

28/05/2024

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

DỰ BÁO THAY ĐỔI CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX VÀ MARKETVECTOR VIETNAM LOCAL INDEX QUÝ 2/2024

- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục quý 2/2024 vào ngày 21/06/2024.
- FTSE Vietnam Index: Thêm KDH, TCH và không loại mã nào.
- MarketVector Vietnam Local Index: Thêm BSR, QNS, EVF, CTR và không loại 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	07/06/2024	21/06/2024	24/06/2024	Thêm KDH, TCH
MarketVector Vietnam Local Index	14/06/2024	21/06/2024	24/06/2024	Thêm BSR, QNS, EVF, CTR

DỰ BÁO THAY ĐỔI CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX

Dựa trên dữ liệu tính toán đến ngày 23/05, **PHS dự báo có 2 cổ phiếu có thể đáp ứng điều kiện để được thêm mới vào bộ chỉ số FTSE Vietnam Index trong kỳ cơ cấu lần này là KDH và TCH. Ngược lại, không có cổ phiếu nào bị loại.** 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 ETF như sau:

Bảng 1: Dự báo cơ cấu danh mục của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF

Mã CK	Tỷ trọng hiện tại	Tỷ trọng mới	Thay đổi tỷ trọng	SLCP mua/bán ròng	Chú thích
HPG	14.83%	14.43%	-0.40%	-1,140,713	
VIC	8.99%	8.74%	-0.24%	-447,719	
VHM	8.51%	8.28%	-0.23%	-476,079	
VCB	8.32%	8.09%	-0.22%	-207,417	
MSN	7.79%	7.58%	-0.21%	-233,181	
VNM	7.77%	7.56%	-0.21%	-263,226	
SSI	6.89%	6.75%	-0.14%	-323,595	
DGC	3.81%	3.71%	-0.10%	-67,730	
VRE	3.33%	3.24%	-0.09%	-328,068	
VJC	2.90%	2.82%	-0.08%	-59,138	
VND	2.87%	2.79%	-0.07%	-303,760	
VCI	2.36%	2.30%	-0.06%	-107,102	
KDH		2.27%	2.27%	5,182,762	Thêm
SHB	2.05%	2.01%	-0.03%	-223,551	
VIX	1.91%	1.86%	-0.05%	-235,664	
KBC	1.91%	1.85%	-0.05%	-136,895	
GEX	1.62%	1.57%	-0.04%	-154,955	
EIB	1.55%	1.51%	-0.04%	-190,082	
NVL	2.21%	1.49%	-0.72%	-4,194,304	
PVD	1.44%	1.40%	-0.04%	-99,137	
DIG	1.40%	1.36%	-0.04%	-108,761	
PDR	1.86%	1.27%	-0.59%	-1,878,408	
EVF	0.91%	1.25%	0.34%	1,737,724	
DPM	1.14%	1.11%	-0.03%	-69,791	