

CẬP NHẬT HOẠT ĐỘNG QUỸ DCVFMVN30

THÔNG TIN CHUNG

|                                        |                                                            |
|----------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| Tên quỹ                                | Quỹ ETF DCVFMVN30                                          |
| Mã giao dịch                           | E1VFN30                                                    |
| Mã trên Bloomberg                      | E1VFN30 VN Equity                                          |
| Sàn niêm yết                           | HOSE                                                       |
| Loại hình quỹ                          | Quỹ ETF                                                    |
| Chỉ số tham chiếu                      | VN30 Total Return Index                                    |
| Tiền tệ                                | VND                                                        |
| Công ty QLQ                            | Công ty Cổ phần Quản lý Quỹ Đầu tư Dragon Capital Việt Nam |
| Ngân hàng giám sát                     | Standard Chartered Việt Nam                                |
| Đại lý chuyển nhượng                   | Trung tâm lưu ký chứng khoán (VSD)                         |
| Đơn vị cung cấp chỉ số                 | Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HOSE)      |
| Thành viên lập quỹ                     | HSC, VDSC, BVSC, VCSC, VND, KIS, BSC, SSI, MAS             |
| Tổ chức tạo lập thị trường             | HSC, BVSC, VCSC, BSC, KIS, VND                             |
| Lô chứng chỉ quỹ ETF                   | 1 (một) lô ETF tương ứng với 100.000 chứng chỉ quỹ ETF     |
| Tần suất giao dịch hoán đổi            | Hàng ngày                                                  |
| Phí quản lý                            | 0,65%/NAV/năm                                              |
| Phí phát hành                          | 0%                                                         |
| Phí mua lại                            | 0%-0,15%                                                   |
| Phân phối lợi nhuận                    | Tái đầu tư (được quyết định tại Đại hội cổ đông hàng năm)  |
| Tổng NAV (tỷ VNĐ)                      | 7.508,0                                                    |
| Số lượng CCQ đang lưu hành (triệu ccq) | 330,9                                                      |
| Tỷ lệ chi phí 12 tháng (%)             | 0,8                                                        |
| Vòng quay tài sản 12 tháng (%)         | 39,3                                                       |

MỤC TIÊU ĐẦU TƯ

Mục tiêu của Quỹ là mô phỏng gần nhất có thể về biến động (performance) của chỉ số tổng thu nhập VN30 sau khi trừ đi chi phí của Quỹ. Chỉ số tổng thu nhập VN30 là chỉ số do Sở giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh xây dựng và quản lý. Nhà đầu tư nước ngoài không bị hạn chế tỷ lệ sở hữu đối với Quỹ ETF DCVFMVN30.

GIỚI THIỆU CHỈ SỐ MÔ PHỎNG VN30 - TRI

VN30 – TRI là chỉ số của 30 cổ phiếu có giá trị vốn hóa và thanh khoản cao nhất thị trường được chọn lựa từ danh sách các cổ phiếu hàng đầu chiếm 90% giá trị giao dịch của chỉ số VNAllshare. Chỉ số này sẽ được tái cơ cấu hai đợt trong một năm (tháng 1 và tháng 7) thông qua quy trình sàng lọc cổ phiếu của HOSE gồm 5 bước:

- Bước 1: Điều kiện niêm yết
- Bước 2: Sàng lọc về free-float
- Bước 3: Sàng lọc về giá trị giao dịch
- Bước 4: Chọn lựa danh sách cổ phiếu hàng đầu chiếm 90% giá trị giao dịch
- Bước 5: Xếp hạng từ cao xuống thấp giá trị giao dịch trung bình hàng ngày trong vòng 12 tháng.

