

Độ nhiễu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.5%, đóng cửa tại 1,379 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, HPG (+2.4%), VPB (+2.1%), và TCB (+1.0%) đóng góp tích cực cho chỉ số trong khi VNM (-0.2%) và VIC (-2.4%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 650 tỷ đồng. Cụ thể, VPB, VNM, và VIC chịu áp lực bán cao nhất trong khi STB, HDB, và PNJ thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Tích lũy/điều chỉnh trong phiên

VN30F2105 tiếp tục tích lũy trong phiên giao dịch trước với sự gia tăng của độ biến động. Tuy nhiên, xu hướng tăng vẫn duy trì khi MA20 và MA50 duy trì chuyển động hướng lên (Đồ thị ngày). Bên cạnh đó, Bollinger bands đã co thắt, xác nhận cho giai đoạn tích lũy ngắn hạn. Đáng chú ý, khối lượng giao dịch thấp hơn mức trung bình, điều này hàm ý cho sự thận trọng trong ngắn hạn. Vùng 1,320 điểm và 1,360 điểm lần lượt là vùng hỗ trợ ngắn hạn và trong phiên. Trong trường hợp này, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy sau giai đoạn tích lũy.

Chiến lược đầu tư

Với vị thế mua mới, traders nên chờ tín hiệu tin cậy sau khi giai đoạn tích lũy kết thúc.

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	1,378.6	0.5					
VN30F2105	1,375.0	0.6	211,694	22,522	1,371	20/05/21	4
VN30F2106	1,368.0	0.6	3,581	4,011	1,372	17/06/21	32
VN30F2109	1,359.9	0.3	123	276	1,373	16/09/21	123
VN30F2112	1,359.9	0.3	120	150	1,374	16/12/21	214

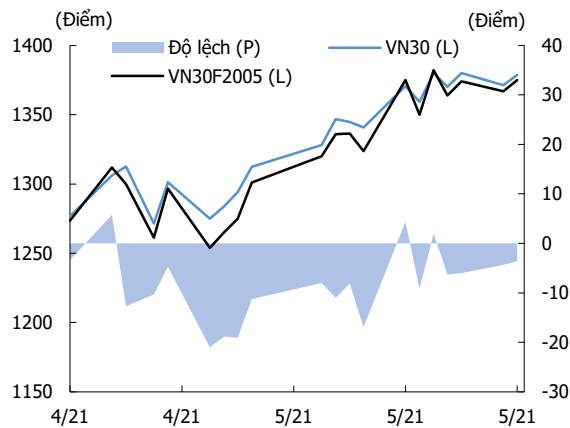
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

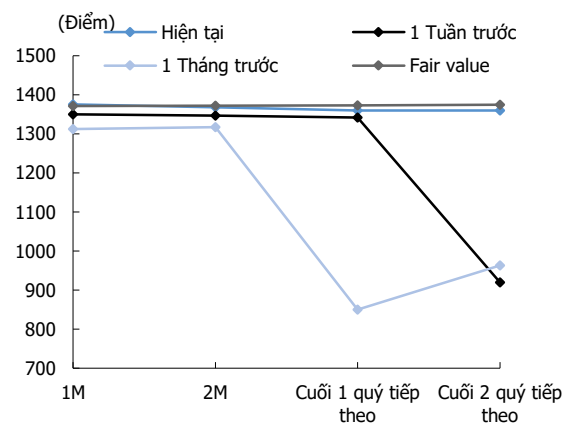
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

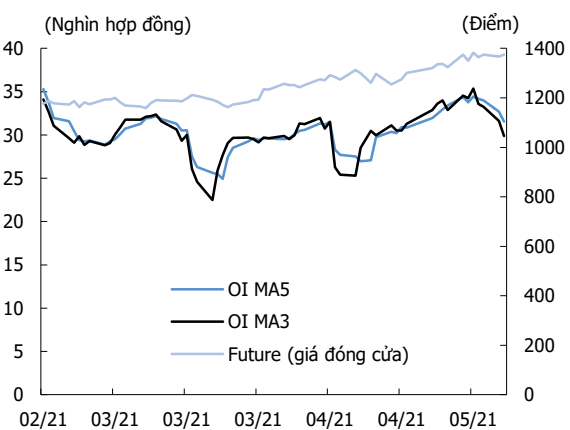
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

