

Vùng biến động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,053 điểm. Khối ngoại tiếp tục mua ròng với giá trị 216 tỷ đồng trên HSX. Họ mua ròng nhiều nhất FRT, SSI và VNM.

Đồ thị VN30 Future: Vùng biến động

Hợp đồng VN30F2211 kiểm định lại vùng 1,050 điểm lần thứ 3. Tuy nhiên, áp lực bán quanh vùng 1,050 điểm vẫn duy trì ở mức cao và hợp đồng VN30F2211 vẫn chưa thể phá vỡ vùng này. Hợp đồng này đang được giao dịch dưới các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý rằng xu hướng giảm đang tiếp tục. Đáng chú ý, hợp đồng mở (OI) giảm, điều này hàm ý rằng đã giảm sẽ chững lại và giai đoạn tích lũy có thể xuất hiện. Xu hướng giảm vẫn là xu hướng chủ đạo và áp lực bán vẫn duy trì ở mức cao quanh vùng 1,050 điểm. Trong trường hợp này, traders đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy.

Chiến lược đầu tư

Trong trường hợp này, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu giao dịch tin cậy trên hợp đồng VN30F2211.

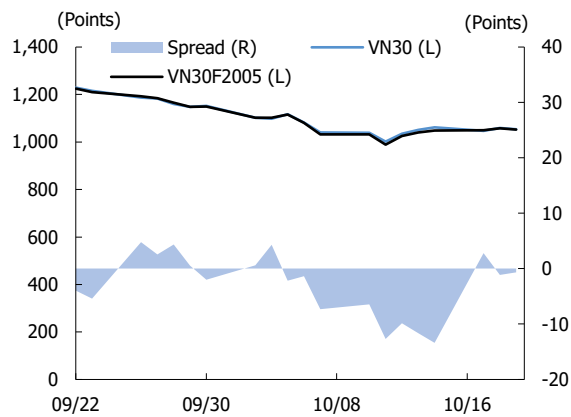
Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,053.3	(0.0)					
VN30F2210	1,058.0	0.5	279,390	-	1,054	20/10/22	0
VN30F2211	1,037.2	(0.1)	38,565	33,002	1,058	17/11/22	28
VN30F2212	1,039.9	0.1	78	470	1,062	15/12/22	56
VN30F2303	1,030.6	(1.1)	115	529	1,075	16/03/23	147

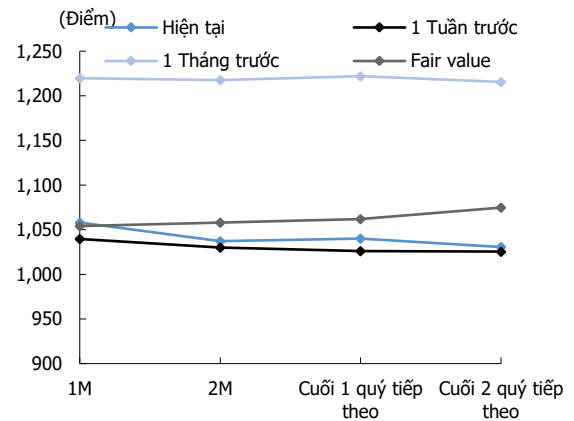
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

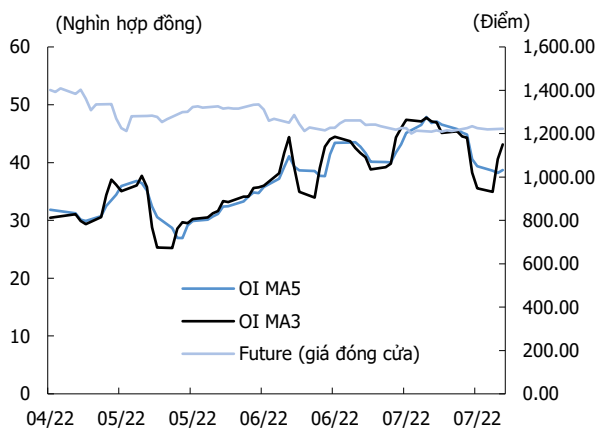
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

