

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.5%, đóng cửa tại 1,483 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, HPG (+5.3%), VIC (+2.1%), và VPB (+0.1%) đóng góp tích cực cho chỉ số trong khi VNM (-0.7%) và TCB (-1.1%) có diễn biến kém tích cực hơn so với chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng cao. Giá trị bán ròng ở mức 600 tỷ đồng. Cụ thể, HPG, STB, và VCB chịu áp lực bán cao nhất trong khi TPB, VHM, và VRE thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Sự thận trọng quanh vùng 1,500 điểm

VN30F2106 tiếp tục tăng trong phiên giao dịch trước, nhưng đà tăng đã dần suy yếu khi tâm lý thận trọng xuất hiện quanh vùng 1,500 điểm. Vùng 1,450 điểm trở thành vùng hỗ trợ trong tuần này trong khi ngưỡng 1,500 điểm sẽ là ngưỡng kháng cự trong thời gian tới. Xu hướng tăng vẫn duy trì khi các đường MA chủ đạo duy trì chuyển động hướng lên. Tuy nhiên, mẫu nền thân hẹp xuất hiện trên đồ thị ngày, điều này hàm ý cho sự gia tăng của độ biến động. Đáng chú ý, độ biến động gia tăng thường là tín hiệu đầu tiên cho giai đoạn điều chỉnh trong phiên. Trong trường hợp này, traders nên đóng vị thế mua sau phiên ATO.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua quanh vùng 1,450-1,460 điểm (VN30F2106) nên được đóng ½ vị thế sau phiên ATO. Với vị thế mua còn lại, traders nên đóng mọi vị thế khi xuất hiện giá đóng cửa dưới 1,450 điểm.

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	1,482.9	0.6					
VN30F2106	1,487.6	0.5	165,827	26,789	1,286	17/06/21	18
VN30F2107	1,481.1	0.5	360	241	1,146	15/07/21	46
VN30F2109	1,479.0	0.5	78	269	1,147	16/09/21	109
VN30F2112	1,473.6	0.6	55	90	1,148	16/12/21	200

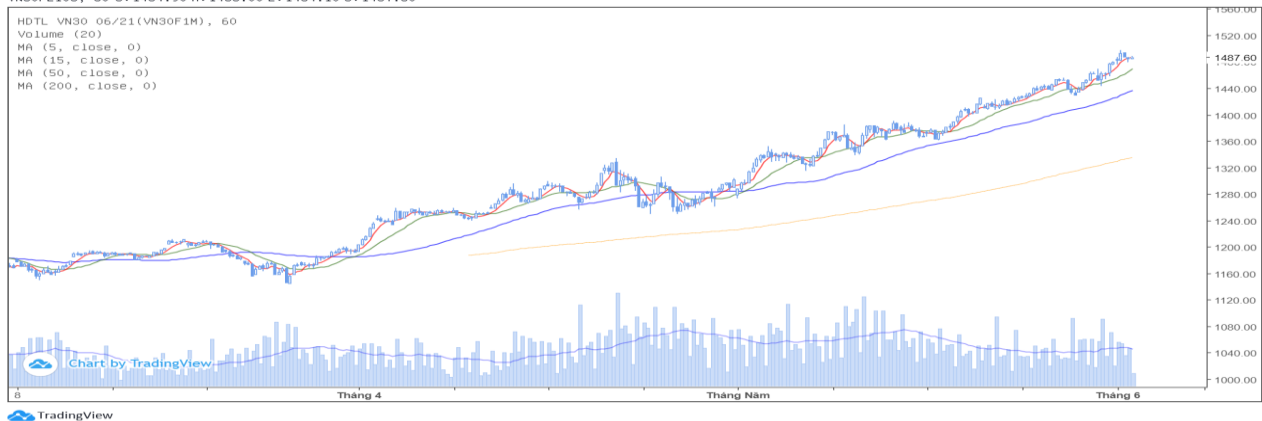
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

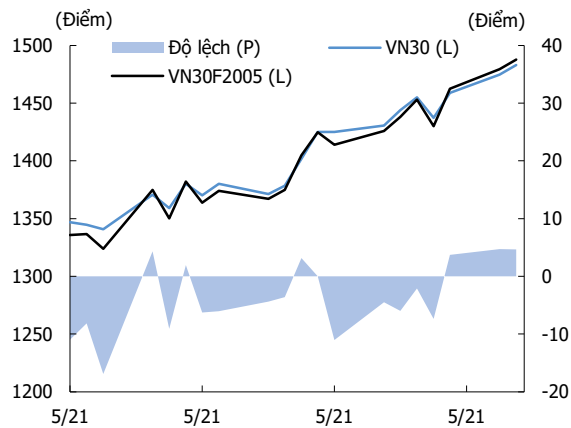
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, June 01, 2021 18:01:16 +07
VN30F2106, 60 O:1484.90 H:1488.00 L:1484.10 C:1487.60



