

- 我們預期國內 ETF 將於 2024 年 2 月 2 日進行調整。
- 預期 VN30 指數與 VNFIN Lead 指數的成分股將維持不變。
- 由於這次不是定期調整，VN Diamond 指數的成分股將不會調整，僅調整其成分股的相關權重。

指數	公布日	調整日	生效日	PHS 之預期
VN30	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	不改變
VNFIN Lead	15/01/2024	02/02/2024	05/02/2024	不改變

1. VN30 指數及 DCVFMVN30 ETF 的調整

據 12 月 28 日的數據，我們預期這次調整，VN30 指數成分股將維持不變。追蹤 VN30 指數的 ETFs 將在 VN30 指數生效前進行調整。目前追蹤 VN30 指數的四檔國內 ETF 為 DCVFMVN30 ETF、KIM GROWTH VN30 ETF、SSIAM VN30 ETF 及 MAFM VN30 ETF，資產規模加總約 8.6 兆越盾。其中 DCVFMVN30 ETF 的資產規模最大，約 7.5 兆越盾。我們預期 DCVFMVN30 ETF 之調整將如下：

股票代碼	權重 (%)			淨買/賣股數	備註
	調整前	調整後	變更		
VPB	7.66%	8.87%	1.21%	4,822,599	
FPT	9.00%	8.86%	-0.14%	(107,090)	
HPG	7.71%	7.59%	-0.12%	(313,854)	
ACB	7.16%	7.05%	-0.11%	(343,370)	
TCB	6.28%	6.13%	-0.15%	(367,055)	
VNM	4.94%	4.87%	-0.08%	(83,358)	
VHM	4.89%	4.85%	-0.04%	(73,986)	
MBB	4.59%	4.52%	-0.07%	(286,118)	
STB	4.49%	4.42%	-0.07%	(182,469)	
VIC	4.39%	4.33%	-0.06%	(93,931)	
VCB	4.39%	4.32%	-0.07%	(58,909)	
MWG	4.34%	4.28%	-0.06%	(111,035)	
MSN	3.73%	3.67%	-0.06%	(66,917)	
HDB	3.38%	3.33%	-0.05%	(203,645)	
SSI	2.99%	2.94%	-0.04%	(98,931)	
SSB	2.75%	2.76%	0.01%	18,183	
VJC	2.77%	2.73%	-0.04%	(28,864)	
SHB	2.70%	2.66%	-0.04%	(284,866)	
VIB	2.18%	2.33%	0.14%	551,653	
TPB	1.97%	1.94%	-0.03%	(131,099)	
CTG	1.88%	1.85%	-0.03%	(79,367)	
VRE	1.86%	1.81%	-0.05%	(157,650)	
BID	0.84%	0.83%	-0.01%	(17,924)	
SAB	0.75%	0.75%	-0.01%	(9,945)	
GAS	0.75%	0.74%	-0.01%	(11,879)	
POW	0.45%	0.45%	-0.01%	(48,343)	
PLX	0.38%	0.37%	-0.01%	(11,867)	
GVR	0.28%	0.28%	-0.01%	(19,063)	
BVH	0.25%	0.25%	0.00%	(4,822)	
BCM	0.22%	0.22%	0.00%	(2,497)	

分析師

Phạm Quang Chương
chuongpham@phs.vn

資料來源：PHS