

19/03/2025

CHUYÊN VIÊN PHÂN TÍCH

Phạm Quang Chương

chuongpham@phs.vn

DỰ BÁO CƠ CẤU ETF NGOẠI KỲ QUÝ 1/2025 – NAB, VPI ĐƯỢC MUA MẠNH, TÂM ĐIỂM BÁN RÒNG VIC

- Vào ngày 07/03, FTSE đã công bố kết quả thay đổi danh mục định kỳ quý 1/2025 đối với các bộ chỉ số FTSE Vietnam Index Series. Trong đó, chỉ số FTSE Vietnam Index đã thêm mới SIP đồng thời không loại ra cổ phiếu nào.
- MV Index Solutions (MVIS) cũng đã công bố kết quả thay đổi danh mục định kỳ quý 1/2025 của chỉ số MVIS Vietnam Local Index. Theo đó, chỉ số này đã bổ sung thêm NAB và không loại ra cổ phiếu nào.
- Chúng tôi giữ nguyên dự báo như trong báo cáo ETF ngày 28/02 rằng VPI có thể được thêm vào bộ chỉ số FTSE Vietnam 30 Index trong kỳ cơ cấu này và DIG là cổ phiếu sẽ bị loại ra.
- Các quỹ ETF ngoại dự kiến sẽ thực hiện tái cơ cấu danh mục định kỳ vào ngày 21/03 tới đây, trước khi thay đổi của các bộ chỉ số chính thức có hiệu lực vào ngày 24/03.
- Top cổ phiếu có thể được mua ròng nhiều nhất: NAB, VPI, EIB
- Top cổ phiếu có thể bị bán ròng nhiều nhất: VIC, DIG, SHB

DỰ BÁO CƠ CẤU DANH MỤC CỦA QUỸ XTRACKERS FTSE VIETNAM SWAP UCITS ETF

Vào ngày 07/03, FTSE đã công bố kết quả thay đổi danh mục định kỳ quý 1/2025 đối với các bộ chỉ số FTSE Vietnam Index Series. Theo đó, với bộ chỉ số chung FTSE Vietnam All-Share Index, có ba cổ phiếu được thêm mới bao gồm NAB, SIP, HVN đồng thời không có cổ phiếu nào bị loại. **Riêng SIP đã đủ điều kiện để thêm mới vào bộ chỉ số FTSE Vietnam Index, qua đó nâng tổng số lượng cổ phiếu trong danh mục của FTSE Vietnam Index lên thành 32 mã.**

Dựa trên danh mục của quỹ tính đến ngày 17/03/2025, chúng tôi dự báo hoạt động cơ cấu của quỹ Xtrackers FTSE Vietnam Swap UCITS ETF – mô phỏng bộ chỉ số FTSE Vietnam Index như sau:

Bảng 1: Dự báo cơ cấu danh mục của quỹ Xtrackers 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	13.32%	13.68%	0.36%	880,797	
VHM	9.54%	8.86%	-0.68%	-977,015	
VCB	8.75%	8.40%	-0.36%	-362,570	
VIC	9.78%	8.23%	-1.55%	-2,042,248	
VNM	6.96%	7.18%	0.23%	250,593	
MSN	6.93%	6.96%	0.03%	27,766	
SSI	5.20%	5.22%	0.02%	55,595	
DGC	3.04%	3.24%	0.20%	130,938	
KDH	2.56%	2.68%	0.12%	251,132	
VRE	2.57%	2.54%	-0.04%	-139,538	
VJC	2.46%	2.48%	0.02%	16,523	
VIX	2.65%	2.46%	-0.19%	-1,039,703	
VCI	2.34%	2.32%	-0.02%	-27,664	
VND	2.47%	2.30%	-0.16%	-756,458	
EIB	1.74%	1.95%	0.21%	715,921	