

Độ biến động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,517 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng mạnh. Giá trị bán ròng ở mức 50 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên VIC, VCB, và MSN.

Đồ thị VN30 Future: Vùng dao động

Độ biến động tăng mạnh trên VN30F2202 khi mẫu nến thân hẹp xuất hiện với khối lượng trên mức trung bình. Tuy nhiên, tín hiệu tăng vẫn chưa hoàn toàn được xác nhận. Vùng 1,470 điểm sẽ là vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn trong khi vùng 1,540 điểm là vùng kháng cự quan trọng tiếp theo. Trong trường hợp này, traders nên tiếp tục nắm giữ vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2202 nên được tiếp tục nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,460 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	1,516.6	(0.6)					
VN30F2202	1,512.0	(0.5)	139,656	25,275	1,526	17/02/22	14
VN30F2203	1,503.0	(0.9)	161	320	1,527	17/03/22	42
VN30F2206	1,501.1	(0.4)	75	505	1,529	16/06/22	133
VN30F2209	1,504.0	(0.5)	83	128	1,531	15/09/22	224

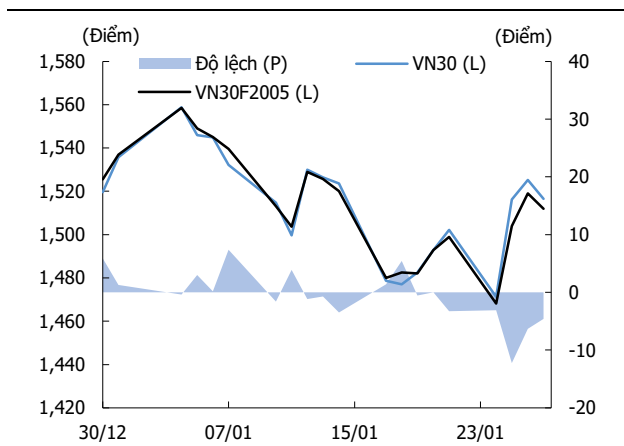
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

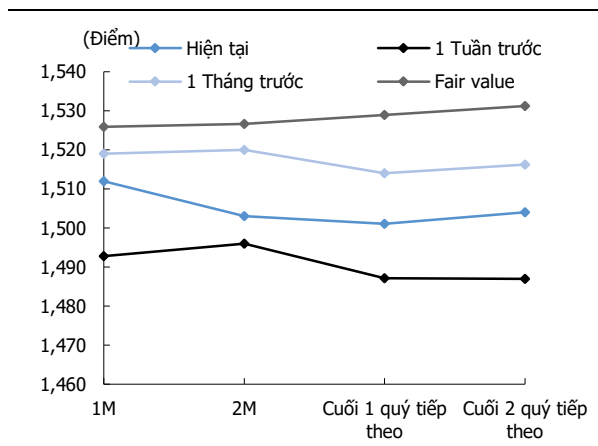
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

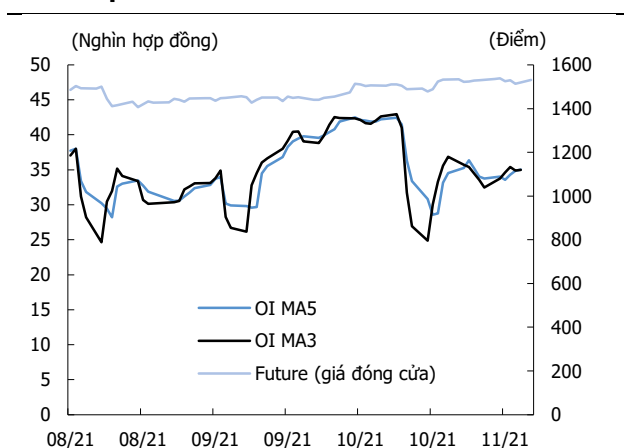
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