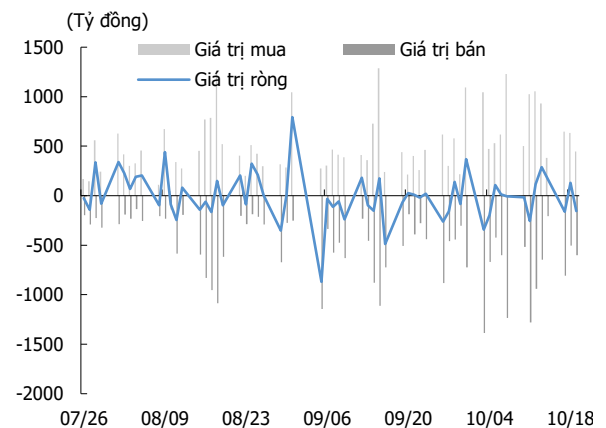
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	72,108	6.02	21,350	1.2	6.1	1.38	3,091	30.0	29,080	17,450
BID	BIDV	Tài chính	167,690	0.66	33,150	0.5	12.9	1.84	1,486	16.9	49,950	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	37,858	0.37	51,000	(0.4)	21.2	1.73	1,304	26.4	70,000	46,600
CTG	VietinBank	Tài chính	111,734	1.65	23,250	0.2	7.6	1.10	4,019	26.9	38,200	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	85,349	7.12	77,800	3.0	17.2	4.36	1,548	49.0	99,083	70,000
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	212,257	1.04	110,900	1.6	16.6	3.57	504	3.0	134,000	91,000
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	64,800	0.25	16,200	(2.1)	13.9	1.31	1,933	0.5	43,300	14,650
HDB	HDBank	Tài chính	42,256	2.90	16,800	0.6	6.0	1.27	2,417	14.5	27,160	15,550
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	105,248	5.68	18,100	(1.6)	3.8	1.05	25,432	20.6	44,769	17,050
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	18,279	1.17	25,500	(1.4)	14.5	1.68	1,653	29.1	52,273	24,100
MBB	MBBank	Tài chính	77,758	4.20	17,150	(2.0)	4.9	1.15	9,312	23.2	29,083	16,050
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	114,183	5.05	80,200	0.3	11.2	3.91	831	29.1	145,833	74,900
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	85,471	5.88	58,400	(1.0)	17.0	3.82	3,683	49.0	81,400	53,000
NVL	Đầu tư Địa Ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	146,433	5.75	75,100	0.1	45.5	3.95	2,885	5.3	91,000	71,100
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	32,911	1.29	49,000	(1.0)	15.1	3.91	2,086	2.6	73,221	47,250
PLX	Petrolimex	Năng lượng	42,565	0.42	33,500	0.8	46.4	1.83	1,244	17.5	65,900	31,300
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	26,470	2.27	107,600	0.1	8.1	3.25	528	49.0	131,100	91,200
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	25,409	0.62	10,850	(1.4)	16.1	0.86	13,457	2.8	20,800	10,200
SAB	SABECO	TD thiết yếu	122,677	1.33	191,300	0.2	22.7	5.33	154	62.8	197,900	142,900
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	25,911	1.78	17,400	(1.4)	6.5	1.29	18,799	34.9	54,232	16,200
STB	Sacombank	Tài chính	32,331	3.18	17,150	(0.9)	9.0	0.90	13,382	20.7	36,700	15,750
TCB	Techcombank	Tài chính	86,524	5.51	24,600	(2.4)	4.3	0.83	4,768	22.5	56,000	23,550
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	32,584	1.60	20,600	0.2	5.9	1.12	1,968	30.0	44,000	18,300
VCB	Vietcombank	Tài chính	327,490	3.54	69,200	1.9	14.0	1.40	1,150	23.5	96,000	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	217,718	6.41	50,000	0.0	7.7	1.80	2,290	23.1	87,500	47,200
VIC	VinGroup	Bất động sản	223,497	5.49	58,600	0.2	79.0	2.07	1,171	12.3	109,600	53,000
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	58,981	2.90	108,900	(0.2)	30.1	3.43	536	16.3	149,000	105,100
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	161,972	6.36	77,500	1.2	19.1	4.74	2,191	55.2	91,500	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	107,076	7.31	15,950	0.0	5.3	0.75	17,912	11.8	27,367	14,300
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	57,035	2.24	25,100	(0.4)	44.0	1.80	1,529	32.3	37,000	22,000

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.