

19/06/2024

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 2/2024

- FTSE công bố kết quả thay đổi của bộ chỉ số FTSE Vietnam Index với việc thêm vào TCH và không loại ra cổ phiếu nào.
- MarketVector công bố kết quả thay đổi của bộ chỉ số MarketVector Vietnam Local Index với việc thêm vào CTR, EVF và không loại ra cổ phiếu nào.
- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 21/6 tới đây, trước khi thay đổi của các bộ chỉ số chính thức có hiệu lực vào ngày 24/06.

DỰ BÁO CƠ CẤU QUỸ XTRACKER FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF

FTSE đã công bố kết quả thay đổi của các bộ chỉ số FTSE Vietnam index Series vào ngày 07/06/2024. Cụ thể, FTSE Vietnam All-Share Index thêm mới 3 cổ phiếu là CMG, PVT, CTR và không loại ra cổ phiếu nào. **Với FTSE Vietnam Index, chỉ số này đã thêm mới TCH và không loại ra cổ phiếu nào. Kết quả này khác so với dự báo trước đó của chúng tôi (Thêm mới KDH, TCH) vì vậy tỷ trọng của các cổ phiếu cũng có sự điều chỉnh. Số lượng cổ phiếu trong danh mục sau thay đổi tăng lên thành 28 mã.**

Dựa trên số liệu tính đến ngày 14/06/2024, chúng tôi dự báo quỹ Xtracker FTSE Vietnam Swap UCITS ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index sẽ mua vào khoảng 4.5 triệu cổ phiếu TCH. Ngược lại, NVL sẽ là cổ phiếu bị bán ra mạnh nhất với 3.7 triệu cổ phiếu.

Bảng 1: Dự báo cơ cấu danh mục của quỹ Xtracker 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	14.98%	14.74%	-0.24%	-671,319	
VIC	8.49%	8.74%	0.25%	484,774	
VHM	8.21%	8.26%	0.06%	118,143	
VCB	8.19%	8.14%	-0.06%	-50,835	
MSN	8.21%	8.04%	-0.16%	-169,165	
VNM	7.87%	7.96%	0.10%	120,720	
SSI	6.95%	6.71%	-0.24%	-522,450	
DGC	3.72%	3.68%	-0.04%	-26,607	
VRE	3.18%	3.26%	0.08%	315,401	
VND	3.18%	3.16%	-0.02%	-93,834	
VJC	2.80%	2.82%	0.02%	18,314	
VCI	2.37%	2.31%	-0.06%	-101,895	
SHB	2.09%	2.04%	-0.05%	-317,897	
KBC	1.87%	1.91%	0.04%	102,317	
VIX	1.94%	1.89%	-0.05%	-204,569	
EIB	1.59%	1.64%	0.05%	217,068	
GEX	1.66%	1.62%	-0.04%	-142,582	
NVL	2.22%	1.57%	-0.65%	-3,704,824	
PVD	1.40%	1.39%	-0.01%	-20,198	
DIG	1.35%	1.35%	0.00%	7,465	
PDR	1.84%	1.27%	-0.57%	-1,776,404	