

08/07/2024

分析師

Pham Quang Chuong  
chuongpham@phs.vn

## 2024 年第三季 VN30 指數及 VNFIN LEAD 調整之預期

- 預期國內 ETF 將於 2024 年 8 月 2 日進行調整 2024 年第三季成分股。
- VN30 指數的成分股維持不變。
- VNFIN Lead 指數：新增 SSB、NAB，未移除任何原成分股。

指數	公布日	調整日	指數生效日	PHS 預期
VN30	15/07/2024	02/08/2024	05/08/2024	
VNFIN Lead	15/07/2024	02/08/2024	05/08/2024	新增 SSB、NAB

## VN30 指數調整之預期

依 6 月 28 日之截止數據，PHS 預期 VN30 成分股將維持不變。然 FPT 權重可能由 12% 調降至 10%。由於 FPT 股走升，使在短短兩個月內 FPT 權重已由 9.4% 提升至 12%。依 VN30 指數規定，單一股的權重上限為 10% 及單一族群的權重上限為 15%。因此，在 FPT 權重調降時，其他成分股的權重可望調升。

目前四檔國內 ETF 追蹤 VN30 指數，包括 DCVFMVN30 ETF、KIM GROWTH VN30 ETF、SSIAM VN30 ETF 及 MAFM VN30 ETF。其資產加總為 8,935 兆越盾。其中，DCVFMVN30 ETF 的資產最大，相當於 7,121 兆越盾。我們預期 DCVFMVN30 ETF 將賣出 100 萬 FPT 左右。預期 MBB、SHB、ACB 及 TCB 則獲外資買進。

## DCVFMVN30 ETF 調整之預期

股票代碼	調整前之權重	調整後之權重	變動	淨買/賣股數	備註
FPT	12.0%	10.0%	-2.0%	-1,010,840	
TCB	7.8%	8.0%	0.2%	465,202	
HPG	7.5%	7.7%	0.1%	330,950	
ACB	7.2%	7.4%	0.2%	411,950	
VPB	6.8%	7.0%	0.1%	462,242	
MWG	5.8%	5.9%	0.1%	103,376	
MBB	4.9%	5.0%	0.2%	526,740	
STB	4.2%	4.3%	0.1%	192,633	
VNM	4.2%	4.3%	0.1%	99,574	
MSN	4.1%	4.2%	0.1%	95,159	
VCB	4.0%	4.1%	0.1%	61,005	
HDB	3.8%	3.9%	0.1%	271,939	
VHM	3.7%	3.8%	0.1%	139,865	
VIC	3.6%	3.7%	0.1%	122,296	
SHB	2.7%	2.8%	0.1%	509,684	
SSI	2.7%	2.8%	0.1%	130,563	
VJC	2.3%	2.3%	0.1%	32,385	
SSB	2.1%	2.2%	0.1%	221,721	
CTG	2.0%	2.0%	0.0%	59,814	
VIB	1.8%	1.9%	0.0%	106,076	