ĐIỂM NỔI BẬT CỦA VN30

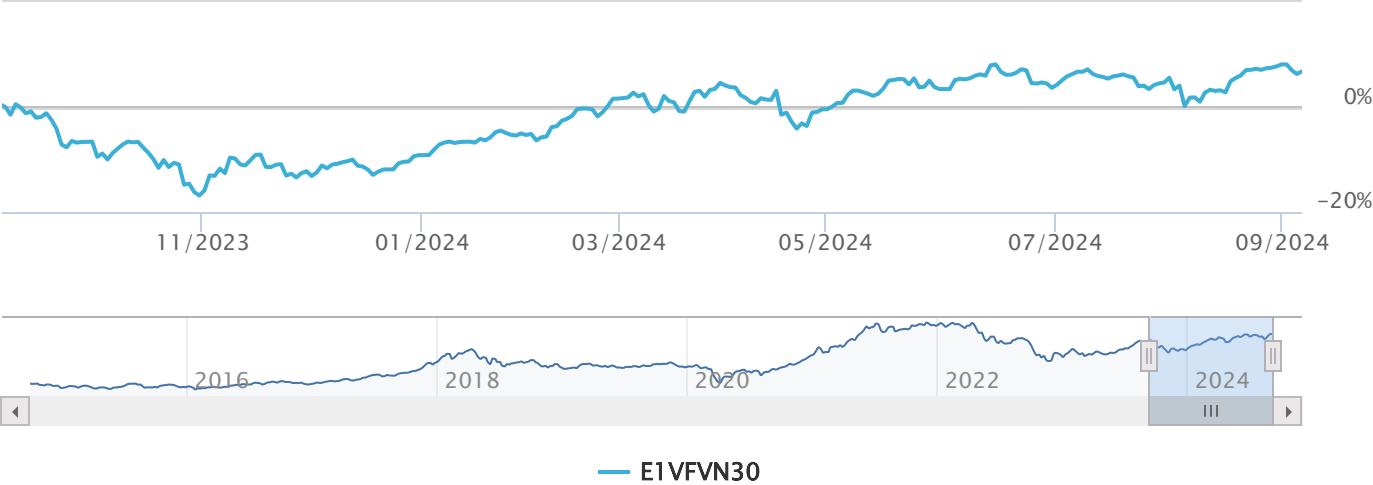
- Tổng giá trị vốn hóa là 44,2 tỷ USD, chiếm tỷ trọng 76,6% tổng giá trị vốn hóa toàn bộ HOSE.
- 10/30 cổ phiếu có giá trị vốn hóa đạt 1 tỷ USD.
- Giá trị vốn hóa của các cổ phiếu dao động từ 137,8 triệu USD (FLC) – 8,5 tỷ USD (VNM)
- Giá trị giao dịch trong ngày đạt 45,1 triệu USD, xấp xỉ mức 50,6% của giá trị giao dịch trong ngày của HOSE.
- 17/30 cổ phiếu có giá trị giao dịch trong ngày đạt 1 triệu USD.

Giá trị giao dịch trong ngày của VN30 dao động từ 0,34 triệu USD (REE) – 5,0 triệu USD (HPG).



BIỂU ĐỒ KẾT QUẢ HOẠT ĐỘNG

Từ ngày 08-09-2023 Đến ngày 08-09-2024



LỢI SUẤT ĐẦU TƯ

Tại ngày: 31/07/2024

|               | NAV/đvq & Index | 1 tháng | 3 tháng | Kể từ đầu năm | 12 tháng | Kể từ khi thành lập 14/08/2014 |
|---------------|-----------------|---------|---------|---------------|----------|--------------------------------|
| ETF DCVFMVN30 | 22.689,70       | 1,90    | 6,00    | 16,20         | 7,30     | 126,90                         |
| VN30-TRI      | 1.532,20        | 1,90    | 6,30    | 16,70         | 8,10     | 141,10                         |

