

QUYẾT ĐỊNH

Ban hành Quy tắc chỉ số các cổ phiếu dẫn đầu ngành Tài chính Việt Nam
“Vietnam Leading Financial Index” phiên bản 1.3

CHỦ TỊCH CÔNG TY SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

Căn cứ Luật Chứng khoán ngày 26 tháng 11 năm 2019;

Căn cứ Luật sửa đổi, bổ sung một số điều của Luật Chứng khoán, Luật Kế toán, Luật Kiểm toán độc lập, Luật Ngân sách nhà nước, Luật Quản lý, sử dụng tài sản công, Luật Quản lý thuế, Luật Thuế thu nhập cá nhân, Luật Dự trữ quốc gia, Luật Xử lý vi phạm hành chính ngày 29 tháng 11 năm 2024;

Căn cứ Quyết định số 07/QĐ-HĐTV ngày 09 tháng 7 năm 2021 của Hội đồng thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam về việc ban hành Điều lệ tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh;

Căn cứ Quyết định số 67/QĐ-HĐTV ngày 12 tháng 12 năm 2025 của Hội đồng thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam về việc ban hành Quy chế xây dựng, quản lý, vận hành và khai thác các chỉ số chứng khoán của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam và công ty con;

Căn cứ Công văn số 1314/SGDVN-CLPT ngày 25 tháng 9 năm 2026 của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam về việc chấp thuận và phân quyền ban hành các Quy tắc chỉ số tổ chức lại của HOSE;

Theo đề nghị của Tổng giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh.

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này Quy tắc chỉ số các cổ phiếu dẫn đầu ngành Tài chính Việt Nam “Vietnam Leading Financial Index” phiên bản 1.3.

Điều 2. Quyết định này có hiệu lực kể từ ngày ký và thay thế Quyết định số 802/QĐ-SGDHCM ngày 28 tháng 10 năm 2022 của Tổng giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh ban hành Quy tắc xây dựng và quản lý chỉ số các cổ



phiếu dẫn đầu ngành Tài chính Việt Nam “Vietnam Leading Financial Index” phiên bản 1.2.

Điều 3. Ban Điều hành, Giám đốc phòng Thông tin thị trường, Giám đốc các đơn vị thuộc Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh, các tổ chức và cá nhân có liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này./.

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN, VNX (để báo cáo);
- Lưu: VT, TTTT (.5.).

phua

Q. CHỦ TỊCH CÔNG TY



Trịnh Sơn Hồng



SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH



SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH
HOCHIMINH
STOCK EXCHANGE

**QUY TẮC CHỈ SỐ CÁC CỔ PHIẾU
DẪN ĐẦU NGÀNH TÀI CHÍNH VIỆT NAM
VIETNAM LEADING FINANCIAL INDEX**

Phiên bản 1.3



(Kèm theo Quyết định số 743/QĐ-SGDHCM ngày 29 tháng 9 năm 2026 của Chủ tịch công ty Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh)

Thành phố Hồ Chí Minh

Tháng 9 - 2026

MỤC LỤC

1. GIỚI THIỆU CHUNG	4
2. QUY ĐỊNH CHUNG VỀ CHỈ SỐ	4
3. ĐỊNH NGHĨA ÁP DỤNG	5
4. SÀNG LỌC RỎ CHỈ SỐ ĐỊNH KỲ	5
5. CÁC ĐIỀU CHỈNH TRONG KỲ ĐỐI VỚI RỎ CHỈ SỐ	6
6. PHƯƠNG PHÁP TÍNH TOÁN CHỈ SỐ	6
7. THÔNG TIN LIÊN HỆ	7



LỊCH SỬ THAY ĐỔI QUY TẮC CHỈ SỐ

Phiên bản	Nội dung
1.3	- Cấu trúc lại Quy tắc xây dựng và quản lý chỉ số VNFINLEAD phiên bản 1.2. - Bổ sung trường hợp rõ chỉ số sẽ tiếp tục được cập nhật, loại các cổ phiếu trước Ngày hiệu lực (diện cảnh báo do vi phạm công bố thông tin) để thống nhất theo quy định tại Quy tắc chung cho các chỉ số chứng khoán tại HOSE.

