

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục quý 1/2024 vào ngày 15/03/2024.
- FTSE Vietnam Index: Thêm EVF và không loại mã nào.
- MarketVector Vietnam Local Index: Thêm FTS và không loại mã nào.
- PHS điều chỉnh dự báo thay đổi chỉ số FTSE Vietnam 30 Index: HCM bị loại ra do vi phạm tiêu chí free-float. Ngược lại, EIB hoặc FRT có thể được lựa chọn để thay thế.

Dự báo cơ cấu quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF

Vào ngày 01/03 vừa qua, FTSE Russell đã công bố kết quả thay đổi danh mục định kỳ của các bộ chỉ số FTSE Vietnam Index Series.

Kết quả chính thức giống với dự đoán của chúng tôi trong báo cáo trước đó khi EVF là cổ phiếu duy nhất được thêm vào bộ chỉ số FTSE Vietnam Index, đồng thời không loại ra cổ phiếu nào. Ước tính tỷ trọng mới của EVF sau khi vào rổ FTSE Vietnam Index là 1.49%. Với FTSE Vietnam All-Share Index, bộ chỉ số này đã thêm mới EVF, OCB, đồng thời không loại ra cổ phiếu nào. Dựa trên danh mục vào ngày 8/3/2024 của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index, 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	13.99%	14.02%	0.04%	104,884	
VHM	9.02%	9.34%	0.32%	673,025	
VIC	8.93%	9.02%	0.09%	184,527	
VCB	8.78%	8.93%	0.15%	136,793	
VNM	8.20%	8.40%	0.20%	248,132	
MSN	8.15%	7.04%	-1.11%	-1,251,044	
SSI	6.98%	6.80%	-0.18%	-438,860	
VRE	3.71%	4.03%	0.32%	1,117,948	
DGC	3.60%	3.31%	-0.29%	-216,712	
VND	3.30%	3.16%	-0.15%	-550,412	
VJC	2.73%	2.70%	-0.03%	-23,595	
VCI	2.28%	2.14%	-0.14%	-266,855	
SHB	2.06%	2.10%	0.04%	339,956	
VIX	2.04%	1.89%	-0.15%	-683,096	
KBC	2.02%	1.89%	-0.13%	-346,309	
NVL	2.43%	1.81%	-0.61%	-3,287,025	
GEX	1.56%	1.54%	-0.01%	-57,701	
EIB	1.50%	1.54%	0.04%	197,534	
EVF		1.49%	1.49%	7,599,835	Thêm
PVD	1.36%	1.35%	-0.01%	-28,342	
DIG	1.29%	1.30%	0.01%	40,965	
PDR	1.07%	1.19%	0.13%	402,181	
HSG	1.10%	1.11%	0.02%	64,449	
DPM	1.10%	1.08%	-0.03%	-66,062	
DXG	1.04%	1.05%	0.00%	12,716	
VCG	0.90%	0.89%	0.00%	-16,990	
POW	0.89%	0.89%	0.00%	8,243	

(Nguồn: PHS)