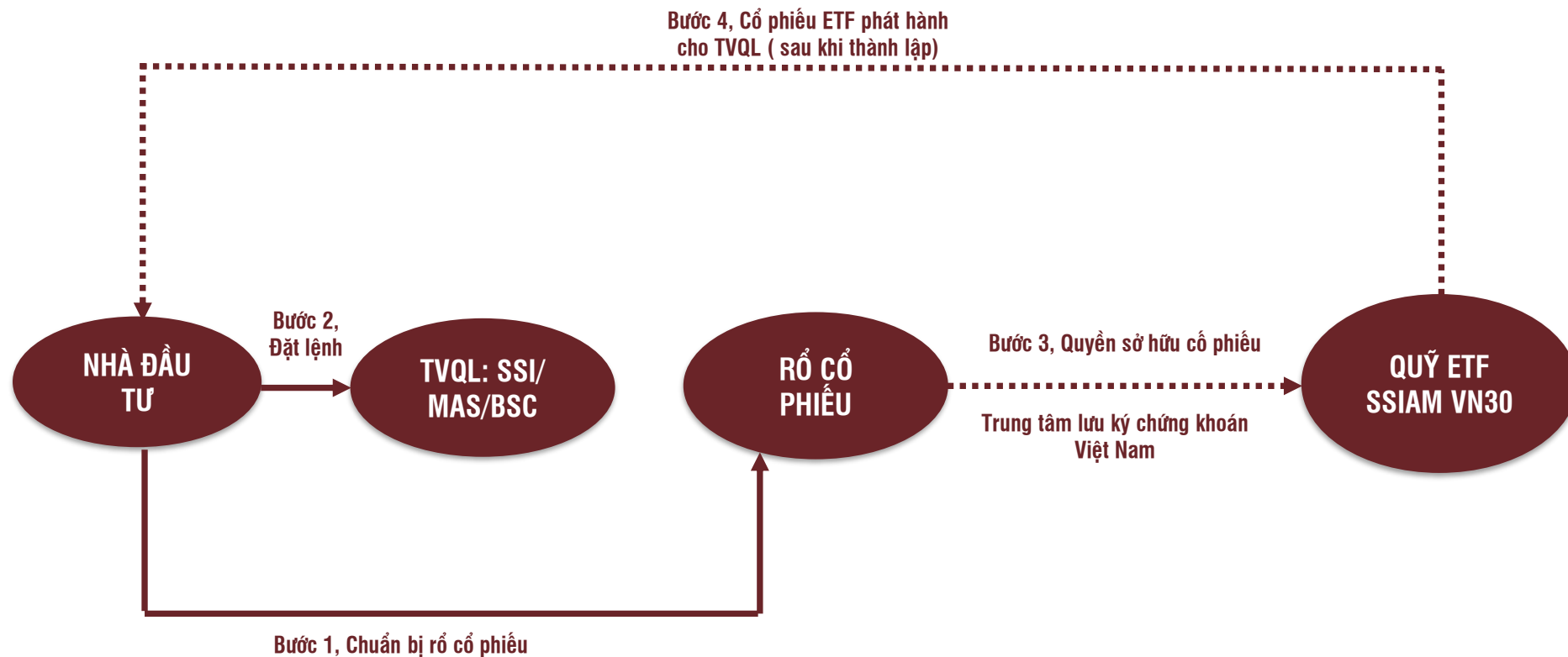


PHƯƠNG THỨC 1 – GÓP BẰNG TIỀN MẶT (TVLQ CHUẨN BỊ RỔ CỔ PHIẾU)





PHƯƠNG THỨC 2 – GÓP BẰNG CHỨNG KHOÁN (NHÀ ĐẦU TƯ TỰ CHUẨN BỊ RỔ CỔ PHIẾU)



KHUYẾN CÁO

Tài liệu này chỉ mang tính chất tham khảo, cung cấp thông tin, không phải lời đề nghị hoặc khuyến nghị thực hiện giao dịch hay đăng ký bất kỳ dịch vụ tư vấn đầu tư hay quản lý tài sản. Hiệu quả đầu tư trong quá khứ không hàm ý đảm bảo kết quả hoạt động trong tương lai mặc dù mọi nỗ lực đều để đảm bảo tính chính xác và công bằng. SSIAM cũng như bất kỳ đối tác hoặc nhân viên Công Ty sẽ không chịu trách nhiệm dưới bất kỳ hình thức nào về nội dung của tài liệu này. Trong mọi trường hợp, tài liệu này không sử dụng với mục đích phân phối đại chúng.

XIN CÁM ƠN!

Liên Hệ:



Tầng 05, số 1C Ngô Quyền, Hoàn Kiếm, Hà Nội



+84.24.3936 6321 ext.1633



ssiam@ssi.com.vn



www.ssiam.com.vn