

17/09/2024

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương
chuongpham@phs.vn

DỰ BÁO CƠ CẤU DANH MỤC ĐỊNH KỲ CỦA CÁC QUỸ ETF NGOẠI KỲ QUÝ 3/2024

- FTSE công bố kết quả thay đổi bộ chỉ số FTSE Vietnam Index với việc thêm vào 3 cổ phiếu mới là KDH, FRT và FTS, đồng thời không có mã nào bị loại ra.
- Trong khi đó, theo công bố của Market Vector, chỉ số MarketVector Vietnam Local Index sẽ loại ra cổ phiếu EVF và không thêm vào bất kỳ mã nào.
- Đối với FTSE Vietnam 30 Index – chỉ số tham chiếu của quỹ Fubon FTSE Vietnam ETF, PHS dự báo cổ phiếu VCG sẽ bị loại ra và NAB sẽ được chọn để thay thế.
- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 20/09 tới đây, trước khi thay đổi của các bộ chỉ số chính thức có hiệu lực vào ngày 23/09.

DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ XTRACKERS FTSE VIETNAM UCITS ETF

Vào ngày 06/09/2024, FTSE Russell đã công bố kết quả thay đổi của các bộ chỉ số FTSE Vietnam Index Series. Cụ thể, chỉ số FTSE Vietnam All-share Index không thay đổi danh mục trong kỳ đánh giá này. Trong khi đó, chỉ số FTSE Vietnam Index – chỉ số tham chiếu của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam UCITS ETF sẽ thêm vào 3 cổ phiếu mới là KDH, FRT và FTS, đồng thời không loại ra mã nào. Kết quả này phù hợp với dự báo trước đó của chúng tôi. Số lượng cổ phiếu trong danh mục sau thay đổi tăng lên thành 31 mã.

Dựa trên danh mục của quỹ tính đến ngày 13/09/2024, chúng tôi dự báo Xtrackers FTSE Vietnam UCITS ETF sẽ mua vào lần lượt khoảng 5.2 triệu cổ phiếu KDH, 0.8 triệu cổ phiếu FRT và 1.9 triệu cổ phiếu FTS. Trong khi đó, hầu hết các mã còn lại sẽ bị bán giảm tỷ trọng, đặc biệt là HPG và VHM với lần lượt 2.6 triệu và 1.4 triệu cổ phiếu.

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

Mã CK	Tỷ trọng hiện tại	Tỷ trọng mới	Thay đổi tỷ trọng	SLCP mua/bán ròng	Chú thích
HPG	13.30%	12.39%	-0.91%	-2,604,262	
VHM	9.55%	8.70%	-0.84%	-1,403,736	
VIC	8.96%	8.47%	-0.48%	-806,609	
VNM	8.95%	8.41%	-0.54%	-526,367	
VCB	8.70%	8.12%	-0.58%	-459,236	
MSN	8.11%	7.59%	-0.52%	-500,204	
SSI	6.46%	6.12%	-0.35%	-764,236	
DGC	3.59%	3.36%	-0.23%	-144,248	
VRE	2.95%	2.78%	-0.17%	-640,675	
KDH		2.71%	2.71%	5,195,565	Thêm
VJC	2.89%	2.65%	-0.24%	-161,890	
VIX	2.67%	2.62%	-0.05%	-346,327	
VND	2.63%	2.59%	-0.04%	-215,514	
VCI	2.18%	2.12%	-0.05%	-116,505	
NVL	1.87%	1.94%	0.06%	396,327	
FRT		1.91%	1.91%	762,378	Thêm
SHB	1.92%	1.79%	-0.13%	-916,515	