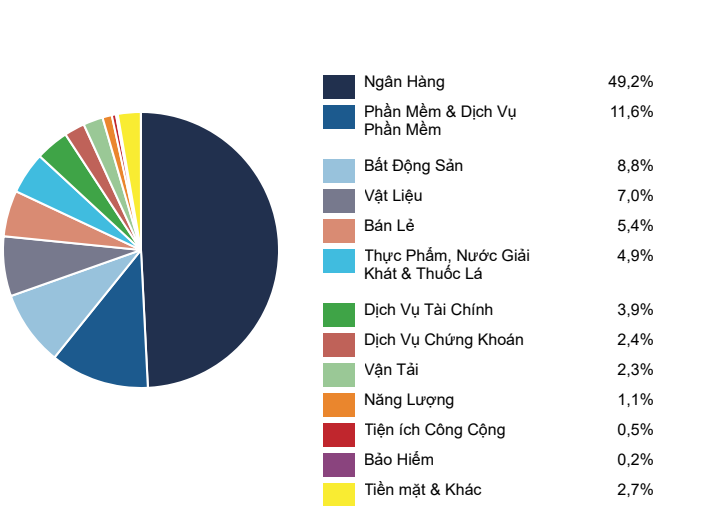
10 KHOẢN ĐẦU TƯ LỚN

Tại ngày: 31/07/2024

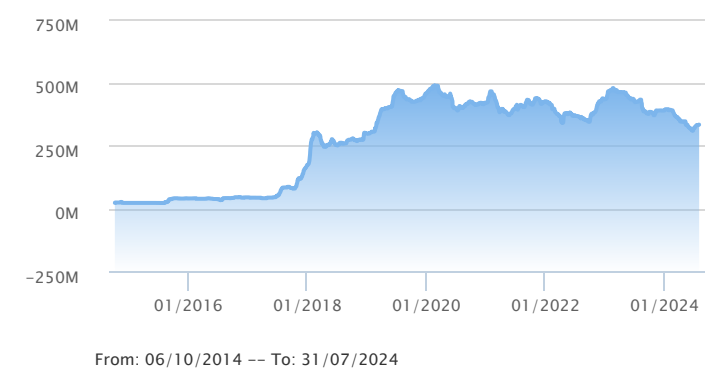
| Cổ phiếu  | Số lượng   | Giá trị | Tỉ trọng NAV (%) | Sở hữu nước ngoài/room |
|-----------|------------|---------|------------------|------------------------|
| FPT       | 6.762.541  | 869,7   | 11,6             | 92,0                   |
| TCB       | 24.969.850 | 580,5   | 7,7              | 95,5                   |
| ACB       | 21.951.211 | 538,9   | 7,2              | 100,0                  |
| HPG       | 19.218.266 | 522,7   | 7,0              | 49,8                   |
| VPB       | 25.958.869 | 493,2   | 6,6              | 88,0                   |
| MWG       | 6.392.416  | 407,8   | 5,4              | 94,8                   |
| MBB       | 15.693.744 | 382,9   | 5,1              | 100,0                  |
| VNM       | 4.556.529  | 326,2   | 4,3              | 50,2                   |
| HDB       | 11.873.366 | 312,3   | 4,2              | 91,0                   |
| VCB       | 3.352.969  | 299,1   | 4,0              | 77,4                   |
| Tổng cộng |            |         | 63,1             |                        |

PHÂN BỐ TÀI SẢN THEO NGÀNH

Tại ngày: 31/07/2024



SỐ LƯỢNG CHỨNG CHỈ QUỸ



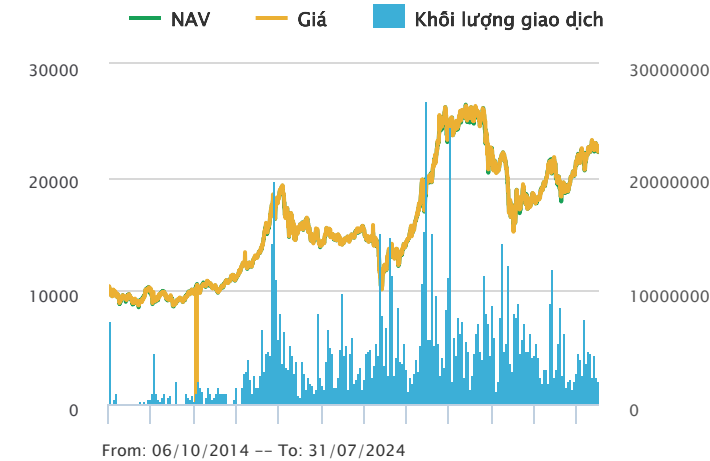
ĐẶC TRƯNG DANH MỤC

Tại ngày: 31/07/2024

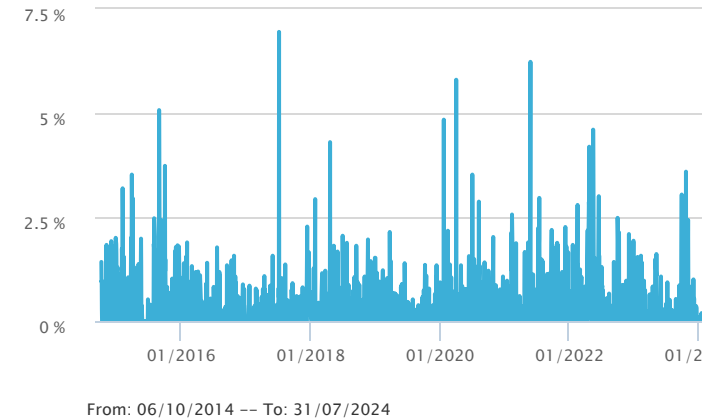
| Chỉ số cơ bản               | E1VFN30 | VN-Index |
|-----------------------------|---------|----------|
| Chỉ số P/E                  | 11,2    | 13,9     |
| Chỉ số P/B                  | 1,7     | 1,7      |
| Tỷ suất sinh lời cổ tức (%) | 2,1     | 2,0      |
| Số lượng cổ phiếu           | 30      | 398      |

| Hệ số rủi ro         | E1VFN30 | VN-Index |
|----------------------|---------|----------|
| Hệ số Beta           | 1,0     | 1,0      |
| Độ biến động năm (%) | 17,6    | 17,0     |
| Hệ số Sharpe         | 0,1     | -0,2     |

BIỂU ĐỒ THÔNG TIN GIAO DỊCH



MỨC CHÊNH LỆCH GIÁ VÀ NAV



KHUYẾN CÁO

Tài liệu này được viết và phát hành bởi công ty Dragon Capital Việt Nam (DCVFM). Các thông tin trong tài liệu được công ty DCVFM xem là đáng tin cậy, dựa trên các nguồn đã công bố ra công chúng và công ty DCVFM không chịu trách nhiệm về độ chính xác của những thông tin trong tài liệu này, ngoại trừ những thông tin, số liệu của các Quỹ do Công ty DCVFM quản lý, được cung cấp trong tài liệu này. Tài liệu này thể hiện quan điểm, đánh giá của người viết tại thời điểm phát hành, 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 Công ty DCVFM hay các Quỹ do Công ty DCVFM quản lý. Công ty DCVFM 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