

Đà giảm vẫn duy trì

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,263 điểm. Về hoạt động khối ngoại, nhà đầu tư nước ngoài tiếp tục bán ròng với giá trị ròng là 88 tỷ đồng trên. Họ bán nhiều nhất STB, SSI, và GAS.

Đồ thị VN30 Future: Kiểm định vùng 1,250 điểm

Mặc dù lực cầu đã quay trở lại VN30F2210 khi hợp đồng này kiểm định vùng 1,250 điểm nhưng áp lực bán tại vùng 1,280 điểm đã hình thành mô hình đỉnh sau thấp hơn đỉnh trước. Vùng dao động (vùng 1,250 - 1,300 điểm) vẫn duy trì. Nếu vùng 1,250 điểm bị phá vỡ, giai đoạn phục hồi sẽ không còn. Ở chiều ngược lại, nếu vùng 1,300 điểm bị phá vỡ, vùng 1,350 điểm sẽ là vùng kháng cự quan trọng tiếp theo. Hợp đồng này sẽ duy trì dao động trong vùng 1,250-1,300 điểm trong thời gian sắp tới.

Chiến lược đầu tư

Mở vị thế bán trên VN30F2210 nếu như xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,250 điểm và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên ngưỡng 1,280 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	1,262.8	0.2					
VN30F2209	1,262.2	0.3	146,921	-	1,261	15/09/22	0
VN30F2210	1,258.5	0.5	28,340	31,997	1,265	20/10/22	35
VN30F2212	1,255.0	0.3	48	810	1,271	15/12/22	91
VN30F2303	1,246.6	0.3	111	548	1,281	16/03/23	182

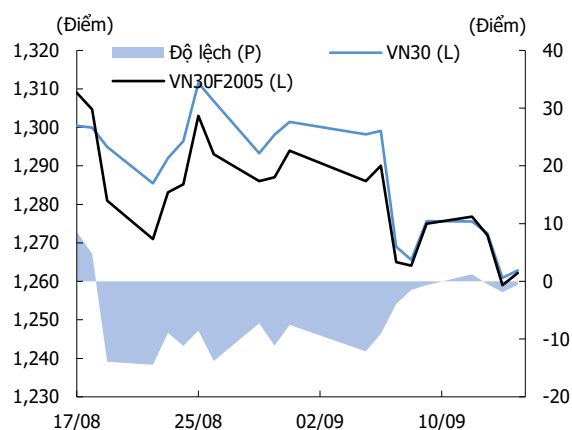
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

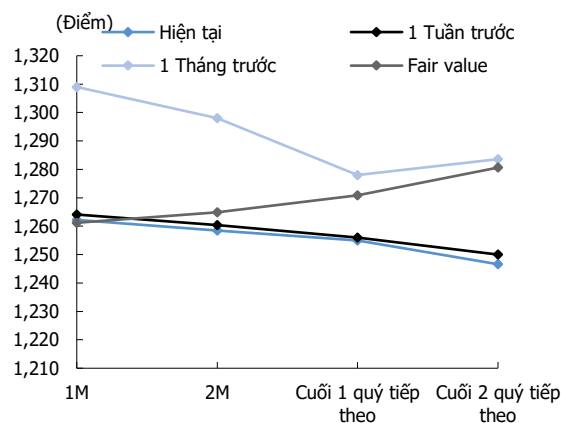
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

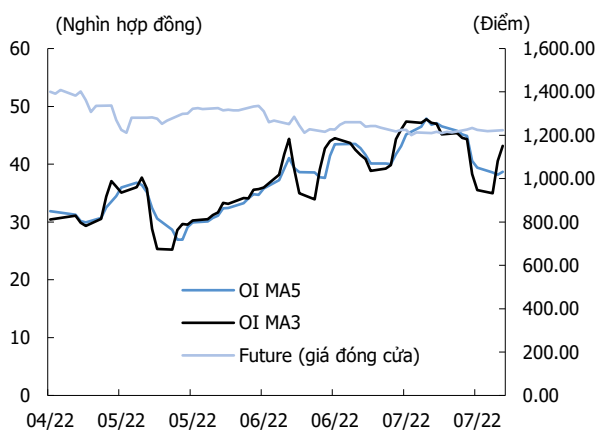
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

