

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,519 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán đã quay trở lại và chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 710 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên HPG, VPB, và SSI.

Đồ thị VN30 Future: Tiếp tục tích lũy

Độ biến động gia tăng trên VN30F2112 và giai đoạn tích lũy vẫn chưa kết thúc. Hợp đồng này giao dịch quanh các đường MA chủ đạo, điểm mua vẫn chưa hoàn toàn được xác nhận và giai đoạn tích lũy vẫn duy trì. Vùng 1,450 điểm sẽ là vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn trong khi vùng 1,580 điểm là vùng kháng cự quan trọng. Đáng chú ý, vùng 1,500 điểm sẽ là vùng hỗ trợ quan trọng trong phiên cho sự duy trì của đà tăng. Hợp đồng VN30F2112 sẽ đáo hạn vào hôm nay và những biến động không mong muốn có thể xuất hiện. Trong trường hợp này, traders nên tiếp tục nắm giữ vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2112 nên tiếp tục được nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,500 điểm (Đồ thị giờ).

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	1,519.4	0.2					
VN30F2112	1,520.1	0.1	118,443	22,538	1,517	16/12/2021	3
VN30F2201	1,519.3	0.2	5,895	8,823	1,430	20/01/2022	38
VN30F2203	1,516.0	0.3	345	191	1,431	17/03/2022	94
VN30F2206	1,516.9	0.3	484	416	1,433	16/06/2022	185

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

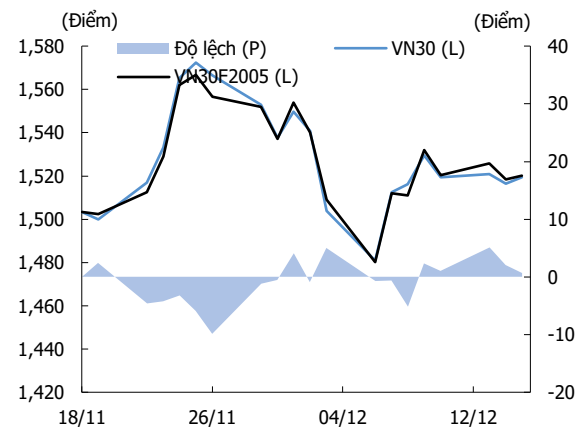
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, December 15, 2021 21:11:21 +07
 VN30F2112, 60 O: 1514.70 H: 1524.20 L: 1514.60 C: 1520.10



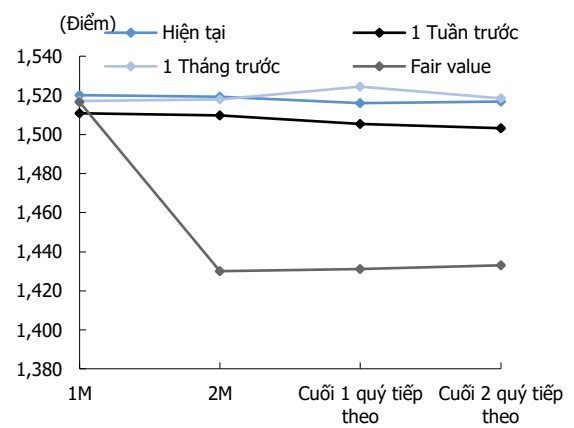
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



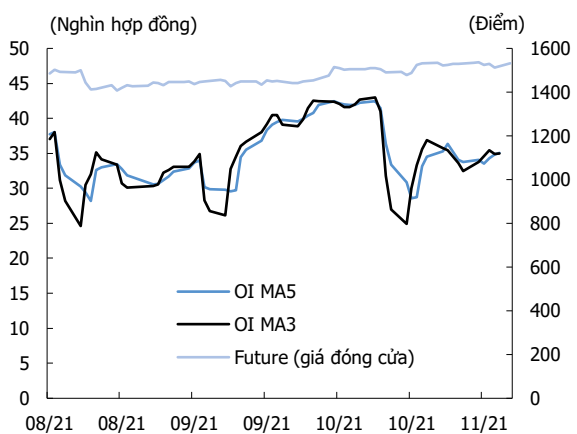
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