1. GIỚI THIỆU CHUNG

- 1.1. Quy tắc Chỉ số các cổ phiếu dẫn đầu ngành tài chính Việt Nam (tên đầy đủ tiếng Anh là Vietnam Leading Financial Index, tên viết tắt là Chỉ số VNFINLEAD) được ban hành sau khi được Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam (viết tắt là VNX) phê duyệt, quy định các quy tắc để làm cơ sở cho việc quản lý và vận hành chỉ số VNFINLEAD hàng ngày của Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (viết tắt là HOSE) theo phân quyền của VNX.
- 1.2. Quy tắc chỉ số này có thể được sửa đổi, bổ sung, hoặc hủy bỏ một phần hoặc toàn bộ tại bất kỳ thời điểm nào. Việc sửa đổi, bổ sung hoặc hủy bỏ các quy tắc có thể dẫn đến những thay đổi trong việc xây dựng và quản lý chỉ số hoặc ảnh hưởng trực tiếp đến các chỉ số.
- 1.3. Quyền sở hữu trí tuệ đối với Quy tắc này và chỉ số bao gồm tên, thành phần và việc tính toán chỉ số thuộc về VNX, HOSE. Ngoại trừ các trường hợp không phải xin phép và trường hợp ngoại lệ theo quy định tại Luật Sở hữu trí tuệ, việc sao chép một phần hay toàn bộ Quy tắc chỉ số này mà chưa có sự cho phép của VNX hoặc HOSE đều bị coi là xâm phạm quyền sở hữu trí tuệ và sẽ bị xử lý theo quy định của pháp luật.
- 1.4. Ngoại trừ các nội dung được nêu cụ thể tại Quy tắc chỉ số này, tất cả những nội dung liên quan được thực hiện theo quy định tại Quy tắc chung cho các chỉ số chứng khoán tại HOSE (Quy tắc chỉ số chung của HOSE).

2. QUY ĐỊNH CHUNG VỀ CHỈ SỐ

- 2.1. Chỉ số VNFINLEAD là chỉ số đầu tư, bao gồm tối thiểu 10 cổ phiếu thành phần thuộc ngành tài chính theo chuẩn phân ngành GICS® và đáp ứng các tiêu chí sàng lọc chỉ số.
- 2.2. Chỉ số giá VNFINLEAD được tính toán dựa trên giá trị vốn hóa thị trường điều chỉnh tỷ lệ free-float và có áp dụng giới hạn tỷ trọng vốn hóa (đối với cổ phiếu đơn lẻ) và giới hạn trọng số theo thanh khoản của cổ phiếu.
Chỉ số giá được tính toán theo thời gian thực và công bố 5 giây/lần vào tất cả các ngày giao dịch.
- 2.3. Chỉ số tổng thu nhập VNFINLEAD TRI được tính toán dựa trên chỉ số gốc là Chỉ số giá VNFINLEAD, thể hiện biến động giá và giá trị cổ tức của các cổ phiếu thành phần được tái đầu tư vào chỉ số.
Chỉ số tổng thu nhập được tính toán một lần và công bố vào thời điểm cuối ngày giao dịch.
- 2.4. Điểm cơ sở của chỉ số là 1.000. Ngày cơ sở của chỉ số là ngày 15/11/2019.
- 2.5. Danh mục cổ phiếu thành phần của chỉ số (rổ chỉ số) được:

- Xem xét định kỳ bán niên vào kỳ tháng 1 và tháng 7.
- Cập nhật thông tin (tỷ lệ free-float, khối lượng lưu hành tính chỉ số, giới hạn tỷ trọng vốn hóa, trọng số thanh khoản của cổ phiếu, danh mục cổ phiếu thành phần (nếu có)) hàng quý vào kỳ tháng 1, tháng 4, tháng 7 và tháng 10.

Tham khảo quy định chi tiết về Ngày chốt dữ liệu, Ngày công bố kết quả và Ngày hiệu lực của các kỳ xem xét định kỳ/cập nhật thông tin tại Mục **Định nghĩa áp dụng** Quy tắc chỉ số chung của HOSE.

3. ĐỊNH NGHĨA ÁP DỤNG

- Rổ chỉ số VNFIN là danh sách cổ phiếu thành phần của chỉ số VNAllshare Financials được xác định tại kỳ xem xét định kỳ gần nhất theo Quy tắc các chỉ số ngành VNAllshare.
- Giá trị vốn hóa điều chỉnh free-float (GTVH_f), Tỷ lệ free-float (f), Giá trị giao dịch (GTGD), Tỷ suất quay vòng, chuẩn phân ngành GICS®: tham khảo **Định nghĩa áp dụng** tại Quy tắc chỉ số chung của HOSE.
- Cổ phiếu được xác định thuộc ngành tài chính theo phân ngành cấp 1 thuộc chuẩn phân ngành GICS®.
- Lợi nhuận sau thuế (LNST) được xác định theo Báo cáo tài chính hợp nhất kiểm toán năm gần nhất được công ty công bố.

4. SÀNG LỌC RỔ CHỈ SỐ ĐỊNH KỲ

4.1. Các bước sàng lọc rổ chỉ số định kỳ

Bước 1: Tập hợp các cổ phiếu xem xét bao gồm:

- Rổ chỉ số VNFIN, hoặc
- Các cổ phiếu thuộc ngành tài chính nhưng không thuộc rổ chỉ số VNFIN phải đồng thời thỏa mãn các điều kiện sau:
 - ✓ Cổ phiếu không thuộc diện cảnh báo do vi phạm công bố thông tin, kiểm soát, hạn chế giao dịch, tạm ngừng giao dịch (*ngoại trừ tạm ngừng giao dịch do thực hiện các sự kiện doanh nghiệp như việc tách/gộp cổ phiếu, chia tách/sáp nhập, ... dưới 30 ngày giao dịch*), đình chỉ giao dịch trong vòng 3 tháng tính đến Ngày chốt dữ liệu.
 - ✓ $f \geq 10\%$ hoặc $GTVH_f \geq 2.500$ tỷ đồng.

