

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 1.7%, đóng cửa tại 1,402 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, HPG (+4.3%), TCB (+3.6%), VNM (+0.6%), và VPB (+0.4%) đóng góp tích cực cho chỉ số trong khi VIC (-0.7%) có diễn biến kém tích cực hơn so với chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 260 tỷ đồng. Cụ thể, VPB, VNM, và NVL chịu áp lực bán cao nhất trong khi CTG, MSN, và VHM thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Sóng tăng tiếp theo

VN30F2105 tăng mạnh trong phiên giao dịch trước, xác nhận cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Cụ thể, hợp đồng này đóng cửa trên các đường MA chủ đạo và Bollinger bands đã mở rộng, sóng tăng kế tiếp được xác nhận. Vùng 1,320 điểm và 1,370 điểm lần lượt là vùng hỗ trợ ngắn hạn và trong phiên. Mặc dù sự tiếp tục của xu hướng tăng đã được xác nhận nhưng hợp đồng này sẽ đáo hạn vào hôm nay. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ điểm mua mới từ hợp đồng kế tiếp (VN30F2106).

Chiến lược đầu tư

VN30F2105 sẽ đáo hạn vào hôm nay và biến động không mong muốn có thể xảy ra. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ điểm mua mới từ hợp đồng kế tiếp (VN30F2106).

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	1,401.7	1.7					
VN30F2105	1,404.9	2.2	181,035	23,482	1,379	20/05/21	3
VN30F2106	1,393.0	1.8	9,362	7,128	1,379	17/06/21	31
VN30F2109	1,386.0	1.8	135	288	1,380	16/09/21	122
VN30F2112	1,380.1	1.5	93	128	1,381	16/12/21	213

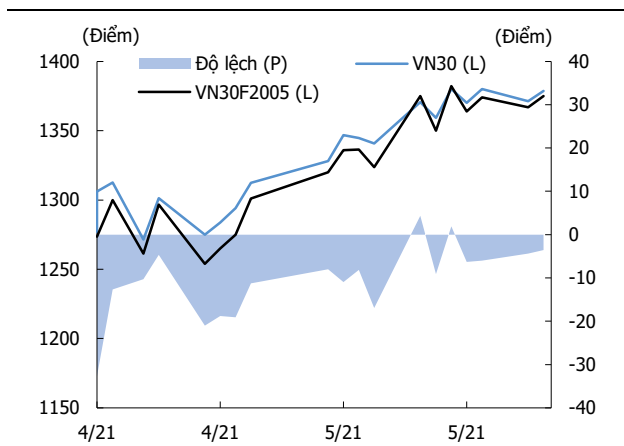
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

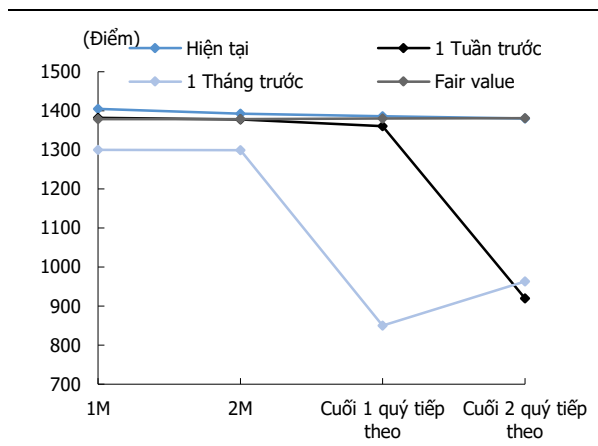
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

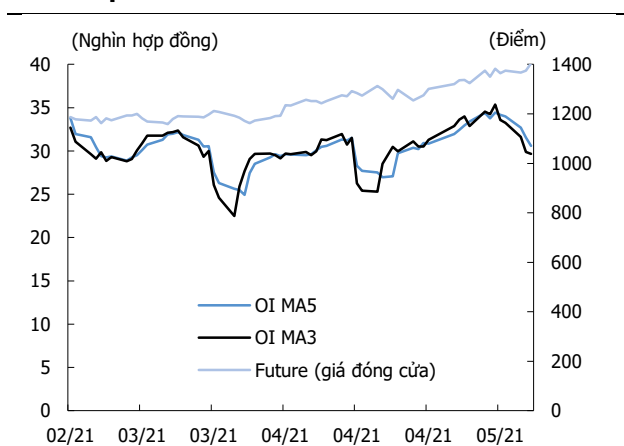
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

