

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,444 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 380 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên HPG, BVH, và CTG.

Đồ thị VN30 Future: Lực cầu vẫn ở mức thấp

Độ biến động bắt đầu gia tăng trên VN30F2205 quanh vùng 1,420 điểm. Tuy nhiên, lực cầu vẫn tiếp tục ở mức thấp và áp lực bán vẫn duy trì ở mức cao. Vùng cầu kế tiếp là vùng 1,420 điểm. Đáng chú ý, hợp đồng này khả năng cao sẽ hình thành vùng tích lũy với độ biến động gia tăng quanh ngưỡng 1,420 điểm. Điềm vào lệnh cho vị thế bán mới vẫn chưa được xác nhận, traders nên tiếp tục đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy kế tiếp.

Chiến lược đầu tư

Traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy để mở vị thế bán sau phiên phục hồi hoặc sau giai đoạn tích lũy.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

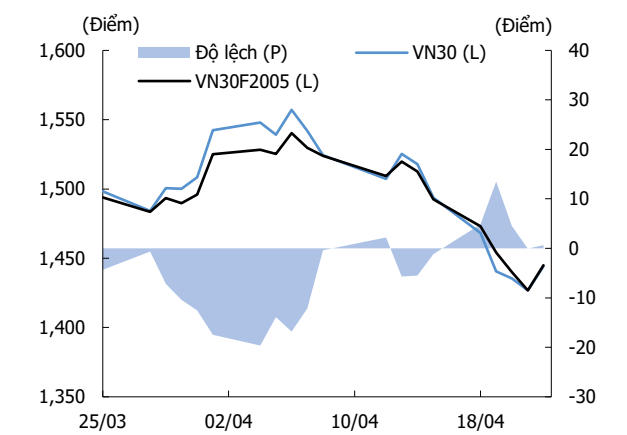
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,444.3	1.2					
VN30F2205	1,445.0	(0.3)	226,792	35,569	1,427	19/05/22	27
VN30F2206	1,444.6	(0.6)	532	833	1,429	16/06/22	55
VN30F2209	1,447.9	(0.1)	84	216	1,431	15/09/22	146
VN30F2212	1,441.8	-	29	14	1,439	15/12/22	237

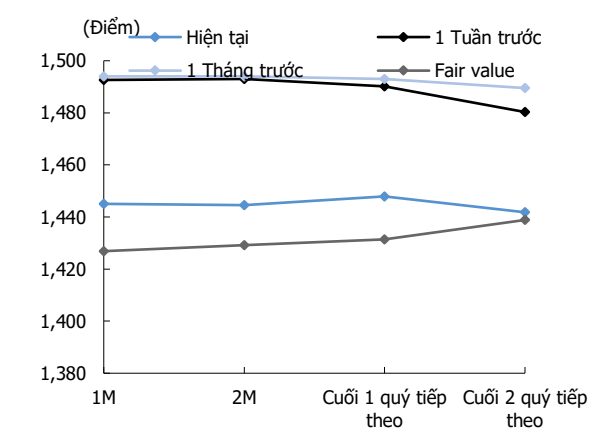
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

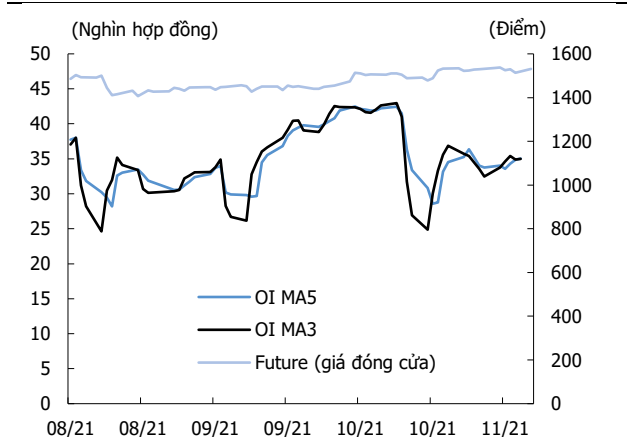
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

