

27/02/2024

### CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện cơ cấu danh mục quý 1 vào ngày 15/03/2024.
- Chúng tôi dự báo FTSE Vietnam Index sẽ thêm mới EVF và không loại ra mã nào.
- FTSE Vietnam 30 Index dự kiến sẽ thêm mới NVL & EIB, đồng thời loại ra SBT và DPM.
- MarketVector Vietnam Local Index dự kiến sẽ thêm mới FTS và không loại ra mã nào.

Chỉ số	Ngày thông báo	Ngày cơ cấu của quỹ	Ngày hiệu lực của chỉ số	Dự báo của PHS
FTSE Vietnam Index	01/03/2024	15/03/2024	18/03/2024	Thêm EVF
FTSE Vietnam 30 Index		15/03/2024	18/03/2024	Thêm NVL, EIB – Loại SBT, DPM
MarketVector Vietnam Local Index	08/03/2024	15/03/2024	18/03/2024	Thêm FTS

### FTSE Vietnam Index và cơ cấu quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 23/02, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ thêm mới một cổ phiếu là EVF. Đây là cổ phiếu có thể được thêm mới vào bộ chỉ số FTSE Vietnam All-share Index trong kỳ này. Ngược lại, không có cổ phiếu nào bị loại ra. Quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ thực hiện tái cơ cấu trước khi bộ chỉ số mới có hiệu lực. Chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ như sau:

MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
	Hiện tại	Mới	Thay đổi		
HPG	13.70%	13.74%	0.05%	150,339	
VHM	9.59%	9.62%	0.03%	69,019	
VIC	9.41%	9.47%	0.06%	111,146	
VNM	8.69%	8.72%	0.03%	38,161	
VCB	8.57%	8.61%	0.03%	30,070	
MSN	7.23%	7.26%	0.03%	33,805	
SSI	6.77%	6.79%	0.02%	61,803	
VRE	3.88%	3.90%	0.01%	47,561	
DGC	3.15%	3.16%	0.01%	9,819	
VJC	2.85%	2.86%	0.01%	8,573	
VND	3.24%	2.24%	-1.00%	-3,941,546	
VCI	2.17%	2.18%	0.01%	15,527	
KBC	1.95%	1.96%	0.01%	19,846	
VIX	1.92%	1.92%	0.01%	34,165	
NVL	2.61%	1.91%	-0.70%	-3,555,850	
SHB	2.18%	1.87%	-0.30%	-2,218,533	
EIB	1.62%	1.63%	0.01%	27,557	
GEX	1.57%	1.58%	0.01%	22,464	
<b>EVF</b>		<b>1.52%</b>	<b>1.52%</b>	<b>7,266,350</b>	<b>Thêm</b>
DIG	1.32%	1.33%	0.00%	15,768	
PVD	1.31%	1.31%	0.00%	14,372	
PDR	1.11%	1.23%	0.12%	359,097	
HSG	1.13%	1.14%	0.00%	15,926	
DXG	1.09%	1.10%	0.01%	70,472	
DPM	1.09%	1.09%	0.00%	10,118	
VCG	0.92%	0.93%	0.00%	11,959	
POW	0.91%	0.92%	0.00%	24,785	

(Nguồn: PHS)