

19/06/2024

分析師

Pham Quang Chuong
chuongpham@phs.vn

2024 年第二季境外 ETF 定期調整之預期

- 據 FTSE 之公布，FTSE Vietnam 指數的成分股將新增 TCH，尚未有任何股被移除。
- 據 MarketVector 之公布，MarketVector Vietnam Local 指數的成分股將新增 CTR 及 EVF，尚未有任何股被移除。
- 預期在 FTSE Vietnam 指數及 MarketVector Vietnam Local 指數成分股之調整於 6 月 24 日生效前，境外 ETF 將於 6 月 21 日進行調整。

XTRACKER FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF 調整之預期

據 2024 年 6 月 7 日 FTSE 公布 FTSE Vietnam Index Series 的調整顯示，FTSE Vietnam All-Share Index 將新增 CMG、PVT 及 CTR，尚未有任何股被移除。至於 FTSE Vietnam Index，該指數將新增 TCH，不如我們的原預期 (新增 KDH 及 TCH)，成分股的權重因之也會變動。在調整後，其指數的成分股將提升至 28 隻。

依截至 2024 年 6 月 14 日之數據，我們預期追蹤 FTSE Vietnam Index 的 Xtracker FTSE Vietnam Swap UCITS ETF 將買進 450 萬 TCH 股，賣出 370 萬 NVL 股 (NVL 股被賣出最多)

Xtracker FTSE Vietnam Swap UCITS ETF 調整之預期

股票代碼	調整前	調整後	變動	淨買/賣股數	備註
HPG	14.98%	14.74%	-0.24%	-671,319	
VIC	8.49%	8.74%	0.25%	484,774	
VHM	8.21%	8.26%	0.06%	118,143	
VCB	8.19%	8.14%	-0.06%	-50,835	
MSN	8.21%	8.04%	-0.16%	-169,165	
VNM	7.87%	7.96%	0.10%	120,720	
SSI	6.95%	6.71%	-0.24%	-522,450	
DGC	3.72%	3.68%	-0.04%	-26,607	
VRE	3.18%	3.26%	0.08%	315,401	
VND	3.18%	3.16%	-0.02%	-93,834	
VJC	2.80%	2.82%	0.02%	18,314	
VCI	2.37%	2.31%	-0.06%	-101,895	
SHB	2.09%	2.04%	-0.05%	-317,897	
KBC	1.87%	1.91%	0.04%	102,317	
VIX	1.94%	1.89%	-0.05%	-204,569	
EIB	1.59%	1.64%	0.05%	217,068	
GEX	1.66%	1.62%	-0.04%	-142,582	
NVL	2.22%	1.57%	-0.65%	-3,704,824	
PVD	1.40%	1.39%	-0.01%	-20,198	
DIG	1.35%	1.35%	0.00%	7,465	
PDR	1.84%	1.27%	-0.57%	-1,776,404	
EVF	0.85%	1.26%	0.41%	2,201,125	
DPM	1.16%	1.20%	0.04%	83,780	
HSG	1.17%	1.12%	-0.04%	-150,712	
TCH		1.08%	1.08%	4,539,336	新增