Bước 2: Từ danh sách cổ phiếu thỏa mãn điều kiện sau Bước 1, chọn các cổ phiếu đáp ứng đồng thời các tiêu chí sau:

- ✓ $GTGD \geq 10$ tỷ đồng/ngày
- ✓ Tỷ suất quay vòng $\geq 0,1\%$
- ✓ $LNST \geq 0$

Bước 3: Sắp xếp các mã cổ phiếu thỏa mãn điều kiện sau Bước 2 theo GTVH_f giảm dần và xác định rõ chỉ số chính thức như sau:

- Cổ phiếu không thuộc rõ chỉ số của kỳ liền trước: thuộc tập hợp cổ phiếu có GTVH_f tích lũy 95%; *hoặc*
- Cổ phiếu thuộc rõ chỉ số của kỳ liền trước: thuộc tập hợp cổ phiếu có GTVH_f tích lũy 98%.

Trường hợp rõ chỉ số chính thức không đủ 10 mã cổ phiếu, chọn thêm các mã cổ phiếu có GTGD lớn nhất (ưu tiên GTVH cao hơn khi GTGD bằng nhau) từ danh sách cổ phiếu thỏa mãn điều kiện sau Bước 2 cho đến khi đủ 10 mã cổ phiếu vào rõ chỉ số chính thức.

4.2. Cập nhật rõ chỉ số trước Ngày hiệu lực

Rõ chỉ số sẽ tiếp tục được cập nhật, loại các cổ phiếu theo quy định **Cập nhật rõ chỉ số trước Ngày hiệu lực** tại Quy tắc chỉ số chung của HOSE.

Việc thay thế cổ phiếu bị loại sẽ tiến hành tương tự việc điều chỉnh trong kỳ quy định tại Mục 5.2 Quy tắc này.

5. CÁC ĐIỀU CHỈNH TRONG KỲ ĐỐI VỚI RÕ CHỈ SỐ

5.1. Rõ chỉ số sẽ được điều chỉnh trong kỳ khi thuộc các trường hợp **Điều chỉnh trong kỳ đối với rõ chỉ số** theo quy định tại Quy tắc chỉ số chung của HOSE.

5.2. Việc thay thế cổ phiếu bị loại sẽ được tiến hành như sau:

5.2.1. Nếu rõ chỉ số chính thức còn lại dưới 10 cổ phiếu, lựa chọn cổ phiếu thay thế từ rõ chỉ số VNFIN hiện hành theo thứ tự GTGD giảm dần được xác định tại kỳ xem xét định kỳ gần nhất, ưu tiên GTVH cao hơn khi GTGD bằng nhau cho đến khi đủ 10 cổ phiếu vào rõ chỉ số chính thức.

5.2.2. Nếu rõ chỉ số chính thức còn lại lớn hơn hoặc bằng 10 cổ phiếu, không bổ sung cổ phiếu thay thế cổ phiếu bị loại.

6. PHƯƠNG PHÁP TÍNH TOÁN CHỈ SỐ

6.1. Chỉ số giá VNFINLEAD và chỉ số tổng thu nhập VNFINLEAD TRI được tính toán theo **Phương pháp tính toán chỉ số giá** và **Phương pháp tính toán chỉ số tổng thu nhập** được quy định tại Quy tắc chỉ số chung của HOSE.

6.2. Giới hạn tỷ trọng vốn hóa của cổ phiếu (c)

Giới hạn tỷ trọng vốn hóa của cổ phiếu được tính theo quy định **Giới hạn tỷ trọng vốn hóa của cổ phiếu (c)** tại Quy tắc chỉ số chung của HOSE.

Áp dụng ngưỡng giới hạn tỷ trọng vốn hóa của các cổ phiếu thành phần chỉ số đối với một cổ phiếu đơn lẻ là 15%.

6.3. Giới hạn trọng số của cổ phiếu (g)

Giới hạn trọng số của cổ phiếu i (g_i) là trọng số thanh khoản của cổ phiếu i , được tính bằng tỷ lệ giữa GTGD của cổ phiếu i so với tổng GTGD của rổ chỉ số.

7. THÔNG TIN LIÊN HỆ

Để biết thêm thông tin về phương pháp xây dựng, tính toán chỉ số, dịch vụ cấp quyền sử dụng chỉ số và cung cấp thông tin, vui lòng truy cập trang thông tin điện tử hoặc liên hệ phòng Thông tin thị trường – Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh.



SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH
HOCHIMINH
STOCK EXCHANGE

SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

ĐỊA CHỈ: SỐ 16, ĐƯỜNG VÕ VĂN KIẾT, PHƯỜNG BẾN THÀNH, THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH.

SỐ ĐT: (84-28) 38 217 713, SỐ FAX: (84-28) 38 217 452

WEBSITE: <https://www.hsx.vn>

EMAIL: index@hsx.vn