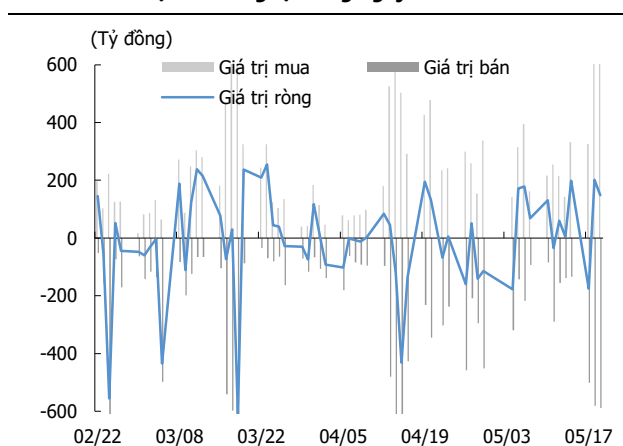
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	164,501	0.58	40,900	0.0	20.0	2.08	2,933	16.7	50,600	35,550
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	39,492	0.35	53,200	(1.5)	20.9	1.93	891	27.4	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	178,723	3.13	48,000	3.1	10.1	1.96	14,674	25.7	48,250	20,400
FPT	CTCP FPT	CNTT	71,652	5.01	90,800	4.4	19.2	4.28	2,281	49.0	91,100	43,600
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	156,178	0.68	81,600	(0.5)	20.7	3.09	902	2.5	96,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	50,124	3.07	31,450	2.8	10.2	2.04	5,382	17.3	31,900	13,879
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	219,008	10.53	66,100	4.3	12.1	3.32	22,573	29.5	66,700	20,417
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	20,005	1.05	35,800	(0.6)	16.7	2.40	2,891	31.7	38,000	20,238
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	96,557	5.07	34,500	3.6	9.6	1.88	19,012	23.0	34,500	13,226
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	126,866	3.88	108,000	2.8	84.3	7.84	2,077	32.8	111,500	48,900
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	67,369	3.83	141,700	0.0	15.7	3.90	899	49.0	148,000	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	153,607	4.66	142,000	0.2	33.9	4.83	2,436	7.8	144,800	51,415
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	34,171	1.20	70,200	0.1	26.0	6.42	3,992	3.1	74,200	17,038
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	67,415	0.77	54,200	0.4	18.6	2.87	2,154	15.7	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,259	1.49	93,500	0.0	18.8	3.70	509	49.0	98,000	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	27,400	0.48	11,700	(2.5)	11.3	0.95	14,711	3.3	15,200	8,660
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	16,998	0.67	55,000	(0.9)	8.1	1.43	708	49.0	59,600	29,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	12,127	0.37	19,650	(1.3)	17.4	1.53	3,517	8.6	25,300	13,000
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	23,251	1.22	36,000	2.1	13.0	2.04	12,664	45.9	37,250	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	51,404	4.27	28,500	4.4	19.1	1.73	35,705	11.9	28,700	9,860
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	175,596	9.98	50,100	3.6	12.3	2.24	13,525	22.5	50,200	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	8,181	0.39	21,850	(1.6)	8.5	1.51	6,141	10.7	27,400	17,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	33,941	1.78	32,900	2.5	8.6	1.89	5,202	30.0	32,900	15,796
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	349,005	3.36	94,100	(0.5)	16.5	3.46	1,675	23.3	108,500	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	330,267	4.36	100,400	1.5	12.8	3.63	3,620	22.5	112,400	70,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	406,230	6.43	120,100	(0.7)	55.2	5.04	2,016	14.5	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	59,577	2.60	110,000	(2.7)	30.1	3.94	558	18.9	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	182,871	7.99	87,500	0.6	18.7	5.84	3,786	55.0	117,200	86,100
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	165,696	9.42	67,500	0.4	14.6	2.96	11,656	22.1	67,500	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	66,693	1.41	29,350	(2.2)	25.0	2.22	5,886	29.7	38,300	24,600

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.