

1. CHỈ SỐ FTSE VIETNAM INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ XTRACKER FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF

Ngày chốt dữ liệu: 24/02/2023
 Ngày công bố: 03/03/2023
 Ngày cơ cấu danh mục: 17/03/2023

Dựa vào số liệu tính toán đến ngày 22/02/2023, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ có nhiều thay đổi trong kỳ cơ cấu sắp tới. SHB và EIB là những cổ phiếu được dự báo thêm vào. Trong khi đó, PLX (không đáp ứng tiêu chí thanh khoản), STB (không đáp ứng tiêu chí sở hữu nước ngoài) là những cổ phiếu có thể bị loại ra. Với giả định trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ XTRACKER FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF – quỹ mô phỏng chỉ số FTSE Vietnam Index như trong bảng dưới đây.

STT	MCK	Tỷ trọng (%)			SLCP mua/bán ròng	Chú thích
		Hiện tại	Mới	Thay đổi		
1	VIC	12.67%	12.81%	0.15%	206,197	
2	HPG	11.74%	11.87%	0.14%	477,596	
3	MSN	11.27%	11.40%	0.13%	106,857	
4	VHM	10.83%	10.95%	0.13%	219,258	
5	VNM	10.61%	10.73%	0.12%	121,228	
6	VCB	8.72%	8.82%	0.10%	80,885	
7	VRE	4.92%	4.98%	0.06%	151,092	
8	SSI	4.36%	4.41%	0.05%	195,025	
9	VJC	3.18%	3.22%	0.04%	27,236	
10	DGC	1.87%	1.89%	0.02%	30,492	
11	SHB		1.83%	1.83%	13,437,287	Thêm
12	KBC	1.70%	1.72%	0.02%	63,048	
13	EIB		1.71%	1.71%	6,463,941	Thêm
14	VND	1.66%	1.68%	0.02%	100,027	
15	NVL	1.55%	1.56%	0.02%	111,124	
16	VCI	1.53%	1.55%	0.02%	49,031	
17	DPM	1.34%	1.36%	0.02%	32,142	
18	PVD	1.13%	1.14%	0.01%	45,658	
19	POW	1.10%	1.11%	0.01%	78,737	
20	GEX	1.03%	1.05%	0.01%	71,365	
21	HSG	0.85%	0.86%	0.01%	48,638	
22	DIG	0.83%	0.84%	0.01%	50,090	
23	VCG	0.82%	0.83%	0.01%	34,297	
24	DXG	0.65%	0.65%	0.00%	(32,183)	
25	TCH	0.51%	0.52%	0.01%	57,124	
26	PDR	0.50%	0.51%	0.01%	39,425	
	PLX	1.92%		-1.92%	(3,736,577)	Loại
	STB	2.71%		-2.71%	(8,165,053)	Loại

Nguồn: PHS