

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 4.0%, đóng cửa tại 1,175 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VPB (+6.9%), TCB (+6.7%), HPG (+3.9%), VIC (+1.7%), và VNM (+0.6%) đều đóng góp đáng kể cho đà tăng của chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán duy trì ở mức cao với giá trị bán ròng ở mức 115 tỷ đồng. Cụ thể, VNM, CTG, và STB chịu áp lực bán cao nhất trong khi VHM, HPG, và VRE thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Sự tiếp tục của xu hướng tăng

VN30F2102 phá vỡ ngưỡng 1,140 điểm, tăng khả năng kiểm định lại vùng đỉnh cũ (1,200 điểm). Cụ thể, đáy sau cao hơn đáy trước đã được xác nhận, điều này hàm ý cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Vùng 1,140 điểm trở thành vùng hỗ trợ trong phiên. Trên đồ thị ngày, hợp đồng này đóng cửa trên các đường MA chủ đạo, tín hiệu cho sự cải thiện của đà tăng và giai đoạn điều chỉnh đã kết thúc. Tuy nhiên, VN30F2102 sẽ khó tăng mạnh trong phiên hôm nay do MA5 đã vượt khá xa các đường MA chủ đạo. Trong trường hợp này, traders nên bảo toàn lợi nhuận trong phiên đáo hạn.

Chiến lược đầu tư

Đóng 50% vị thế mua tại vùng 1,140 điểm sau khi phiên ATO kết thúc. Với vị thế mua còn lại, traders nên tiếp tục nắm giữ và chỉ đóng vị thế tại giá ATC. Trong trường hợp ngưỡng 1,140 điểm bị phá vỡ, traders nên thoát mọi vị thế mua đang nắm giữ.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

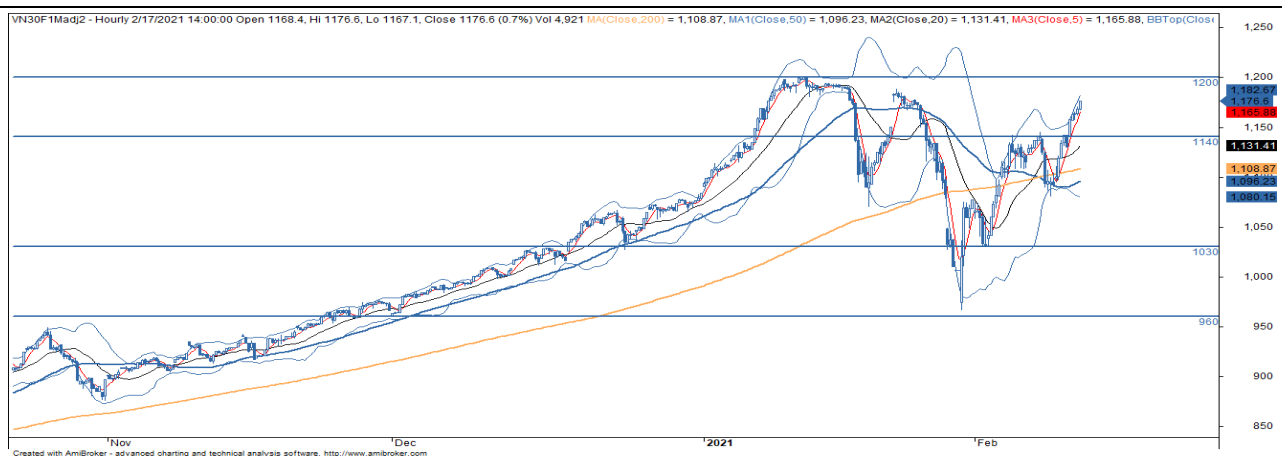
	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,174.9	4.0					
VN30F2102	1,176.6	7.7	117,320	20,440	1,130	18/02/21	3
VN30F2103	1,193.0	8.4	18,333	14,894	1,027	18/03/21	31
VN30F2106	1,196.0	8.0	79	348	1,028	17/06/21	122
VN30F2109	1,199.0	8.9	574	151	1,028	16/09/21	213

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

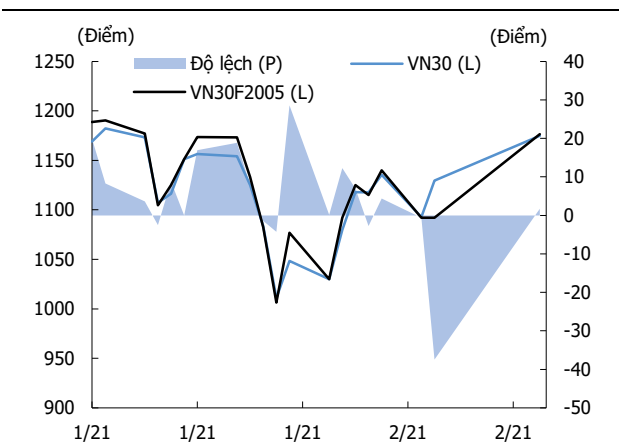
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



