truefriend KIS Viet Nam Securities Corporation

Bản tin phái sinh

08/12/2021

Hồi phục trong phiên

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,513 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua đã quay trở lại và chiếm ưu thế. Giá trị mua ròng ở mức 16.5 tỷ đồng. Đáng chú ý, lực cầu ngoại tập trung chủ yếu trên VHM, VCB, và VIC.

Đồ thị VN30 Future: Điểm mua vẫn chưa xuất hiện

VN30F2112 phục hồi trong phiên giao dịch trước, hình thành vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn quanh 1,450 điểm. Tuy nhiên, các đường MA chủ đạo đã bị phá vỡ (Đồ thị ngày và giờ), nhịp điều chỉnh được xác nhận. Vùng 1,450 điểm sẽ là vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn.

Chiến lược đầu tư

Mặc dù VN30F2112 có giai đoạn phục hồi đáng kể, nhưng nhịp điều chỉnh vẫn chưa biến mất. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu mua tin cậy.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,512.6	2.1					
VN30F2112	1,480.2	0.0	202,912	35,863	1,513	16/12/2021	11
VN30F2201	1,480.1	0.0	1,064	932	1,514	20/01/2022	46
VN30F2203	1,473.2	0.0	719	173	1,515	17/03/2022	102
VN30F2206	1,473.0	0.0	469	284	1,517	16/06/2022	193

Nguồn: Bloomberg, KIS

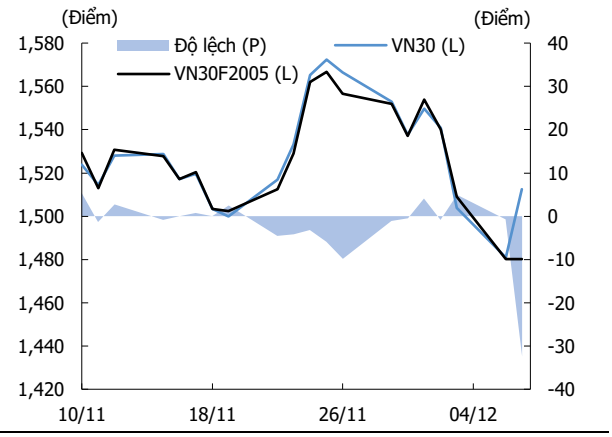
Đăng Lê
dang.lh@kisvn.vn

VUI LÒNG THAM KHẢO MIỄN TRỪ TRÁCH NHIỆM Ở CUỐI BÁO CÁO

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

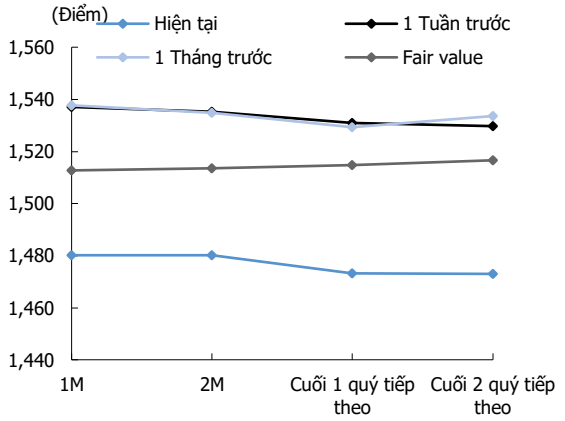
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



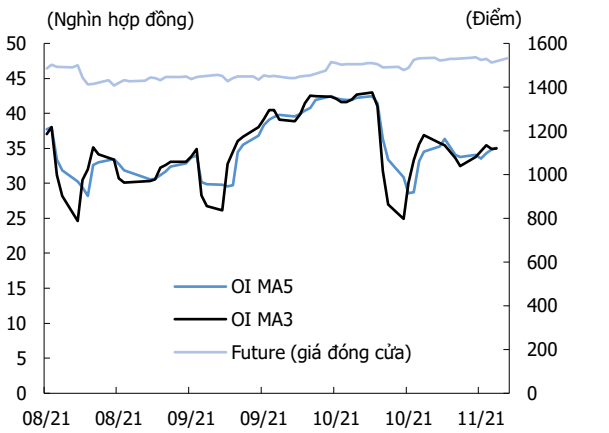
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



