

Biến động mạnh trong phiên

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 990 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

Áp lực bán đã giảm trên VN30F2211 khi hợp đồng này kiểm đỉnh vùng 920 điểm. Hợp đồng này đang được giao dịch dưới các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý rằng xu hướng giảm đang tiếp tục. Đà giảm chỉ chững lại khi vùng 1,050 điểm bị phá vỡ. Đáng chú ý, hợp đồng mở (OI) duy trì ở mức cao, điều này hàm ý rằng đà giảm đã quay trở lại và xu hướng giảm sẽ tiếp tục. Mặc dù xu hướng giảm vẫn là xu hướng chủ đạo và áp lực bán vẫn duy trì ở mức cao, nhưng giai đoạn phục hồi trong phiên vẫn có thể xuất hiện. 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

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	990.4	(0.1)				
VN30F2211	967.5	0.7	469,159	46,912	1,014	17/11/22
VN30F2212	962.9	0.8	977	1,092	1,018	15/12/22
VN30F2303	959.6	1.4	114	302	1,031	16/03/23
VN30F2306	961.9	0.9	56	181	1,043	15/06/23

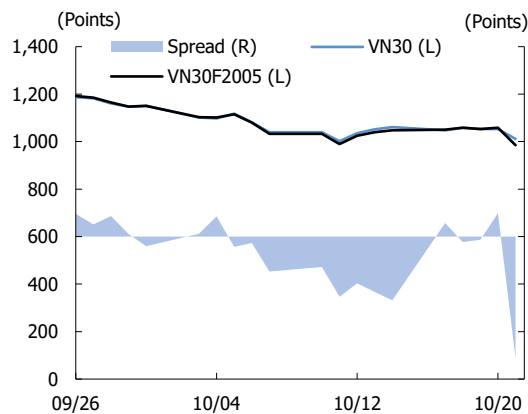
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

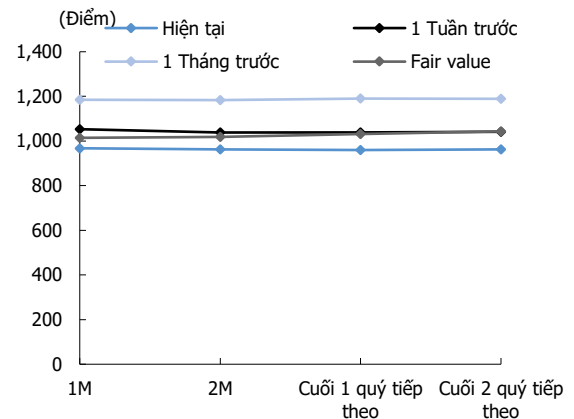
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

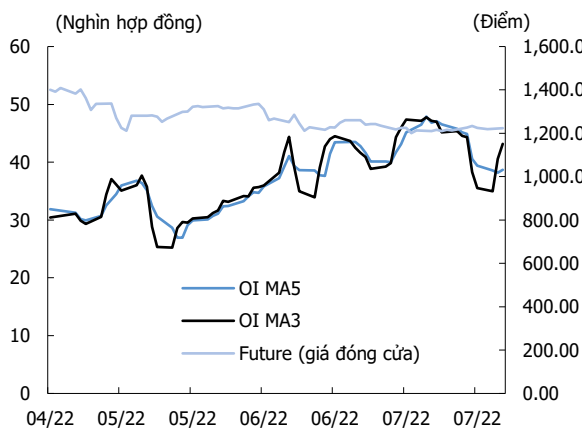
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