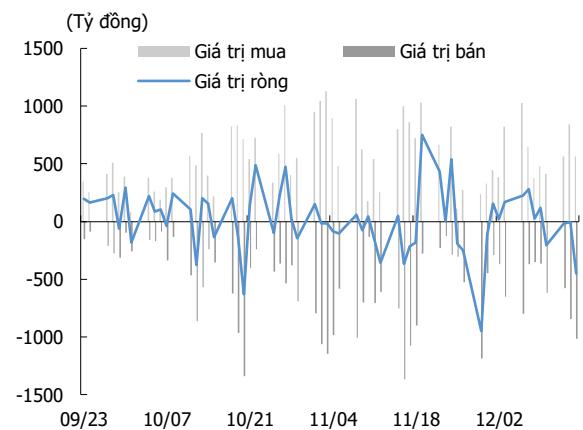
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	90,245	5.49	33,400	0.3	9.3	2.12	5,065	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	180,589	0.52	44,900	(0.9)	18.3	2.18	1,959	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	43,203	0.31	58,200	(0.5)	23.5	2.03	1,498	26.4	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	154,985	1.66	32,250	(0.5)	9.3	1.63	10,592	25.3	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	87,026	5.29	95,900	0.2	21.6	5.12	2,049	49.0	101,800	48,696
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	186,993	0.67	97,700	(0.5)	22.8	3.80	1,648	2.7	128,400	72,500
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	151,000	0.43	37,750	(1.0)	30.3	3.07	3,928	0.6	43,300	21,600
HDB	HDBank	Tài chính	59,866	3.00	30,050	1.5	10.7	2.17	4,690	17.0	33,950	16,160
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	213,806	8.25	47,800	0.2	6.7	2.54	26,344	24.2	58,400	27,407
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	30,990	1.44	48,200	(0.6)	26.0	3.17	2,720	31.8	51,100	24,727
MBB	MBBank	Tài chính	107,682	4.24	28,500	0.9	9.7	1.92	12,019	23.2	32,926	15,707
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	190,066	5.44	161,000	2.7	79.3	8.83	1,187	32.1	161,000	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	96,874	4.51	135,900	0.4	22.2	5.15	1,374	49.0	145,500	75,333
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	169,465	4.24	115,000	1.7	48.4	4.95	3,013	7.9	123,600	46,056
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	46,321	1.31	94,000	1.6	29.0	7.40	4,292	3.4	99,800	35,403
PLX	Petrolimex	Năng lượng	69,374	0.50	54,600	0.2	20.6	2.83	2,008	17.1	62,400	45,500
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,827	1.25	96,000	(0.2)	8.1	3.93	634	47.2	112,000	75,000
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	37,704	0.54	16,100	(3.0)	13.0	1.25	18,940	2.8	16,950	9,980
SAB	SABECO	TD thiết yếu	97,795	0.77	152,500	(0.2)	25.9	4.61	142	62.6	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	50,787	2.36	51,700	(1.9)	23.8	3.76	15,892	38.7	57,700	16,251
STB	Sacombank	Tài chính	53,446	3.63	28,350	0.9	15.2	1.60	16,691	17.4	33,900	15,500
TCB	Techcombank	Tài chính	176,248	8.20	50,200	0.2	10.1	2.01	14,545	22.5	58,600	25,950
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	60,927	2.62	52,000	3.0	11.7	2.46	5,215	29.5	53,500	22,000
VCB	Vietcombank	Tài chính	370,517	2.92	99,900	0.6	17.5	3.39	967	23.6	117,200	85,500
VHM	Vinhomes	Bất động sản	359,671	6.31	82,600	0.6	10.0	4.10	6,504	23.2	93,769	64,615
VIC	VinGroup	Bất động sản	380,521	7.78	100,000	(2.4)	80.1	3.75	2,982	13.5	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	67,160	2.40	124,000	0.0	30.1	3.97	859	16.5	138,500	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	180,363	5.16	86,300	0.0	19.1	5.80	3,231	54.5	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	154,036	7.16	34,650	(1.0)	12.5	2.47	13,305	15.2	40,722	15,556
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	69,078	1.61	30,400	0.7	31.9	2.27	7,180	29.7	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 hiện 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.