

PHỤ LỤC 3: BỘ CHỈ SỐ QUY MÔ

(Ban hành kèm theo Quyết định số 529/QĐ-SGDHN ngày 31/10/2013 của Sở GDCK Hà Nội)

Bộ chỉ số quy mô bao gồm 2 chỉ số: HNX Large Cap Index, HNX Mid/Small Cap Index, dựa trên giá trị vốn hóa thị trường có điều chỉnh tỉ lệ cổ phiếu tự do chuyển nhượng từ danh sách các công ty niêm yết trên Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội theo tiêu chí xây dựng chỉ số.

Ngày cơ sở của các chỉ số quy mô là 02/12/2013 với điểm cơ sở là 100.

Bộ chỉ số Quy mô không áp dụng tỉ lệ vốn hóa tối đa.

Bộ chỉ số Quy mô áp dụng tỷ lệ free-float theo quy định đã nêu tại Bộ Nguyên tắc xây dựng và quản lý chỉ số giá cổ phiếu.

A. Tiêu chí và phương pháp lựa chọn cổ phiếu vào rổ chỉ số quy mô:

Các cổ phiếu được lựa chọn là cổ phiếu của các doanh nghiệp đang niêm yết tại HNX và không thuộc một trong các diện sau đây:

- Cổ phiếu thuộc diện bị tạm ngừng giao dịch trong vòng 03 tháng tính đến thời điểm xem xét;
- Cổ phiếu có thời gian niêm yết và giao dịch trên HNX dưới 06 tháng, ngoại trừ trường hợp đặc biệt được Hội đồng chỉ số thông qua;
- Các cổ phiếu có tỷ lệ cổ phiếu tự do chuyển nhượng (free float – f) dưới 5%.

Việc lựa chọn cổ phiếu vào rổ chỉ số được tiến hành theo các bước sau:

Bước 1: Tính giá trị vốn hóa thị trường bình quân trong 06 tháng gần nhất và sắp xếp theo thứ tự từ cao xuống thấp.

Bước 2: Lựa chọn mã cổ phiếu cho các chỉ số:

- HNX Large Cap Index: Lựa chọn 50 cổ phiếu có mức vốn hóa thị trường bình quân 06 tháng cao nhất (Top50) và có vốn điều lệ thực góp từ 120 tỷ đồng trở lên căn cứ trên báo cáo tài chính năm gần nhất kiểm toán hoặc báo cáo kết quả phát hành gần nhất;
- HNX Mid/Small Cap Index: các cổ phiếu đủ điều kiện lựa chọn vào chỉ số quy mô và không thuộc nhóm các cổ phiếu HNX Large Cap Index.

B. Các trường hợp điều chỉnh trong chỉ số:

- a. Thời điểm xem xét điều chỉnh định kỳ

Việc lựa chọn cổ phiếu ra/vào rổ được thực hiện và điều chỉnh định kỳ 06 tháng một lần, với thời gian cụ thể như sau:

Kỳ xem xét	Ngày dữ liệu	Thời điểm xem xét điều chỉnh của Hội đồng chỉ số	Ngày công bố kết quả điều chỉnh	Ngày hiệu lực
Tháng 10 năm trước – tháng 3 năm sau	Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 3	Tuần thứ 2 của tháng 4 hàng năm	Tối thiểu 7 ngày làm việc trước ngày hiệu lực	Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 4
Tháng 4 – tháng 9	Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 9	Tuần thứ 2 của tháng 10 hàng năm	Tối thiểu 7 ngày làm việc trước ngày hiệu lực	Ngày giao dịch cuối cùng của tháng 10

b. Xem xét điều chỉnh định kỳ cổ phiếu trong rổ: Việc xem xét điều chỉnh định kỳ cổ phiếu trong rổ được thực hiện tương tự khi thực hiện lựa chọn ban đầu.

C. Điều chỉnh đặc biệt đối với cổ phiếu trong rổ HNX Large Cap Index:

- (i) Loại bỏ và thay thế: Nếu một cổ phiếu bị hủy niêm yết, ngừng giao dịch, bị mua thâm tóm hoặc theo ý kiến của Hội đồng chỉ số là không đáp ứng được các tiêu chí đề ra sẽ bị loại khỏi rổ cổ phiếu tính chỉ số. Việc bổ sung, thay thế cổ phiếu bị loại bỏ sẽ chỉ được thực hiện vào kỳ điều chỉnh 06 tháng kế tiếp.
- (ii) Trong trường hợp cổ phiếu trong rổ bị công ty khác thâm tóm, việc thông báo về cổ phiếu bị hủy sẽ được đưa ra bởi cơ quan quản lý sau khi nhận được thông tin chắc chắn về việc ít nhất 75% giá trị mua bán đã được thực hiện và số cổ phiếu mới đã được niêm yết. Các cổ phiếu bị loại ra này nhưng sau đó tiếp tục giao dịch trở lại sẽ được xem xét tái gia nhập rổ tính chỉ số vào kỳ xem xét kế tiếp, nhưng ít nhất phải qua 06 tháng từ khi bị loại khỏi rổ đến khi được xem xét đưa trở lại rổ.
- (iii) Sáp nhập: Nếu tác động của việc sáp nhập hoặc thâm tóm dẫn tới việc một cổ phiếu trong rổ bị nhập vào một cổ phiếu khác trong rổ chỉ số thì công ty nhận sáp nhập sẽ vẫn được giữ

