

Bộ chỉ số HOSE-Index

Ngày cập nhật: 29/07/2016

HOSE-Index là bộ chỉ số vốn hóa có thể đầu tư được bao gồm các cổ phiếu niêm yết trên Sở GDCK TP.HCM (HOSE) đáp ứng các yêu cầu sàng lọc về tư cách, tỷ lệ tự do chuyển nhượng và thanh khoản. HOSE-Index chiếm hơn 90% giá trị giao dịch và hơn 80% giá trị vốn hóa của toàn thị trường chứng khoán niêm yết tại HOSE.

Cấu trúc Bộ chỉ số HOSE-Index

VNAllshare là chỉ số vốn hóa bao gồm các cổ phiếu niêm yết trên HOSE đáp ứng các yêu cầu sàng lọc về tư cách, tỷ lệ tự do chuyển nhượng và thanh khoản.

VN30 là chỉ số vốn hóa được thiết kế để đo lường mức tăng trưởng của 30 công ty hàng đầu về vốn hóa thị trường và thanh khoản trong VNAllshare.

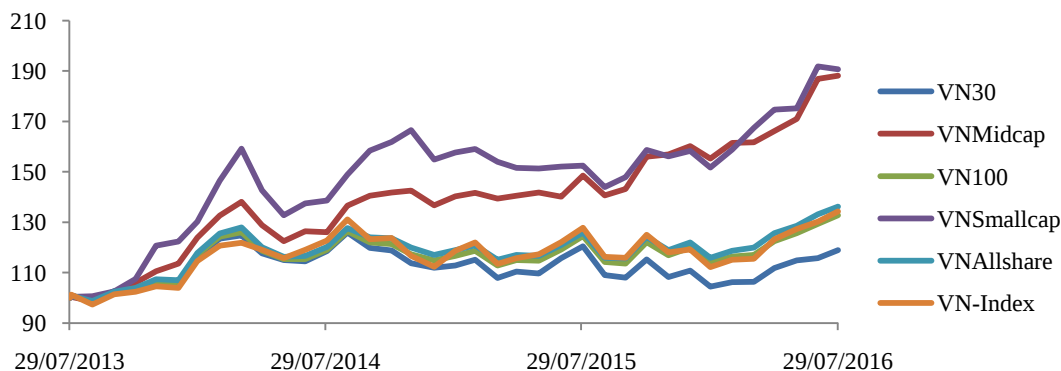
VNMidcap là chỉ số vốn hóa đo lường mức tăng trưởng của 70 công ty có quy mô vừa trong VNAllshare.

VN100 là chỉ số vốn hóa kết hợp các cổ phiếu thành phần của VN30 và VNMidcap.

VNSmallcap là chỉ số vốn hóa được thiết kế để đo lường mức tăng trưởng của các công ty có quy mô nhỏ trong VNAllshare.

VNAllshare Sector Indices bao gồm các chỉ số ngành với các cổ phiếu thành phần của chỉ số VNAllShare được phân ngành theo chuẩn phân ngành Global Industry Classification Standard (GICS®).

Tăng trưởng chỉ số từ 29/07/2013 đến 29/07/2016



* Các chỉ số trên được giả lập tại cơ sở thành 100 vào thời điểm 29/07/2013

Đặc điểm chung

Mục tiêu

Bộ chỉ số được thiết kế với mục đích tham chiếu cho thị trường và làm cơ sở xây dựng các sản phẩm dựa trên chỉ số như quỹ đầu tư theo chỉ số, sản phẩm phái sinh, ...

Khả năng đầu tư

Bộ chỉ số được sàng lọc và tính toán dựa trên tỷ lệ tự do chuyển nhượng để đảm bảo khả năng đầu tư được.

Thanh khoản

Các cổ phiếu thành phần được sàng lọc về thanh khoản để đảm bảo chỉ số có thể giao dịch được.

Minh bạch

Bộ chỉ số sử dụng các quy tắc xây dựng và quản lý minh bạch. Quy tắc xây dựng và quản lý Bộ chỉ số HOSE-Index được công bố trên trang chủ của HOSE.

Tần suất tính toán

Bộ chỉ số được tính theo thời gian thực hoặc tại cuối ngày giao dịch.