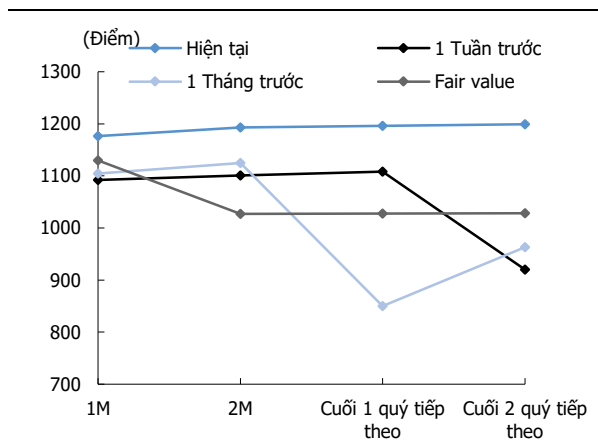
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



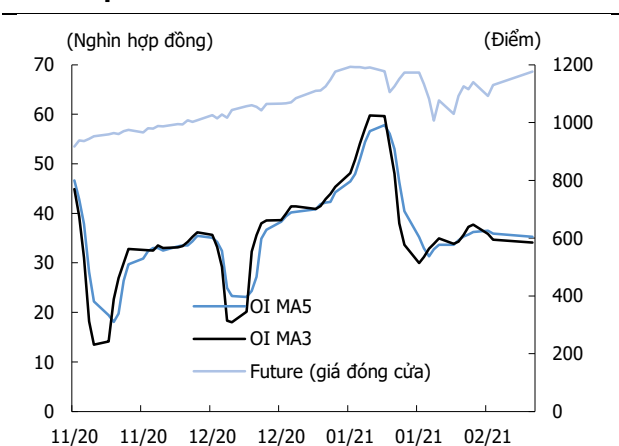
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



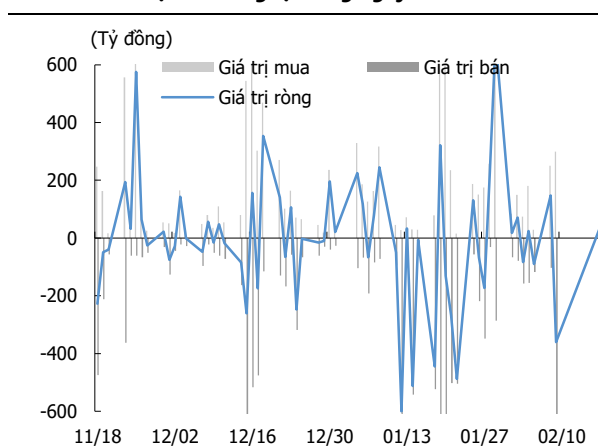
Nguồn: Bloomberg, KIS

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
BID	NHTMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Tài chính	169,327	0.71	42,100	3.2	23.7	2.21	2,254	17.3	52,600	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	45,950	0.48	61,900	3.3	29.7	2.30	1,109	27.9	71,200	32,300
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	137,021	2.17	36,800	4.0	10.0	1.62	9,397	28.7	40,100	16,600
FPT	CTCP FPT	CNTT	61,066	5.15	77,900	4.4	18.9	3.88	2,422	49.0	79,000	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	166,322	0.88	86,900	6.9	21.5	3.44	1,185	2.9	94,700	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	40,482	2.99	25,400	5.4	9.5	1.76	5,264	17.4	28,000	9,758
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	143,962	8.34	43,450	3.9	10.7	2.44	22,855	31.0	45,450	12,708
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	18,720	1.28	33,500	5.0	16.4	2.30	1,795	37.5	35,800	16,667
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	72,208	4.57	25,800	4.2	8.7	1.51	16,441	23.2	27,350	11,330
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	108,071	3.99	92,000	3.7	87.3	6.78	1,628	32.5	98,200	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	64,325	4.41	138,000	6.6	15.9	4.04	1,285	49.0	138,000	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	86,180	3.18	81,000	2.5	20.5	3.12	3,230	7.0	83,500	48,548
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	25,593	1.08	64,600	2.9	21.3	5.02	3,220	1.2	64,700	20,098
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	67,888	0.79	55,700	5.1	88.2	3.21	920	15.4	58,500	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	19,667	1.76	86,500	3.5	18.3	3.75	834	49.0	87,000	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	30,444	0.64	13,000	5.3	13.9	1.07	11,700	7.9	15,200	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	18,265	0.87	59,100	3.7	8.1	1.60	626	49.0	59,200	26,100
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	14,411	0.61	23,350	6.6	21.0	1.88	4,381	8.0	25,300	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	20,097	1.27	33,550	5.7	16.0	2.05	11,305	44.6	37,250	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	33,819	3.39	18,750	3.3	12.6	1.17	24,424	9.6	21,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	134,588	9.22	38,400	6.7	10.9	1.82	17,916	22.5	38,400	14,000
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,825	0.49	22,150	4.0	8.6	1.59	9,046	6.0	44,850	16,250
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	28,577	1.81	27,700	3.2	7.9	1.71	2,874	30.0	29,500	13,055
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	370,888	4.30	100,000	2.9	20.1	3.75	1,088	23.7	108,500	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	332,241	5.00	101,000	4.3	11.9	3.86	2,884	22.4	104,900	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	365,303	7.69	108,000	1.7	68.8	4.66	1,079	14.1	116,000	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	68,623	3.62	131,000	1.6	30.1	4.58	645	19.0	134,000	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	227,178	9.52	108,700	0.6	22.8	7.26	2,570	57.9	117,200	69,750
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	101,013	7.98	41,150	6.9	9.6	1.91	6,724	23.4	41,150	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	76,691	1.85	33,750	7.0	32.2	2.62	7,102	31.2	38,300	16,900

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 © 2021 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.