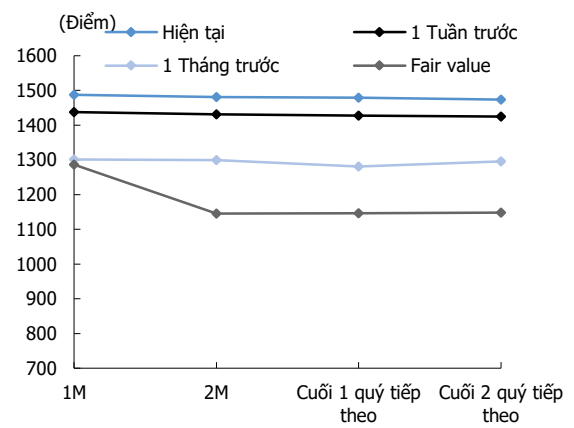
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



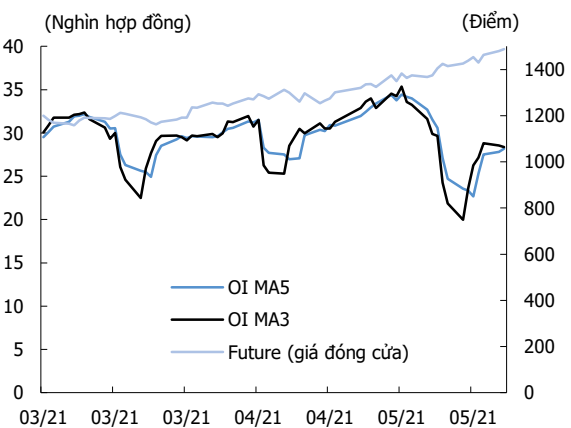
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



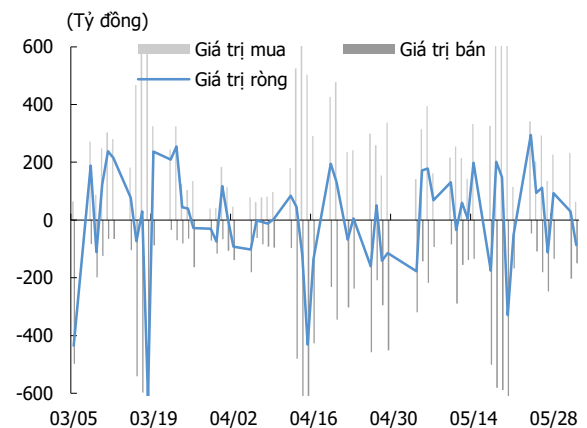
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	193,057	0.64	48,000	(1.4)	23.4	2.44	3,590	16.7	50,600	35,550
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	39,789	0.33	53,600	(0.9)	21.0	1.94	901	27.4	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	195,851	3.24	52,600	(0.9)	11.0	2.15	15,532	25.3	53,900	20,400
FPT	CTCP FPT	CNTT	79,042	4.54	87,100	3.4	21.2	4.72	2,641	49.0	88,500	37,913
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	160,198	0.66	83,700	1.3	21.2	3.17	812	2.4	96,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	54,666	3.16	34,300	1.5	11.1	2.22	5,650	17.3	35,000	13,879
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	248,248	11.28	55,500	5.3	13.7	3.76	30,810	28.9	56,300	15,123
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	22,101	1.10	39,550	0.3	18.5	2.65	3,240	30.6	40,200	20,905
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	106,913	5.30	38,200	0.5	10.6	2.08	19,419	22.8	38,850	13,226
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	125,691	3.64	107,000	(2.8)	83.5	7.77	2,116	32.9	115,500	48,900
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	64,896	3.49	136,500	(1.4)	15.1	3.75	870	49.0	150,000	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	146,900	4.22	135,800	0.9	32.4	4.62	2,379	7.8	144,800	52,602
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	36,897	1.22	75,800	(1.6)	28.1	6.93	3,900	2.8	78,000	17,038
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	68,037	0.73	54,700	0.2	18.8	2.90	2,390	16.1	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	22,850	1.51	100,500	(0.4)	20.2	3.97	497	49.0	104,900	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	28,337	0.47	12,100	3.0	11.7	0.98	14,798	3.2	15,200	8,660
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	17,616	0.66	57,000	(2.1)	8.1	1.48	698	49.0	61,000	29,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	12,096	0.35	19,600	(1.5)	17.3	1.53	3,294	8.5	25,300	13,000
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	28,224	1.40	43,700	(1.6)	15.7	2.48	13,138	46.4	45,300	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	58,438	4.59	32,400	(4.1)	21.7	1.97	38,429	11.8	33,900	9,900
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	186,111	10.00	53,100	(1.1)	13.0	2.37	13,550	22.5	54,300	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	8,510	0.37	21,850	(2.0)	8.5	1.51	6,132	10.7	27,400	17,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	40,509	1.93	37,800	0.9	9.9	2.17	5,715	30.0	38,600	15,796
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	384,611	3.50	103,700	5.2	18.2	3.81	1,775	23.3	108,500	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	342,109	4.26	104,000	1.4	13.2	3.76	3,778	22.6	112,400	70,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	405,892	6.07	120,000	2.1	55.2	5.03	2,082	14.3	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	57,519	2.38	106,200	(3.5)	30.1	3.80	524	18.6	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	187,887	7.76	89,900	(0.7)	19.2	6.00	3,797	54.9	117,200	86,100
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	170,114	9.14	69,300	0.1	15.0	3.04	15,952	15.4	70,200	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	69,760	1.39	30,700	4.4	26.1	2.32	6,143	29.7	38,300	24,800

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.