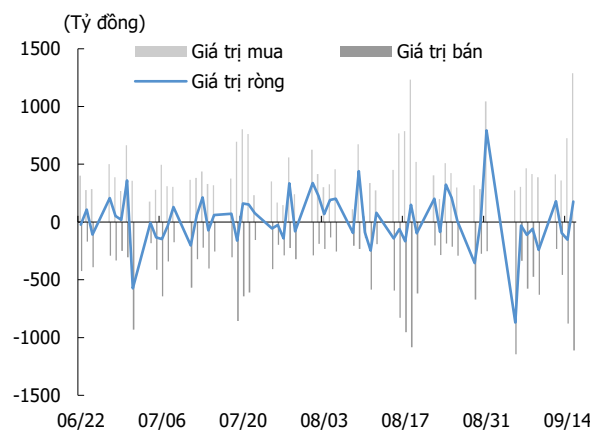
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	79,539	5.54	23,550	0.2	6.8	1.53	2,642	30.0	29,080	22,000
BID	BIDV	Tài chính	180,842	0.59	35,750	(2.1)	14.0	1.99	1,731	16.9	49,950	28,950
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	42,015	0.34	56,600	0.4	23.5	1.92	1,261	26.4	70,000	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	129,275	1.59	26,900	(0.4)	8.8	1.27	3,884	26.8	38,200	22,500
FPT	FPT Corp	CNTT	91,821	6.39	83,700	(0.4)	18.5	4.69	1,634	49.0	99,083	70,000
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	213,980	0.88	111,800	(0.6)	16.8	3.60	776	3.0	134,000	86,300
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	102,000	0.33	25,500	2.0	21.9	2.06	1,884	0.5	43,300	20,500
HDB	HDBank	Tài chính	50,607	2.90	25,150	(0.2)	7.2	1.52	2,064	18.1	33,950	21,500
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	137,229	6.18	23,600	(0.4)	5.0	1.38	25,168	20.6	44,923	20,500
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	25,447	1.35	35,500	(0.6)	20.2	2.34	868	31.5	52,273	33,909
MBB	MBBank	Tài chính	100,428	4.52	22,150	(1.1)	6.4	1.48	9,733	19.4	29,083	18,208
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	159,457	5.88	112,000	0.0	15.6	5.46	741	29.0	145,833	85,700
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	108,168	6.20	73,900	0.3	21.5	4.83	3,626	49.0	81,400	58,200
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	166,321	5.45	85,300	2.2	51.7	4.48	2,562	5.6	91,000	72,000
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	34,455	1.13	51,300	0.8	16.4	4.47	1,963	2.7	73,221	48,200
PLX	Petrolimex	Năng lượng	49,934	0.41	39,300	(0.3)	54.4	2.15	993	17.5	65,900	37,050
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	27,528	2.18	111,900	0.2	8.1	3.38	664	48.3	131,100	88,500
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	33,840	0.69	14,450	2.1	21.4	1.14	14,960	2.5	20,800	11,450
SAB	SABECO	TD thiết yếu	118,829	1.07	185,300	0.7	26.4	5.17	131	62.8	197,900	142,900
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	32,240	1.85	21,650	(1.4)	8.1	1.61	18,924	34.9	54,232	16,965
STB	Sacombank	Tài chính	43,454	3.56	23,050	0.0	12.1	1.21	13,544	22.5	36,700	18,600
TCB	Techcombank	Tài chính	128,731	6.84	36,600	(0.5)	6.3	1.24	4,131	22.4	56,000	32,550
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	41,996	1.72	26,550	0.0	7.6	1.45	1,843	30.0	44,000	24,800
VCB	Vietcombank	Tài chính	374,815	3.38	79,200	1.1	14.0	1.40	1,075	23.5	96,000	68,900
VHM	Vinhomes	Bất động sản	263,439	6.47	60,500	0.8	9.3	2.18	2,377	23.2	87,500	58,300
VIC	VinGroup	Bất động sản	243,710	4.99	63,900	0.8	79.0	2.29	1,367	12.2	109,600	62,100
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	62,827	2.57	116,000	(0.2)	30.1	3.66	571	16.4	149,000	113,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	155,702	5.10	74,500	0.7	18.4	4.56	2,267	55.0	92,400	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	135,607	7.72	30,300	0.0	8.1	1.49	11,008	17.7	41,050	26,500
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	65,556	2.15	28,850	1.2	50.6	2.06	1,602	32.0	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.