lại trong rổ và sẽ tạo ra một chỗ trống trong rổ. Chỗ trống này sẽ được thay thế bằng cổ phiếu khác vào kỳ điều chỉnh 06 tháng kế tiếp.

- (iv) Nếu một công ty có cổ phiếu trong rổ được mua bởi một công ty khác ở ngoài rổ thì cổ phiếu trong rổ này sẽ bị loại bỏ khỏi rổ tính chỉ số. Việc bổ sung thay thế bằng cổ phiếu khác sẽ được thực hiện vào kỳ điều chỉnh 06 tháng kế tiếp.
- (v) Nếu một công ty trong rổ bị chia tách để hình thành nên hai hoặc nhiều công ty mới, thì các công ty mới được xem xét đưa vào rổ HNX Large Cap Index nếu đáp ứng điều kiện bổ sung đặc biệt.
- (vi) Bổ sung đặc biệt: Nếu có một công ty niêm yết mới có giá trị vốn hóa lớn (luôn nằm trong nhóm 10 cổ phiếu có giá trị vốn hóa lớn nhất trong 1 tháng liên tiếp kể từ khi niêm yết) mà nếu bỏ qua sẽ làm tác động lớn và tiêu cực đến chỉ số, Hội đồng chỉ số có thể quyết định đưa cổ phiếu mới này vào rổ chỉ số HNX Large Cap Index, việc quyết định đưa cổ phiếu này vào rổ sẽ được Hội đồng chỉ số xem xét và thông báo trong vòng 15 ngày. Cổ phiếu cuối cùng trong danh sách HNX Large Cap Index tại kỳ xem xét gần nhất sẽ bị thay thế.
- (vii) Các công ty mới niêm yết không có giá trị vốn hóa lớn như các trường hợp trên (trường hợp vi) nhưng đáp ứng đủ các tiêu chí để được lựa chọn vào rổ sẽ được đưa ra xem xét tại kỳ xem xét 06 tháng, nếu vốn hóa thị trường đủ lớn có thể được đưa vào rổ.
- (viii) Một công ty được đưa vào giao dịch trở lại sau khi bị ngừng giao dịch hoặc tái cơ cấu, hoặc đổi tên, hoặc hình thành từ việc sáp nhập, mua thâu tóm, hoặc chia tách với một công ty khác mà công ty này không trong rổ tính chỉ số, sẽ không được coi là một cổ phiếu mới.
- (ix) Nếu Hội đồng chỉ số quyết định đưa vào một cổ phiếu mới vì lý do an toàn chứ không phải theo nguyên tắc xem xét định kỳ thông thường, quyết định này sẽ được công bố công khai vào thời gian sớm nhất cho phép.
- (x) Ngừng giao dịch: Nếu một cổ phiếu trong rổ tính chỉ số bị ngừng giao dịch trên Sở, cổ phiếu này có thể sẽ vẫn nằm trong chỉ số đến 10 ngày làm việc. Trong thời gian này, Chủ tịch Hội đồng có thể quyết định loại cổ phiếu đó ngay lập tức với mức giá tại thời điểm ngừng giao dịch. Khi việc ngừng giao dịch của một cổ phiếu trong rổ kéo dài hơn 10 ngày làm việc (mà cổ phiếu đó vẫn chưa bị loại khỏi rổ) thì thông thường sẽ bị loại khỏi chỉ số với mức giá tại thời điểm ngừng giao dịch.
- (xi) Khi một cổ phiếu ngừng giao dịch bị loại khỏi rổ, việc bổ sung, thay thế cổ phiếu bị loại bỏ này sẽ chỉ được thực hiện tại kỳ xem xét 06 tháng kế tiếp.

(xii) Tùy điều kiện thị trường tại từng thời kỳ, Hội đồng chỉ số có thể xem xét điều chỉnh mức vốn điều lệ thực góp tối thiểu khi lựa chọn chỉ số HNX Large Cap Index.

D. Điều chỉnh đặc biệt đối với chỉ số HNX Mid/Small Cap Index:

Các trường hợp điều chỉnh đặc biệt đối với chỉ số HNX Mid/Small Cap Index tương tự như các trường hợp điều chỉnh đặc biệt với chỉ số HNX Large Cap Index ngoại trừ các khoản (v), (vi), (vii) và (xii).