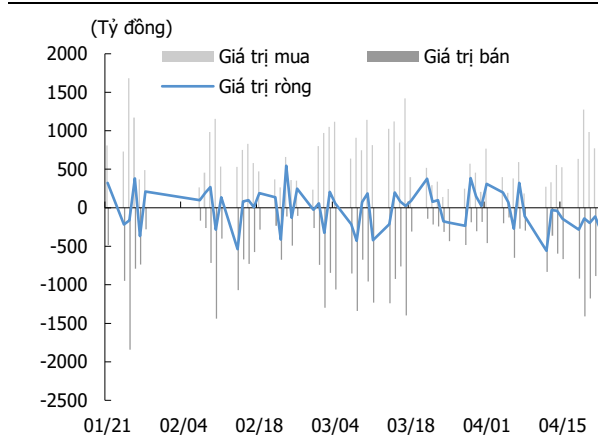
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	87,273	5.55	32,300	2.5	9.1	1.94	6,256	30.0	38,200	25,680
BID	BIDV	Tài chính	194,753	0.58	38,500	0.0	18.5	2.34	2,726	16.8	49,950	30,055
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	46,766	0.35	63,000	(5.3)	24.7	2.21	1,320	26.3	70,000	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	141,289	1.59	29,400	1.4	10.0	1.52	8,185	25.7	42,535	28,400
FPT	FPT Corp	CNTT	100,829	6.41	111,100	(0.8)	23.2	5.62	2,036	49.0	118,900	69,304
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	214,937	0.80	112,300	7.0	25.6	4.21	991	2.8	128,400	79,800
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	118,000	0.35	29,500	(3.3)	28.4	2.46	2,182	0.5	43,300	22,700
HDB	HDBank	Tài chính	50,607	2.62	25,150	1.0	8.3	1.73	4,779	16.0	33,950	20,800
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	195,914	8.06	43,800	1.0	6.1	2.16	21,190	21.6	58,400	40,200
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	31,504	1.53	49,000	2.1	27.5	3.09	1,225	32.6	57,500	29,455
MBB	MBBank	Tài chính	113,350	4.66	30,000	0.0	8.9	1.90	17,733	23.2	34,900	21,556
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	174,672	5.23	123,300	0.2	20.4	5.32	1,113	28.4	145,833	78,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	114,049	5.40	155,800	0.2	22.5	5.45	1,586	50.3	162,800	90,000
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	156,364	4.09	81,000	1.1	42.4	4.46	3,959	6.6	94,351	59,637
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	43,590	1.30	64,900	2.4	23.4	5.97	4,574	2.3	73,221	49,919
PLX	Petrolimex	Năng lượng	63,657	0.48	50,100	(0.4)	21.4	2.53	2,480	17.1	65,900	47,800
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	27,872	1.77	115,000	(3.4)	8.1	3.48	1,190	52.2	124,000	84,900
POW	Điện Lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,264	0.58	13,350	0.4	17.4	1.09	15,491	2.0	20,800	9,980
SAB	SABECO	TD thiết yếu	109,210	0.90	170,300	0.4	29.8	5.15	175	62.7	181,400	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	35,789	1.87	36,050	0.0	11.9	2.39	9,470	37.5	57,700	20,578
STB	Sacombank	Tài chính	54,294	3.86	28,800	4.2	15.5	1.58	19,018	20.8	36,700	20,900
TCB	Techcombank	Tài chính	154,831	7.53	44,100	1.1	8.6	1.68	8,475	22.5	58,600	39,100
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	55,678	2.50	35,200	1.1	10.6	2.03	5,778	29.9	44,000	19,852
VCB	Vietcombank	Tài chính	389,013	3.20	82,200	4.8	17.7	3.57	1,389	23.6	96,000	73,276
VHM	Vinhomes	Bất động sản	281,728	4.94	64,700	1.1	7.2	2.26	4,215	23.5	93,769	63,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	296,343	6.06	77,700	0.3	79	2.88	3,516	12.6	127,022	77,000
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	74,851	2.80	138,200	1.2	30.1	4.44	881	16.8	149,000	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	158,628	4.75	75,900	1.2	16.8	4.79	2,542	54.2	99,900	73,400
VPB	VPBank	Tài chính	163,593	8.57	36,800	3.7	9.5	1.88	18,187	17.5	41,050	25,583
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	70,215	1.64	30,900	1.3	53.4	2.29	5,714	30.5	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.