Xem xét định kỳ

Bản niên vào tháng 1 và tháng 7 hàng năm

Giới hạn tỷ trọng vốn hóa

10% (VNAllshare Sector không áp dụng)

Phương pháp tính chỉ số

Giá trị vốn hóa điều chỉnh free-float.

Chuẩn phân ngành

Các cổ phiếu thành phần bộ chỉ số được phân ngành theo chuẩn phân ngành Global Industry Classification Standard (GICS®).

Tăng trưởng chỉ số

	Tăng trưởng (%)								Tăng trưởng bình quân năm (%)	
	2013	2014	2015	1 tháng	3 tháng	6 tháng	1 năm	3 năm	5 năm	3 năm
VNAllShare	20.07%	9.45%	4.21%	2.30%	8.43%	17.51%	8.12%	35.06%	65.30%	10.54%
VN30	15.83%	7.02%	-1.01%	2.80%	6.31%	13.81%	-1.27%	17.82%	44.46%	5.62%
VNMidcap	31.35%	20.42%	17.19%	0.71%	13.18%	21.21%	26.73%	87.53%	133.61%	23.32%
VN100	19.58%	8.49%	4.38%	2.60%	8.34%	16.46%	6.61%	31.58%	64.39%	9.58%
VNSmallcap	29.99%	26.64%	2.18%	-0.62%	9.14%	25.65%	25.02%	89.85%	90.17%	23.82%
VN-Index	21.97%	8.12%	6.13%	3.16%	9.00%	19.62%	5.02%	32.61%	60.77%	9.86%

Độ biến động chỉ số

	3 tháng	6 tháng	1 năm	3 năm	5 năm
VNAllShare	6.05%	7.98%	14.17%	25.33%	36.24%
VN30	6.67%	8.81%	15.86%	27.29%	38.78%
VNMidcap	5.92%	7.79%	13.14%	25.23%	37.64%
VN100	6.13%	8.14%	14.57%	25.71%	36.89%
VNSmallcap	6.70%	8.06%	12.25%	27.03%	36.98%
VN-Index	6.90%	9.52%	16.94%	27.90%	39.54%

Độ tương quan chỉ số với VN-Index

	3 tháng	6 tháng	1 năm	3 năm	5 năm
VNAllShare	94.86%	95.20%	93.61%	93.77%	95.18%
VN30	94.42%	95.08%	93.54%	93.73%	95.13%
VNMidcap	74.09%	74.54%	81.00%	80.15%	82.56%
VN100	95.04%	95.49%	93.58%	93.94%	95.21%
VNSmallcap	68.94%	70.69%	75.90%	72.63%	77.08%

Đặc điểm chỉ số

	VNAllshare	VN30	VNMidcap	VN100	VNSmallcap
Số lượng cổ phiếu thành phần	223	30	70	100	123
Giá trị vốn hóa (Tỷ đồng)	1,255,370	997,461	195,768	1,193,229	62,141
Giá trị vốn hóa có điều chỉnh free-float (Tỷ đồng)	446,893	321,981	92,238	414,219	32,674
Trung bình	2,004	10,733	1,318	4,142	266
Cao nhất	85,330	85,330	10,973	85,330	1,512
Thấp nhất	21	1,225	129	129	21
Trung vị	448	4,513	1,011	1,295	198
Tỷ trọng vốn hóa của công ty lớn nhất trong rổ	19.09%	26.50%	11.90%	20.60%	4.63%
Tỷ trọng vốn hóa của 10 công ty lớn nhất trong rổ	56.05%	77.13%	42.19%	60.47%	24.33%

Lưu ý:

"VN30", "VNMidcap", "VNSmallCap", "VN100", "VNAllshare" và "VNAllshare Sector" (gọi chung là "HOSE-Index") là thương hiệu đã được đăng ký, thuộc sở hữu độc quyền của Sở GDCK Hồ Chí Minh (HOSE). Chỉ khi có sự chấp thuận của HOSE thì Bộ chỉ số HOSE-Index mới có thể được sử dụng để tạo ra các sản phẩm liên quan như quỹ đầu tư theo chỉ số, sản phẩm phái sinh, ... Để biết thêm thông tin xin vui lòng liên hệ qua e-mail: index@hsx.vn

Bản công bố này chỉ nhằm mục đích cung cấp thông tin. HOSE đã nỗ lực hết mức có thể để cung cấp thông tin chính xác, tuy nhiên sẽ không có nghĩa vụ pháp lý hoặc trách nhiệm nào cho HOSE cũng như ban giám đốc, cán bộ, nhân viên, đối tác hoặc người nhượng quyền của HOSE liên quan đến sai sót hoặc tổn thất gây ra bởi việc sử dụng bất kỳ thông tin hoặc dữ liệu nào thuộc công bố này.

