

HNX sắp ra mắt chỉ số tổng thu nhập đầu tiên tại Việt Nam

*Diễn biến chỉ số HNX30- TRI = Diễn biến chỉ số HNX30 + ảnh hưởng cổ tức của từng cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số HNX30.*

Diễn biến chỉ số HNX30- TRI = Diễn biến chỉ số HNX30 + ảnh hưởng cổ tức của từng cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số HNX30.

Ngày 15/12 tới đây, Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội sẽ chính thức ra mắt chỉ số tổng thu nhập HNX30 (HNX30-TRI). Đây là chỉ số được tính toán dựa trên chỉ số gốc HNX30 với sự thay đổi giá trị thị trường của 30 cổ phiếu trong rổ chỉ số HNX30 và các khoản cổ tức bằng tiền mặt của các cổ phiếu trong rổ HNX30 được giả thiết tái đầu tư vào rổ chỉ số. Việc tính toán chỉ số tổng thu nhập được thực hiện với giả thiết cổ tức bằng tiền đã sẵn sàng vào ngày giao dịch không hưởng quyền và được tái đầu tư lại rổ chỉ số vào cuối ngày liền trước ngày giao dịch không hưởng quyền. Cổ tức sử dụng trong phương pháp tính toán này là tổng giá trị các khoản cổ tức bằng tiền mặt của các cổ phiếu trong rổ chỉ số HNX30. Nói đơn giản, diễn biến chỉ số HNX30- TRI = Diễn biến chỉ số HNX30 + ảnh hưởng cổ tức của từng cổ phiếu thành phần trong rổ chỉ số HNX30. Điểm cơ sở của chỉ số là 100 và ngày cơ sở là ngày 03/01/2012 (lấy theo ngày cơ sở của chỉ số HNX30). Dữ liệu HNX30-TRI sẽ được tính toán phản ánh cùng lúc với chỉ số HNX30. Kỳ xem xét và điều chỉnh định kỳ HNX30-TRI được thực hiện giống như chỉ số HNX30. Trong đó, các trường hợp loại bỏ, thay thế cổ phiếu và các trường hợp điều chỉnh do có sự kiện doanh nghiệp sẽ được điều chỉnh và phản ánh trong chỉ số giá cổ phiếu tương ứng. Theo HNX, đây là loại hình chỉ số được nhiều công ty chỉ số quốc tế như MSCI, FTSE xây dựng và nhiều quỹ đầu tư quốc tế, đặc biệt là các quỹ ETF đầu tư thụ động rất ưa chuộng vì độ phản ánh tỷ suất lợi nhuận chính xác hơn so với chỉ số giá. Vì vậy, cùng với việc đưa chứng chỉ quỹ ETF SSIAM HNX 30 của Công ty quản lý quỹ SSI vào giao dịch trên sàn HNX, Sở GDCK Hà Nội sẽ tổ chức vận hành và quản lý chỉ số tổng thu nhập dựa trên chỉ số HNX30. Đây là chỉ số tổng thu nhập đầu tiên chính thức được tính toán và công bố tại Việt Nam. Chỉ số HNX30-TRI được kỳ vọng sẽ là chỉ số tham chiếu cho các sản phẩm sử dụng hoặc kết nối với chỉ số HNX30, qua đó nhà đầu tư có thể đánh giá hiệu quả đầu tư trên các sản phẩm này so với việc đầu tư vào các quỹ ETF dựa trên chỉ số HNX30 giúp nhà đầu tư có thêm công cụ phân tích và đánh giá đầu tư. Chỉ số cũng cho thấy tỷ lệ lợi nhuận của các cổ phiếu trong rổ HNX30 so với các rổ chỉ số khác.

Mai Linh

Theo Trí Thức Trẻ