

Nắm giữ vị thế bán

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 905 điểm. Áp lực bán đẩy Tài chính đi xuống, cụ thể là ACB (-5.91%), BID (-6.96%), MBB (-6.91%), STB (-4.73%), TCB (-6.76%), VPB (-6.69%), HCM (-6.95%), VND (-4.35%) và BVH (-6.93%).

Đồ thị VN30 Future: Vùng đáy cũ đã bị phá vỡ

Áp lực bán quay trở lại trên VN30F2211 và vùng đáy cũ đã bị phá vỡ. Mẫu hình đỉnh sau thấp hơn đỉnh trước và đáy sau thấp hơn đáy trước được xác nhận, điều này hàm ý rằng hợp đồng VN30F2211 khả năng cao sẽ kiểm định vùng 900 điểm. Các đường MA chủ đạo đã bị phá vỡ (Đồ thị giờ), điều này hàm ý rằng xu hướng giảm đã quay trở lại. Đà giảm sẽ hoàn toàn chứng 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 hợp đồng VN30F2211 khả năng cao sẽ tiếp tục giảm điểm. Trong trường hợp này, traders nên nắm giữ vị thế bán đến ngày đáo hạn.

Chiến lược đầu tư

Vị thế bán trên VN30F2211 quanh vùng 940 điểm nên được nắm giữ đến ngày đáo hạn và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên ngưỡng 980 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
VN30 Index	904.8	(3.4)				
VN30F2211	895.0	(4.0)	533,661	36,388	937	17/11/22
VN30F2212	887.0	(3.4)	12,016	17,281	941	15/12/22
VN30F2303	878.5	(3.6)	144	379	952	16/03/23
VN30F2306	880.4	(3.4)	1,167	270	964	15/06/23

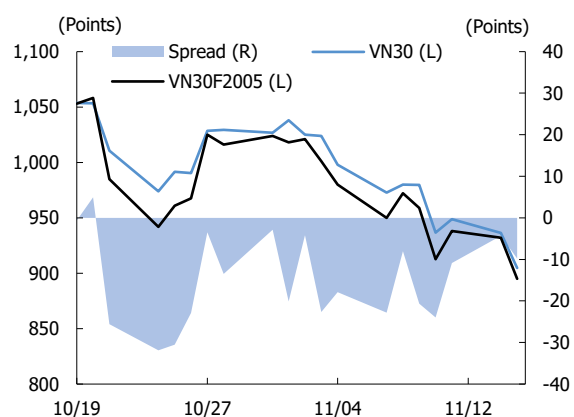
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

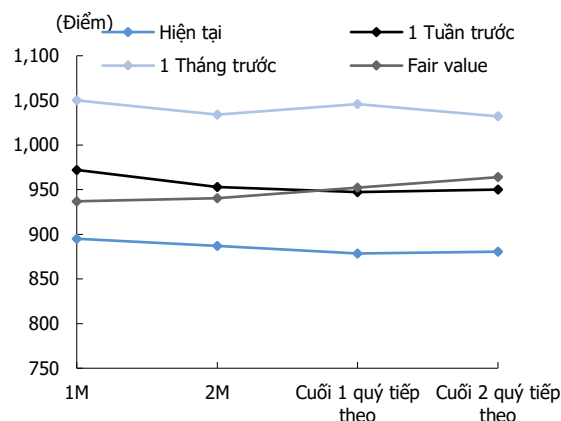
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

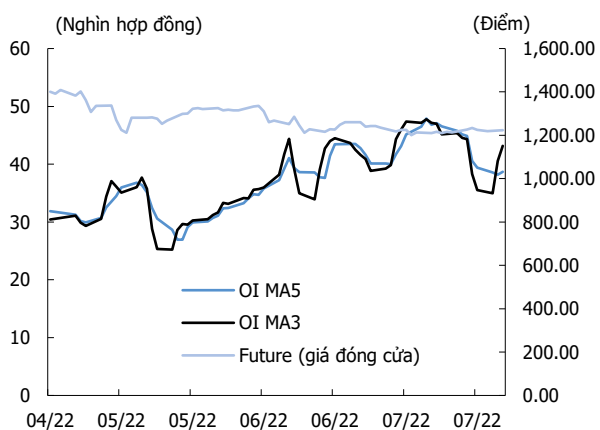
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Basis spread