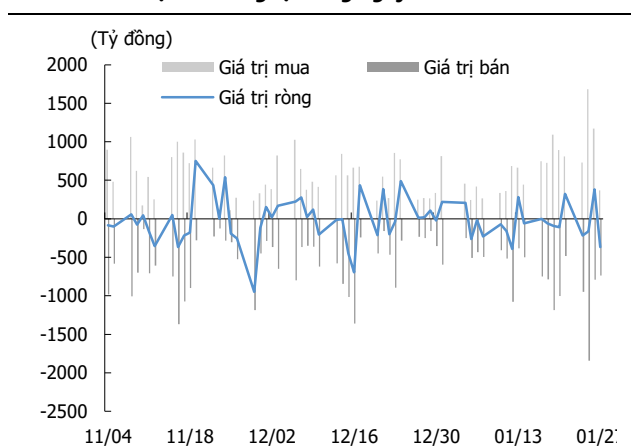
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	94,298	5.74	34,900	(1.6)	9.8	2.10	5,214	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	240,786	0.69	47,600	(1.0)	24.4	2.91	3,377	16.8	49,950	29,021
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	39,937	0.29	53,800	1.5	21.8	1.87	1,071	26.4	66,500	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	177,332	1.91	36,900	(2.0)	10.7	1.87	12,223	25.8	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	77,959	4.75	85,900	(0.1)	19.7	4.34	1,661	49.0	101,800	50,957
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	213,980	0.77	111,800	(0.4)	25.5	4.19	1,228	2.8	128,400	72,500
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	122,800	0.35	30,700	(1.0)	28.9	2.57	3,672	0.5	43,300	21,600
HDB	HDBank	Tài chính	61,976	3.08	30,800	0.3	10.1	2.22	6,252	17.2	33,950	16,160
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	188,534	7.29	42,150	(3.0)	5.9	2.24	22,267	23.7	58,400	27,407
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	32,211	1.50	50,100	(0.6)	27.0	3.30	2,569	32.9	57,500	25,909
MBB	MBBank	Tài chính	124,685	4.91	33,000	(0.9)	11.2	2.22	13,234	23.2	33,900	15,778
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	167,636	4.81	142,000	(3.4)	69.9	7.79	2,113	28.8	175,000	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	93,738	4.37	131,500	(0.3)	21.5	4.99	1,105	49.0	145,500	79,333
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	152,503	3.83	79,000	(0.5)	43.5	4.46	4,097	7.2	94,351	42,534
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	43,118	1.24	87,500	0.8	23.3	6.11	4,170	2.9	99,800	40,938
PLX	Petrolimex	Năng lượng	72,424	0.52	57,000	0.0	21.5	2.95	1,903	17.2	62,400	45,500
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	22,964	1.32	101,000	0.0	8.1	3.82	581	47.5	112,000	75,000
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	38,407	0.55	16,400	0.6	13.2	1.27	25,425	2.7	20,800	9,980
SAB	SABECO	TD thiết yếu	95,423	0.75	148,800	3.5	26.3	4.50	140	62.5	192,500	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	42,634	1.99	43,400	2.2	20.0	3.15	18,520	38.7	57,700	16,977
STB	Sacombank	Tài chính	66,737	4.54	35,400	(0.4)	18.9	2.00	23,532	18.2	36,500	15,500
TCB	Techcombank	Tài chính	182,216	8.49	51,900	(1.0)	10.1	1.98	13,753	22.5	58,600	29,600
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	63,587	2.73	40,200	2.6	12.2	2.45	6,340	29.3	44,000	16,296
VCB	Vietcombank	Tài chính	430,659	3.39	91,000	(3.7)	20.4	3.94	1,429	23.6	96,000	67,006
VHM	Vinhomes	Bất động sản	352,704	6.19	81,000	(0.2)	9.1	3.09	7,039	23.7	93,769	64,615
VIC	VinGroup	Bất động sản	367,203	7.52	96,500	0.1	77.3	3.62	2,839	13.7	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	65,589	2.35	121,100	0.0	30.1	3.88	794	16.4	138,500	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	173,675	4.98	83,100	4.3	18.4	5.59	2,496	54.6	110,000	79,100
VPB	VPBank	Tài chính	157,592	7.34	35,450	(1.3)	13.2	2.01	14,170	15.2	40,722	15,667
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	77,713	1.82	34,200	0.9	35.9	2.55	8,749	29.9	37,000	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 © 2022 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.