

26/09/2022

Đà giảm chưa có dấu hiệu suy yếu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,215 điểm. Về hoạt động khối ngoại, nhà đầu tư nước ngoài tiếp tục bán ròng với giá trị ròng là 180 tỷ đồng trên. Họ bán nhiều nhất MSN, KDH, và STB.

Đồ thị VN30 Future: Đà giảm chưa có dấu hiệu suy yếu

VN30F2210 tiếp tục chịu ảnh hưởng từ áp lực bán, kiểm định lại vùng đáy cũ và chưa có dấu hiệu cho sự trở lại của lực cầu. Hợp đồng này đang được giao dịch dưới các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý rằng xu hướng giảm đang tiếp tục. Ngoài ra, đà giảm chưa có dấu hiệu suy yếu khi các mẫu nến giảm liên tục xuất hiện.

Chiến lược đầu tư

Vị thế bán trên VN30F2210 nên được tiếp tục nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên ngưỡng 1,250 điểm. (Đồ thị giờ)

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

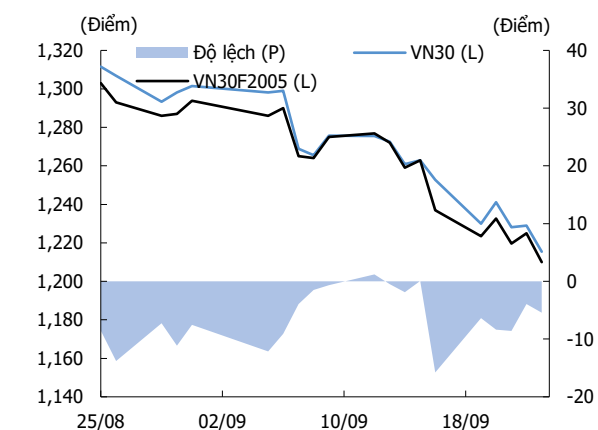
	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,215.4	(1.1)					
VN30F2210	1,210.0	(1.2)	280,782	44,225	1,233	20/10/22	27
VN30F2211	1,204.4	(1.2)	1,106	1,205	1,237	17/11/22	55
VN30F2212	1,206.3	(1.1)	139	916	1,241	15/12/22	83
VN30F2303	1,213.6	(0.3)	129	697	1,253	16/03/23	174

Nguồn: Bloomberg, KIS

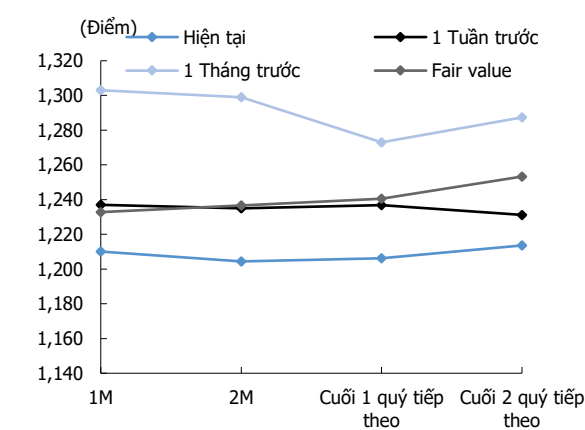
Đăng Lê
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

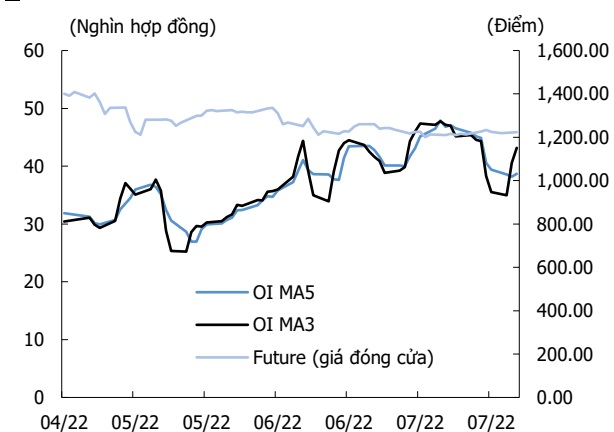
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

