

29/11/2024

## CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

## DỰ BÁO THAY ĐỔI CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX VÀ MVIS VIETNAM LOCAL INDEX KỲ QUÝ 4/2024

- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện cơ cấu danh mục vào ngày 20/12 trước khi các bộ chỉ số có hiệu lực vào ngày 23/12.
- PHS đưa ra dự báo như sau:  
FTSE Vietnam Index: Thêm VTP, VPI – Loại NVL, EVF  
MVIS Vietnam Local Index: Giữ nguyên danh mục

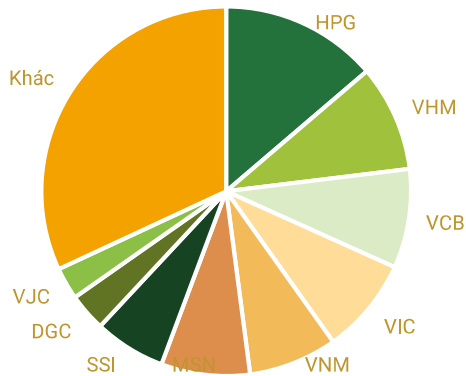
Chỉ số	Ngày thông báo	Ngày cơ cấu của quỹ	Ngày hiệu lực của chỉ số	Dự báo của PHS
FTSE Vietnam Index	06/12/2024	20/12/2024	23/12/2024	Thêm VTP, VPI – Loại NVL, EVF
MVIS Vietnam Local Index	13/12/2024	20/12/2024	23/12/2024	Giữ nguyên danh mục

## DỰ BÁO THAY ĐỔI CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX

Dựa trên dữ liệu tính toán đến ngày 25/11, **PHS dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ thêm vào 2 cổ phiếu mới bao gồm VTP và VPI. Trong đó, VTP là "tân binh" sẽ được thêm mới vào bộ chỉ số chung FTSE Vietnam All-share Index trong kỳ này và đồng thời đủ điều kiện để được thêm vào bộ chỉ số FTSE Vietnam Index. Với trường hợp của VPI, hiện tiêu chí thanh khoản của cổ phiếu này chỉ vừa tiệm cận mức yêu cầu tối thiểu. Do đó, nếu có sự biến động đáng kể tại ngày chốt dữ liệu cuối cùng, VPI vẫn có khả năng không được thêm mới.**

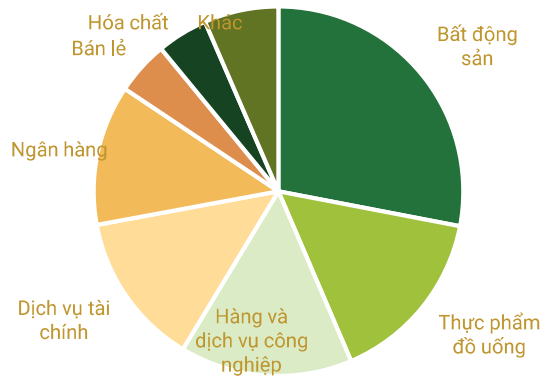
**Ngược lại, NVL (rơi vào diện cảnh cáo của HOSE) và EVF (vi phạm tiêu chí free-float) là những cái tên bị loại ra ở cả hai bộ chỉ số FTSE Vietnam All-share Index và FTSE Vietnam Index.**

**Hình 1: Tỷ trọng cổ phiếu thành phần của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam UCITS ETF ngày 25/11/2024**



Nguồn: Bloomberg, PHS tổng hợp

**Hình 2: Tỷ trọng phân theo nhóm ngành của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam UCITS ETF ngày 25/11/2024**



Nguồn: Bloomberg, PHS tổng hợp

Chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam UCITS ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index như sau: