

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,286 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán quay trở lại. Giá trị bán ròng ở mức 190 tỷ đồng trong tuần giao dịch trước. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên HPG, STB, và VCB.

Đồ thị VN30 Future: Đà giảm chững lại

VN30F2205 tiếp tục phục hồi sau khi nhận được lực cầu quanh vùng 1,200 điểm và đã giảm đã chững lại trong ngắn hạn. Tuy nhiên, áp lực bán ở vùng trên vẫn duy trì ở mức cao. Vùng 1,200 điểm sẽ là vùng cầu quan trọng trong các phiên kế tiếp. Mặc dù lực cầu gia tăng đáng kể, hợp đồng này vẫn cần thời gian để tích cầu và độ biến động sẽ duy trì ở mức cao. Đáng chú ý, các đường MA chủ đạo hướng xuống, xu hướng giảm vẫn là xu hướng chủ đạo. Trong trường hợp này, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy hơn đến từ hợp đồng tiếp theo.

Chiến lược đầu tư

Mặc dù lực cầu gia tăng đáng kể, hợp đồng này vẫn cần thời gian để tích cầu và độ biến động sẽ duy trì ở mức cao. Trong trường hợp này, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy hơn từ hợp đồng kế tiếp (VN30F2206).

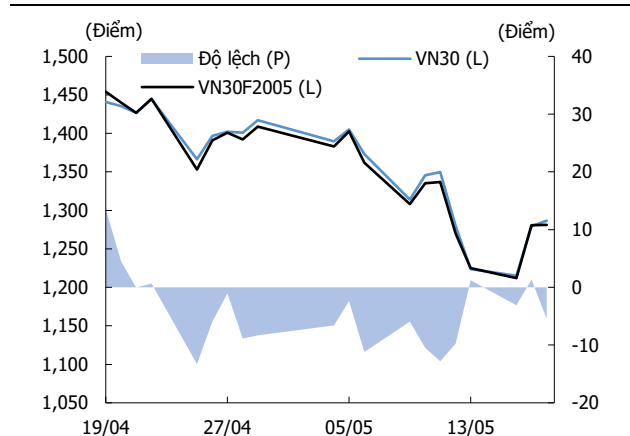
Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,286.4	0.5					
VN30F2205	1,281.0	0.01	411,543	18,983	1,280	19/05/22	3
VN30F2206	1,281.5	(0.02)	15,632	11,008	1,282	16/06/22	31
VN30F2209	1,286.8	0.9	109	152	1,289	15/09/22	122
VN30F2212	1,281.5	0.6	30	123	1,296	15/12/22	213

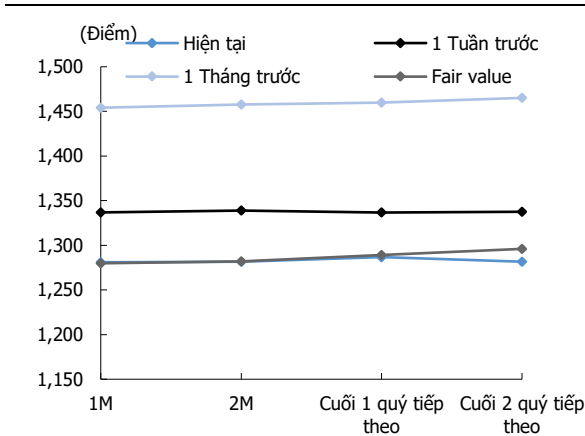
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

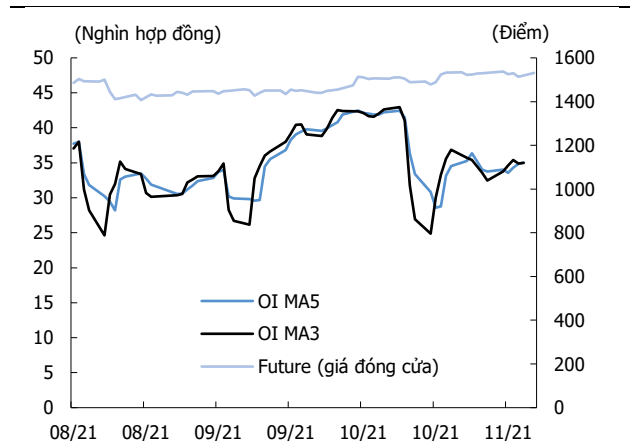
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

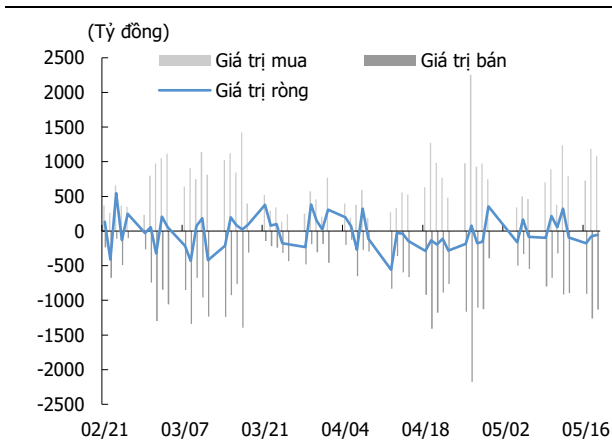
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	78,221	5.43	28,950	(1.0)	7.5	1.62	4,872	30.0	38,200	27,500
BID	BIDV	Tài chính	176,542	0.58	34,900	1.3	15.4	2.04	2,242	16.8	49,950	30,055
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	37,636	0.31	50,700	(1.0)	19.8	1.74	1,681	26.3	70,000	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	127,833	1.57	26,600	1.3	10.4	1.31	6,259	26.0	42,535	23,500
FPT	FPT Corp	CNTT	89,317	6.16	97,700	(2.0)	19.0	4.62	2,577	49.0	118,900	74,957
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	200,965	0.82	105,000	4.1	20.6	3.68	866	2.9	128,400	79,800
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	93,400	0.31	23,350	0.0	21.2	1.88	2,349	0.6	43,300	21,000
HDB	HDBank	Tài chính	48,293	2.73	24,000	0.0	7.5	1.54	3,994	16.2	33,950	21,500
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	170,866	7.68	38,200	0.0	5.1	1.73	21,378	21.7	58,400	35,750
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	26,682	1.42	41,500	(0.5)	22.1	2.54	1,237	32.8	57,500	31,818
MBB	MBBank	Tài chính	100,692	4.53	26,650	1.3	7.4	1.57	14,496	23.2	34,900	24,100
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	146,197	4.78	103,200	6.9	14.7	5.32	1,156	28.6	145,833	85,700
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	97,725	5.59	133,500	1.4	19.0	4.37	1,857	49.0	162,800	90,000
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	152,664	4.32	78,300	0.0	36.1	4.19	4,120	6.4	94,351	72,500
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	37,478	1.22	55,800	(2.1)	20.1	5.13	4,055	2.3	73,221	50,624
PLX	Petrolimex	Năng lượng	52,603	0.43	41,400	(1.0)	21.2	2.06	2,240	17.3	65,900	37,050
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	24,746	1.72	102,100	(1.0)	8.1	3.09	1,175	52.2	124,000	84,900
POW	Điện Lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	29,625	0.61	12,650	2.0	14.7	1.01	14,259	2.1	20,800	9,980
SAB	SABECO	TD thiết yếu	103,567	0.93	161,500	(2.4)	27.1	4.84	179	62.7	181,400	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	28,443	1.63	28,650	(1.7)	9.5	1.90	10,553	37.5	57,700	23,055
STB	Sacombank	Tài chính	41,003	3.18	21,750	6.9	10.4	1.16	16,255	21.4	36,700	18,600
TCB	Techcombank	Tài chính	126,568	6.72	36,050	3.4	6.6	1.30	7,648	22.5	58,600	32,550
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	50,933	2.29	32,200	(2.4)	9.7	1.86	4,675	30.0	44,000	23,259
VCB	Vietcombank	Tài chính	356,832	3.21	75,400	(0.8)	15.5	3.05	1,258	23.6	96,000	73,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	291,307	6.62	66,900	0.0	7.6	2.25	4,489	23.4	93,769	59,200
VIC	VinGroup	Bất động sản	297,487	7.89	78,000	0.0	79	2.84	2,829	12.6	112,444	72,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	68,081	2.78	125,700	(1.8)	30.1	3.98	815	16.8	149,000	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	146,924	4.80	70,300	0.4	16.0	4.56	2,616	54.4	93,600	65,200
VPB	VPBank	Tài chính	137,587	7.87	30,950	(0.2)	8.0	1.58	18,373	17.5	41,050	28,950
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	62,262	1.89	27,400	0.0	68.3	2.01	5,011	31.1	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.