

1. CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ XTRACKERS FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF

Ngày chốt dữ liệu: 25/11/2022
 Ngày công bố: 02/12/2022
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/12/2022

Dựa vào số liệu tính toán đến ngày 23/11/2022, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ loại ra một cổ phiếu HSG do vi phạm tiêu chí vốn hóa có thể đầu tư. Ngược lại, không có cổ phiếu nào thỏa mãn điều kiện để thêm vào. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap Ucits ETF – quỹ mô phỏng chỉ số FTSE Vietnam Index như sau.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VIC	15.52%	15.00%	-0.52%	(448,865)	
2	MSN	12.52%	12.67%	0.15%	82,284	
3	VHM	12.28%	12.42%	0.15%	168,836	
4	VNM	12.14%	12.28%	0.14%	93,350	
5	HPG	8.31%	8.41%	0.10%	367,766	
6	VRE	6.15%	6.23%	0.07%	143,716	
7	VCB	5.80%	5.87%	0.07%	48,196	
8	SSI	3.58%	3.63%	0.04%	138,498	
9	VJC	3.45%	3.49%	0.04%	20,972	
10	NVL	3.31%	3.35%	0.04%	85,569	
11	STB	2.09%	2.12%	0.02%	73,000	
12	DGC	2.00%	2.02%	0.02%	23,480	
13	VND	1.34%	1.35%	0.02%	77,024	
14	KBC	1.22%	1.23%	0.01%	44,616	
15	DPM	1.20%	1.21%	0.01%	20,205	
16	VCI	1.19%	1.20%	0.01%	37,756	
17	PLX	1.09%	1.11%	0.01%	25,076	
18	GEX	1.08%	1.10%	0.01%	53,854	
19	POW	1.04%	1.05%	0.01%	60,630	
20	PDR	1.03%	1.05%	0.01%	42,479	
21	PVD	0.74%	0.75%	0.01%	33,285	
22	VCG	0.65%	0.66%	0.01%	30,516	
23	DIG	0.64%	0.64%	0.01%	32,102	
24	DXG	0.60%	0.61%	0.01%	51,891	
25	TCH	0.55%	0.56%	0.01%	42,262	
	HSG	0.48%		-0.48%	(2,857,275)	Loại

Nguồn: PHS

2. CHỈ SỐ MVIS VIETNAM INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ VANECK VECTORS VIETNAM ETF

Ngày chốt dữ liệu: 30/11/2022
 Ngày công bố: 09/12/2022
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/12/2022

Với chỉ số MVIS Vietnam Index, chúng tôi cho rằng danh mục của bộ chỉ số này sẽ có sự biến động mạnh trong kỳ cơ cấu tới đây. Cụ thể, HNG, HSG, BCG, DXG, ITA là những cổ phiếu có thể bị loại ra do không đáp ứng được tiêu chí vốn hóa điều chỉnh free-float. Ngoài ra, một số trường hợp khác như HUT, SHS và HDG cũng đang ở ngưỡng báo động và có khả năng bị loại nếu vốn hóa giảm mạnh hơn cho đến ngày chốt dữ liệu. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra bảng cơ cấu của quỹ VanEck Vectors Vietnam ETF – mô phỏng bộ chỉ số MVIS Vietnam Index như sau.