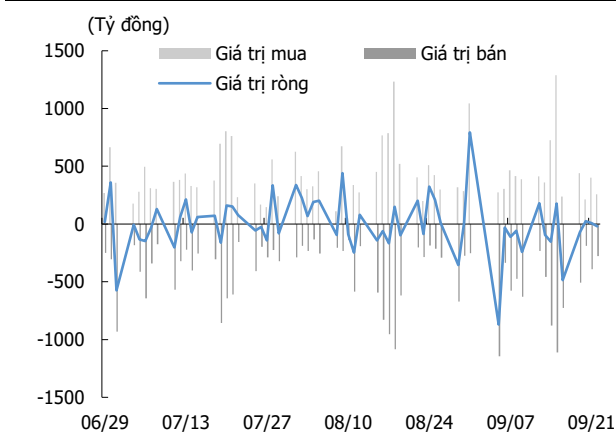
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	76,330	5.52	22,600	(0.9)	6.5	1.47	2,574	30.0	29,080	22,000
BID	BIDV	Tài chính	175,784	0.60	34,750	(1.1)	13.6	1.93	1,736	16.9	49,950	28,950
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	43,352	0.37	58,400	5.8	24.2	1.98	1,235	26.4	70,000	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	120,144	1.53	25,000	(1.6)	8.2	1.18	3,797	26.9	38,200	22,500
FPT	FPT Corp	CNTT	90,395	6.54	82,400	(0.6)	18.3	4.62	1,536	49.0	99,083	70,000
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	215,319	0.92	112,500	1.4	16.9	3.63	639	3.0	134,000	88,800
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	93,400	0.32	23,350	(1.1)	20.1	1.89	1,883	0.5	43,300	20,500
HDB	HDBank	Tài chính	48,897	2.91	24,300	(1.6)	7.0	1.47	1,946	18.1	33,950	21,500
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	131,996	6.18	22,700	(1.3)	4.8	1.32	23,435	20.9	44,923	20,500
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	22,437	1.24	31,300	(0.5)	17.8	2.06	1,034	31.0	52,273	30,200
MBB	MBBank	Tài chính	95,214	4.46	21,000	(1.2)	6.1	1.41	9,064	23.2	29,083	18,208
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	154,617	5.92	108,600	(1.3)	15.1	5.29	692	29.0	145,833	85,700
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	101,581	6.05	69,400	(1.0)	20.2	4.54	3,630	49.0	81,400	58,200
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	164,761	5.61	84,500	(0.1)	51.2	4.44	2,629	5.5	91,000	72,000
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	34,120	1.16	50,800	(1.6)	16.3	4.43	1,966	2.6	73,221	48,200
PLX	Petrolimex	Năng lượng	47,266	0.40	37,200	(0.9)	51.5	2.04	1,016	17.5	65,900	37,000
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	28,020	2.20	113,900	(0.1)	8.1	3.44	631	49.0	131,100	90,600
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,381	0.67	13,400	(1.8)	19.8	1.06	14,215	2.7	20,800	11,450
SAB	SABECO	TD thiết yếu	119,920	1.12	187,000	0.0	26.6	5.21	132	62.8	197,900	142,900
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	30,751	1.83	20,650	(2.1)	7.7	1.53	18,686	34.7	54,232	16,965
STB	Sacombank	Tài chính	40,438	3.44	21,450	(2.3)	11.3	1.13	13,214	21.7	36,700	18,600
TCB	Techcombank	Tài chính	120,290	6.64	34,200	(1.0)	5.9	1.16	3,951	22.4	56,000	32,550
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	39,623	1.69	25,050	(1.2)	7.1	1.37	1,619	30.0	44,000	24,700
VCB	Vietcombank	Tài chính	359,198	3.36	75,900	(2.7)	14.0	1.40	1,072	23.5	96,000	68,900
VHM	Vinhomes	Bất động sản	249,070	6.36	57,200	(0.9)	8.8	2.06	2,328	23.1	87,500	56,600
VIC	VinGroup	Bất động sản	238,752	5.08	62,600	(1.1)	79.0	2.21	1,265	12.2	109,600	58,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	61,094	2.60	112,800	(1.9)	30.1	3.56	584	16.2	149,000	112,700
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	160,300	5.46	76,700	(0.3)	18.9	4.70	2,179	55.0	92,400	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	128,670	7.61	28,750	(1.9)	7.7	1.41	11,375	17.7	41,050	26,500
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,761	2.20	28,500	(0.5)	50.0	2.04	1,510	32.1	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.