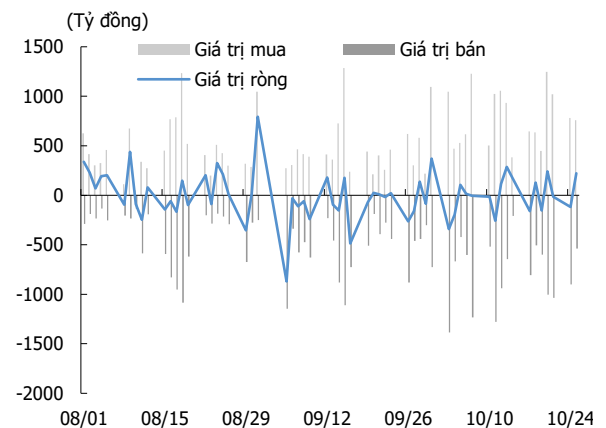
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	69,744	6.19	20,650	1.2	5.3	1.25	3,156	30.0	29,080	17,450
BID	BIDV	Tài chính	160,355	0.67	31,700	1.3	12.4	1.76	1,496	16.9	49,950	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	38,007	0.40	51,200	2.4	21.2	1.73	1,298	26.4	70,000	46,600
CTG	VietinBank	Tài chính	107,649	1.69	22,400	(0.2)	7.3	1.06	4,158	26.9	38,200	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	80,961	7.19	73,800	0.8	15.4	4.07	1,535	49.0	99,083	70,000
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	206,707	1.08	108,000	0.7	16.2	3.48	469	3.0	134,000	91,000
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	54,000	0.23	13,500	1.5	11.6	1.09	1,944	0.5	43,300	13,100
HDB	HDBank	Tài chính	40,118	2.93	15,950	(0.3)	5.3	1.14	2,439	18.1	27,160	15,400
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	98,270	5.64	16,900	(1.2)	3.6	0.98	26,315	20.2	44,769	16,050
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	15,555	1.06	21,700	3.3	12.4	1.43	1,748	28.9	52,273	20,650
MBB	MBBank	Tài chính	74,357	4.27	16,400	0.0	4.7	1.10	9,673	23.2	29,083	15,450
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	111,051	5.22	78,000	4.0	10.9	3.80	880	29.2	145,833	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	75,958	5.55	51,900	(0.2)	15.1	3.39	3,611	49.0	81,400	49,000
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	145,263	6.07	74,500	(0.7)	45.1	3.92	2,909	5.3	91,000	70,500
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	30,560	1.28	45,500	(2.6)	14.1	3.63	2,083	2.6	73,221	44,600
PLX	Petrolimex	Năng lượng	35,259	0.37	27,750	(0.9)	38.4	1.52	1,290	17.5	65,900	27,300
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	25,437	2.31	103,400	1.8	8.1	3.01	514	49.0	131,100	91,200
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	23,419	0.61	10,000	0.3	14.8	0.79	13,396	2.9	20,800	9,470
SAB	SABECO	TD thiết yếu	119,342	1.37	186,100	(0.9)	22.1	4.90	156	62.7	203,000	142,900
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	22,114	1.62	14,850	(1.3)	5.6	1.10	18,947	34.8	54,232	14,300
STB	Sacombank	Tài chính	28,278	2.95	15,000	0.7	7.9	0.79	13,895	20.8	36,700	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	75,269	5.10	21,400	0.5	3.5	0.69	5,058	22.5	56,000	20,000
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	31,635	1.65	20,000	(0.7)	5.2	1.03	2,000	30.0	44,000	18,300
VCB	Vietcombank	Tài chính	331,276	3.81	70,000	0.1	14.0	1.40	1,172	23.6	96,000	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	189,415	5.93	43,500	(2.5)	6.7	1.56	2,427	23.0	87,500	41,500
VIC	VinGroup	Bất động sản	209,004	5.46	54,800	(2.3)	79.0	1.93	1,212	12.3	109,600	52,900
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	58,223	3.04	107,500	(0.5)	30.1	3.39	520	16.3	149,000	105,100
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	158,837	6.64	76,000	0.0	18.7	4.65	2,229	55.3	91,500	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	104,390	7.58	15,550	0.6	5.2	1.10	17,904	17.7	27,367	14,300
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	50,445	2.11	22,200	(3.5)	38.9	1.59	1,525	32.3	37,000	21,400

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.