

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

Ngày chốt dữ liệu: 26/05/2023
 Ngày công bố: 02/06/2023
 Ngày cơ cấu danh mục: 16/06/2023

Dựa trên số liệu tính toán đến ngày 22/05, chúng tôi dự báo chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ thêm vào 1 cổ phiếu trong kỳ review lần này là KDC. Ngược lại, VJC là cổ phiếu bị loại ra do không đáp ứng được tiêu chí về thanh khoản. Với giả định như trên, chúng tôi đưa ra dự báo cơ cấu của quỹ Xtracker FTSE Vietnam Swap Ucits ETF – mô phỏng bộ 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	VHM	13.67%	13.86%	0.19%	276,045	
2	VIC	12.38%	12.56%	0.17%	259,602	
3	HPG	12.06%	12.22%	0.17%	601,293	
4	VNM	9.53%	9.66%	0.13%	152,626	
5	MSN	8.87%	8.99%	0.12%	134,533	
6	VCB	8.68%	8.80%	0.12%	101,835	
7	SSI	5.15%	5.22%	0.07%	245,536	
8	VRE	4.86%	4.93%	0.07%	190,224	
9	SHB	2.13%	2.16%	0.03%	194,168	
10	KBC	1.98%	2.01%	0.03%	79,377	
11	VCI	1.93%	1.96%	0.03%	61,730	
12	VND	1.87%	1.89%	0.03%	125,934	
13	DGC	1.81%	1.84%	0.03%	39,272	
14	KDC		1.77%	1.77%	2,152,662	Thêm
15	NVL	1.71%	1.73%	0.02%	139,905	
16	EIB	1.68%	1.70%	0.02%	93,403	
17	PVD	1.24%	1.26%	0.02%	57,483	
18	POW	1.23%	1.25%	0.02%	99,130	
19	GEX	1.19%	1.21%	0.02%	89,848	
20	DIG	1.18%	1.20%	0.02%	63,063	
21	DPM	1.16%	1.18%	0.02%	40,467	
22	HSG	0.91%	0.92%	0.01%	61,236	
23	DXG	0.84%	0.85%	0.01%	64,283	
24	VCG	0.81%	0.82%	0.01%	43,180	
	VJC	3.11%		-3.11%	(2,466,391)	Loại

Nguồn: Bloomberg, PHS

2. CHỈ SỐ MARKETVECTOR VIETNAM LOCAL INDEX VÀ DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ VANECK VECTORS VIETNAM ETF