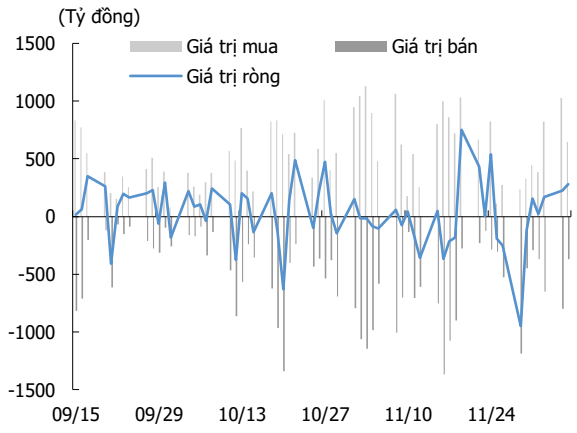
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 4. Open interest



Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 5. Giao dịch khối ngoại hàng ngày



Nguồn: Bloomberg, KIS

Bảng 2. Danh sách cổ phiếu VN30

(Tỷ đồng, đồng, %, x, nghìn CP)

Mã	Tên	Ngành	Vốn hóa	Tỷ trọng	Giá đóng cửa	% ngày	PER	PBR	KLGD 3 tháng	SH Nước Ngoài	Cao 52 Tuần	Thấp 52 Tuần
ACB	Ngân hàng Á Châu	Tài chính	89,029	5.44	32,950	2.0	9.2	2.10	5,293	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	175,360	0.50	43,600	3.9	17.8	2.12	1,926	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	43,352	0.31	58,400	1.6	23.6	2.04	1,530	26.4	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	157,148	1.69	32,700	1.9	9.5	1.65	10,797	25.3	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	87,117	5.32	96,000	1.6	21.6	5.13	2,119	49.0	101,800	48,261
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	184,696	0.66	96,500	4.9	22.5	3.76	1,630	2.7	128,400	72,500
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	146,400	0.42	36,600	1.7	29.4	2.98	4,225	0.6	43,300	19,900
HDB	HDBank	Tài chính	59,766	3.01	30,000	3.1	10.7	2.17	4,463	17.1	33,950	16,160
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	212,911	8.25	47,600	4.0	6.7	2.53	27,567	24.3	58,400	27,296
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	29,125	1.36	45,300	4.6	24.4	2.98	2,808	31.5	51,100	24,455
MBB	MBBank	Tài chính	106,360	4.20	28,150	2.4	9.6	1.90	12,607	23.2	32,926	15,266
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	179,323	5.15	151,900	0.6	74.8	8.33	1,219	32.1	159,700	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	95,163	4.45	133,500	1.6	21.8	5.06	1,441	49.0	145,500	75,333
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	165,928	4.17	112,600	1.4	47.4	4.85	2,847	8.0	123,600	43,724
PDR	BĐS Phát Đạt	Bất động sản	48,193	1.37	97,800	2.3	30.2	7.70	4,139	3.3	99,700	34,182
PLX	Petrolimex	Năng lượng	67,977	0.49	53,500	3.5	20.2	2.77	1,991	17.1	62,400	45,500
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,327	1.23	93,800	2.9	8.1	3.84	671	47.3	112,000	73,000
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	34,777	0.50	14,850	6.8	12.0	1.15	17,043	2.9	15,200	9,980
SAB	SABECO	TD thiết yếu	98,116	0.78	153,000	0.9	26.0	4.62	150	62.7	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	51,279	2.40	52,200	2.4	24.0	3.79	16,360	38.6	57,700	13,377
STB	Sacombank	Tài chính	52,880	3.61	28,050	3.9	15.0	1.58	16,659	17.3	33,900	15,450
TCB	Techcombank	Tài chính	175,546	8.20	50,000	2.0	10.1	2.00	14,690	22.5	58,600	24,800
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	56,006	2.41	47,800	1.7	10.8	2.26	5,530	29.6	49,900	21,850
VCB	Vietcombank	Tài chính	364,212	2.88	98,200	2.9	17.2	3.33	961	23.6	117,200	85,500
VHM	Vinhomes	Bất động sản	355,316	6.26	81,600	2.4	9.8	4.05	7,483	23.1	93,769	64,154
VIC	VinGroup	Bất động sản	406,016	8.34	106,700	1.0	85.5	4.00	2,880	13.5	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	66,618	2.39	123,000	2.1	30.1	3.93	873	16.6	138,500	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	180,781	5.20	86,500	1.4	19.2	5.81	3,382	54.5	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	158,481	7.40	35,650	0.4	12.8	2.54	13,181	15.2	40,722	15,444
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	68,056	1.60	29,950	7.0	31.4	2.23	6,789	29.5	38,300	25,100