Sở Giao Dịch Chứng Khoán Thành phố Hồ Chí Minh

Số 16 Võ Văn Kiệt, Quận 1, TP. Hồ Chí Minh

Điện thoại: (84.8) 3821.7713 - Fax: (84.8) 3821.7452

Website: www.hsx.vn



Sơ lược Quy tắc bộ chỉ số HOSE-Index

Tiêu chí sàng lọc:

1. Tư cách:

- Cổ phiếu có thời gian niêm yết trên HOSE tối thiểu 6 tháng tính đến ngày chốt dữ liệu xem xét.
- Cổ phiếu không thuộc diện bị cảnh báo do vi phạm công bố thông tin, kiểm soát, kiểm soát đặc biệt, tạm ngừng giao dịch (ngoại trừ tạm ngừng giao dịch do thực hiện việc tách/gộp cổ phiếu hoặc chia tách/sáp nhập) trong vòng 03 tháng tính đến ngày chốt dữ liệu xem xét.

2. Tỷ lệ tự do chuyển nhượng (Free-float):

Cổ phiếu phải có tỷ lệ free-float cao hơn 10%.

3. Thanh khoản:

Cổ phiếu phải có tỷ suất quay vòng chứng khoán tối thiểu là 0.05%.

Phương pháp chọn cổ phiếu vào rổ chỉ số:

1. VNAllshare:

Bao gồm tất cả các cổ phiếu đáp ứng các tiêu chí sàng lọc.

2. VN30:

- **Tư cách tham gia vào VN30:** Thuộc tập hợp top 90% Giá trị giao dịch tích lũy của rổ VNAllshare và không thuộc diện bị cảnh báo.
- 20 cổ phiếu lớn nhất theo Giá trị vốn hóa thị trường sẽ được chọn vào VN30. 10 cổ phiếu tiếp theo sẽ được chọn từ các cổ phiếu xếp hạng từ 21 đến 40 theo Giá trị vốn hóa thị trường, các cổ phiếu đã có trong rổ VN30 kỳ trước sẽ được ưu tiên chọn trước.

3. VNMidcap:

- Từ các cổ phiếu của VNAllshare không bao gồm 30 cổ phiếu của VN30, 40 cổ phiếu lớn nhất theo Giá trị vốn hóa thị trường sẽ được chọn vào rổ VNMidcap.
- 30 cổ phiếu tiếp theo sẽ được chọn từ các cổ phiếu xếp hạng từ 41 đến 80 theo Giá trị vốn hóa thị trường, các cổ phiếu đã có trong rổ VNMidcap kỳ trước sẽ được ưu tiên chọn trước.

4. VN100:

Bao gồm các cổ phiếu thành phần của chỉ số VN30 và VNMidcap.

5. VNSmallcap:

Bao gồm các cổ phiếu còn lại của VNAllshare sau khi loại trừ các cổ phiếu thành phần của chỉ số VN100.

Chuẩn phân ngành GICS®

GICS® (Global Industry Classification Standard) là chuẩn phân ngành dành cho thị trường chứng khoán do S&P kết hợp với MSCI xây dựng. Thông tin về chuẩn phân ngành GICS® được MSCI và S&P chịu trách nhiệm quản lý và công bố.

Các cổ phiếu niêm yết trên HOSE được MSCI và S&P trực tiếp phân ngành và thông tin phân ngành được cập nhật tại trang chủ của HOSE : www.hsx.vn.

Việc xem xét và cập nhật phân ngành cho các cổ phiếu thành phần của Bộ chỉ số ngành sẽ được thực hiện định kì 06 tháng/lần vào cùng ngày chốt dữ liệu xem xét định kỳ chỉ số.