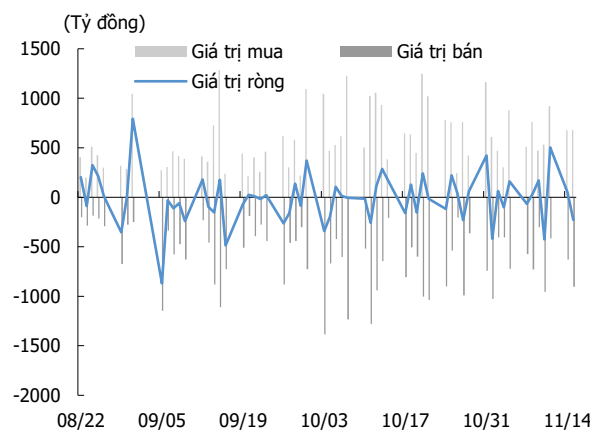
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	64,509	6.34	19,100	(5.9)	4.9	1.16	3,483	30.0	29,080	17,450
BID	BIDV	Tài chính	168,955	0.78	33,400	(7.0)	10.4	1.76	1,554	17.0	49,950	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	32,885	0.38	44,300	(6.9)	18.8	1.48	1,187	26.4	70,000	44,300
CTG	VietinBank	Tài chính	112,455	1.95	23,400	(2.1)	7.2	1.07	5,039	26.9	38,200	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	72,294	7.11	65,900	(6.9)	13.7	3.63	1,373	49.0	99,083	65,900
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	213,405	1.23	111,500	(2.0)	16.0	3.77	427	3.0	134,000	91,000
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	40,000	0.19	10,000	(7.0)	9.4	0.79	1,861	0.5	41,650	10,000
HDB	HDBank	Tài chính	35,214	2.85	14,000	(4.1)	4.7	1.00	2,633	17.8	27,160	13,350
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	72,685	4.62	12,500	2.5	4.7	0.74	28,921	18.7	42,000	11,850
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	13,907	1.05	19,400	(4.4)	10.9	1.22	2,029	32.5	52,273	18,700
MBB	MBBank	Tài chính	64,156	4.08	14,150	(6.9)	3.7	0.88	10,399	23.2	29,083	14,150
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	127,281	6.62	89,400	0.3	13.3	4.96	959	29.7	145,833	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	55,395	4.80	37,850	(6.9)	10.8	2.38	3,772	49.0	81,400	37,850
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	70,681	3.27	36,250	(6.9)	24.8	1.90	2,513	5.3	91,000	36,250
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	15,246	0.71	22,700	(7.0)	7.0	1.81	1,908	2.9	73,221	22,700
PLX	Petrolimex	Năng lượng	31,320	0.36	24,650	(7.0)	33.4	1.34	1,228	17.6	65,900	24,650
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	23,149	2.28	94,100	(2.6)	8.1	2.74	451	49.0	131,100	90,100
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	22,435	0.52	9,580	(7.0)	19.2	0.76	12,295	3.7	20,800	9,470
SAB	SABECO	TD thiết yếu	119,599	1.52	186,500	(4.4)	22.1	4.91	150	62.7	203,000	142,900
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	20,699	1.68	13,900	(2.5)	6.2	0.94	18,018	34.9	54,232	13,200
STB	Sacombank	Tài chính	28,467	3.29	15,100	(4.7)	6.9	0.77	16,468	20.5	36,700	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	72,807	5.46	20,700	(6.8)	3.4	0.67	5,603	22.5	56,000	20,000
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	31,477	2.00	19,900	1.0	5.2	1.03	2,310	30.0	44,000	18,300
VCB	Vietcombank	Tài chính	354,939	4.51	75,000	(0.1)	14.0	1.40	1,153	23.6	96,000	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	188,980	5.46	43,400	(1.4)	6.0	1.39	2,728	23.2	87,500	41,250
VIC	VinGroup	Bất động sản	217,394	6.28	57,000	3.6	79.0	1.92	1,292	12.2	109,600	49,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	55,136	3.19	101,800	(0.1)	30.1	3.15	441	16.4	149,000	96,100
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	160,927	7.44	77,000	(2.5)	20.4	5.17	2,240	55.7	89,600	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	98,348	7.39	14,650	(6.7)	4.9	1.04	17,655	17.7	27,367	14,300
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	56,694	2.62	24,950	(1.6)	27.4	1.74	1,518	32.6	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.