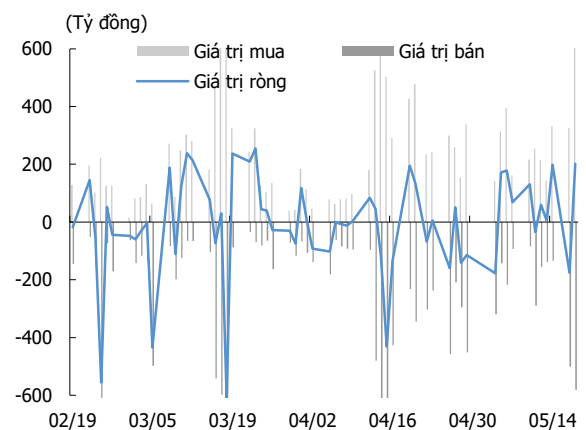
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	164,501	0.59	40,900	(2.2)	20.0	2.08	2,893	16.7	50,600	35,550
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	40,085	0.36	54,000	(1.1)	21.2	1.96	894	27.4	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	173,324	3.08	46,550	(0.4)	9.8	1.90	14,546	25.7	47,600	20,400
FPT	CTCP FPT	CNTT	68,653	4.85	87,000	1.5	18.4	4.10	2,298	49.0	87,400	43,600
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	156,944	0.70	82,000	(0.6)	20.8	3.11	916	2.5	96,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	48,769	3.04	30,600	(1.8)	9.9	1.98	5,332	17.3	31,900	13,667
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	210,062	10.28	63,400	2.4	11.6	3.18	22,329	29.7	63,700	20,000
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	20,117	1.07	36,000	(1.4)	16.8	2.41	2,838	31.7	38,000	20,238
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	93,199	4.97	33,300	1.2	9.2	1.81	18,938	23.0	33,800	13,226
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	123,459	3.84	105,100	0.9	82.0	7.63	2,047	32.8	111,500	48,900
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	67,369	3.89	141,700	0.1	15.7	3.90	924	49.0	148,000	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	153,282	4.71	141,700	3.0	33.8	4.82	2,439	7.5	142,000	51,020
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	34,123	1.21	70,100	(0.1)	26.0	6.41	4,028	2.8	74,200	17,038
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	67,166	0.78	54,000	0.0	18.5	2.86	2,135	15.8	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,259	1.51	93,500	(0.5)	18.8	3.70	518	49.0	98,000	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	28,102	0.50	12,000	(1.2)	11.6	0.97	14,711	3.4	15,200	8,660
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	17,152	0.69	55,500	0.5	8.1	1.45	731	49.0	59,600	29,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	12,281	0.38	19,900	1.5	17.6	1.55	3,573	8.6	25,300	13,000
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	22,767	1.21	35,250	(0.6)	12.7	2.00	12,659	45.9	37,250	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	49,240	4.16	27,300	5.2	18.3	1.66	35,316	11.9	27,400	9,680
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	169,462	9.80	48,350	1.0	11.9	2.16	13,594	22.5	49,850	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	8,313	0.41	22,200	(3.1)	8.7	1.53	6,160	10.8	27,400	17,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	33,116	1.77	32,100	(1.5)	8.4	1.84	5,121	30.0	32,900	15,796
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	350,860	3.43	94,600	(1.5)	16.6	3.48	1,657	23.4	108,500	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	325,333	4.36	98,900	(1.9)	12.6	3.57	3,624	22.5	112,400	70,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	409,274	6.59	121,000	(2.4)	55.6	5.08	1,996	14.6	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	61,202	2.72	113,000	(0.9)	30.1	4.05	562	18.9	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	181,826	8.09	87,000	(0.2)	18.6	5.80	3,784	55.0	117,200	86,100
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	164,959	9.54	67,200	2.1	14.5	2.95	11,267	22.1	67,400	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	68,170	1.46	30,000	(2.3)	25.5	2.27	5,867	29.8	38,300	24,050

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.