Nguồn: Bloomberg, KIS

Miễn Trừ Trách Nhiệm

Báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing cho chứng khoán Việt Nam được thực hiện và phát hành bởi phòng phân tích của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam, công ty được cấp giấy phép đầu tư của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước Việt Nam. Chuyên viên phân tích, người thực hiên và phát hành báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing, được cấp chứng chỉ hành nghề và được quản lý bởi UBCKNN Việt Nam. Báo cáo này không được sao chụp, nhân bản hoặc xuất bản (toàn bộ hoặc từng phần) hoặc tiết lộ cho bất kỳ người nào khác mà không được sự chấp thuận bằng văn bản của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam.

Báo cáo này được viết nhằm mục đích chỉ cung cấp thông tin. Bản báo cáo này không nên và không được diễn giải như một đề nghị mua hoặc bán hoặc khuyến khích mua hoặc bán bất cứ khoản đầu tư nào. Khi xây dựng bản báo cáo này, chúng tôi hoàn toàn đã không cân nhắc về các mục tiêu đầu tư, tình hình tài chính hoặc các nhu cầu cụ thể của các nhà đầu tư. Cho nên khi đưa ra các quyết định đầu tư cho riêng mình các nhà đầu tư nên dựa vào đánh giá cá nhân hoặc tư vấn của chuyên gia tư vấn tài chính độc lập của mình và tùy theo tình hình tài chính cá nhân, mục tiêu đầu tư và các quan điểm thích hợp khác trong từng hoàn cảnh. CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam không đảm bảo nhà đầu tư sẽ đạt được lợi nhuận hoặc được chia sẻ lợi nhuận từ các khoản đầu tư. CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam, hoặc các bên liên quan, và các nhân sự cấp cao, giám đốc và nhân viên tuyên bố miễn trừ trách nhiệm với các khoản lỗ hoặc tổn thất liên quan đến việc sử dụng toàn bộ hoặc một phần báo cáo này. Thông tin và nhận định có thể thay đổi bất cứ lúc nào mà không cần báo trước và có thể khác hoặc ngược với quan điểm được thể hiện trong các mảng kinh doanh khác của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam. Quyết định đầu tư cuối cùng phải dựa trên các đánh giá cá nhân của khách hàng, và báo cáo phân tích này và các tài liệu marketing không thể được sử dụng như là chứng cứ cho các tranh chấp pháp lý liên quan đến các quyết định đầu tư.

Bản quyền © 2021 của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam. Báo cáo này không được sao chụp, nhân bản hoặc xuất bản (toàn bộ hoặc từng phần) hoặc tiết lộ cho bất kỳ người nào khác mà không được sự chấp thuận bằng văn bản của CTCP Chứng khoán KIS Việt Nam.