

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 0.3%, đóng cửa tại 1,462 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VIC (-1.8%), VPB (-1.2%), TCB (-1.0%), VNM (-0.9%), và HPG (-0.8%) đều tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng. Giá trị bán ròng ở mức 38 tỷ đồng. Cụ thể, MBB, HPG, và CTG chịu áp lực bán cao nhất trong khi VCB, VNM, và VRE thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Volatility level is increasing

VN30F2107 tích lũy trong phiên trước, xu hướng tăng đã chứng lại trong ngắn hạn và độ biến động đang gia tăng. Hợp đồng này đã nhận được lực cầu quanh vùng hỗ trợ trong phiên. Cụ thể, vùng 1,400 điểm sẽ là vùng hỗ trợ quan trọng trong ngắn hạn trong khi vùng 1,500 điểm sẽ là vùng kháng cự quan trọng trong phiên. Ngưỡng hỗ trợ quan trọng trong phiên là ngưỡng 1,450 điểm. Đáng chú ý, xu hướng giảm ngắn hạn vẫn chưa được xác nhận bởi hệ thống hai đường MA. Đà giảm sẽ không thể kéo dài. Vị thế bán mới sẽ không có tỷ lệ risk/reward phù hợp và tín hiệu cho vị thế mua vẫn chưa xuất hiện.

Chiến lược đầu tư

Traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu mua tin cậy quanh vùng có lực cầu cao (tại các ngưỡng hỗ trợ quan trọng).

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	1,461.9	(0.3)					
VN30F2106	1,463.9	(0.3)	178,333	-	1,466	17/06/21	0
VN30F2107	1,467.0	(0.2)	24,373	14,245	1,254	15/07/21	28
VN30F2109	1,464.9	(0.1)	107	299	1,255	16/09/21	91
VN30F2112	1,463.5	0.0	61	210	1,256	16/12/21	182

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

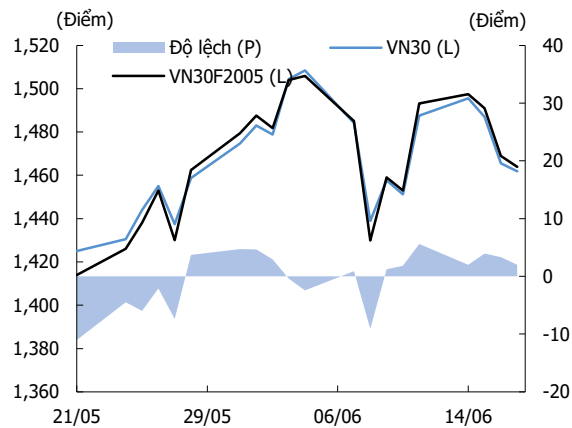
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



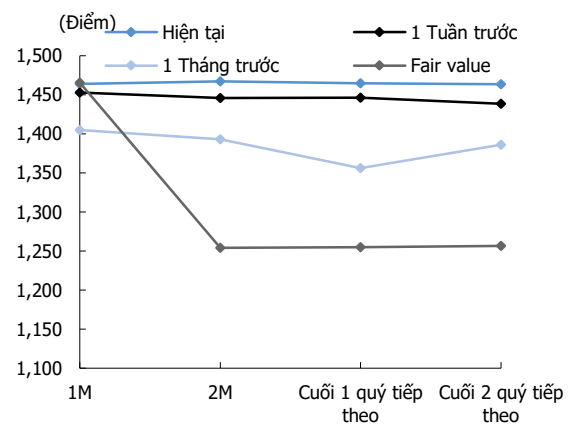
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



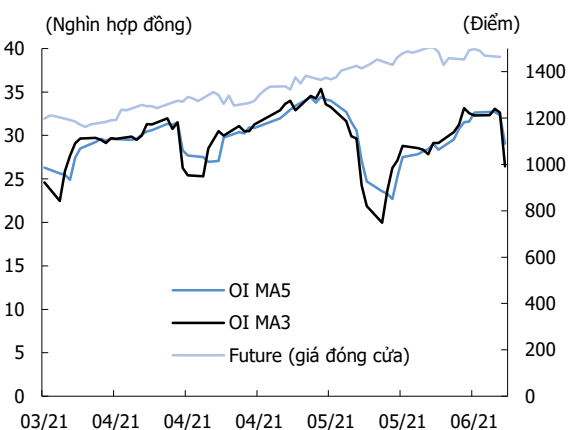
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



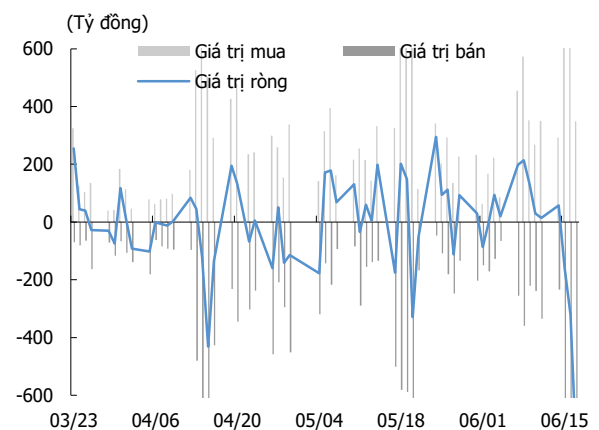
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	184,611	0.62	45,900	1.3	22.4	2.34	4,111	16.6	50,600	35,550
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	46,024	0.39	62,000	2.8	24.3	2.25	1,064	27.2	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	188,032	3.15	50,500	0.0	10.6	2.06	16,612	25.3	54,900	20,400
FPT	CTCP FPT	CNTT	74,957	5.03	82,600	(0.6)	20.1	4.48	2,751	49.0	88,500	37,913
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	179,720	0.75	93,900	2.2	23.8	3.56	872	2.5	96,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	53,551	3.14	33,600	(0.6)	10.9	2.18	5,965	17.4	36,200	13,879
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	229,908	10.60	51,400	(0.8)	12.7	3.48	32,120	26.1	56,300	15,667
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	22,682	1.14	36,900	0.0	19.0	2.72	3,912	31.7	37,300	19,697
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	111,670	5.61	39,900	3.1	11.0	2.17	20,750	21.7	42,700	13,226
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	121,595	3.55	103,000	(1.2)	80.4	7.48	2,180	32.9	115,500	48,900
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	66,085	3.60	139,000	1.5	15.4	3.82	845	49.0	150,000	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	149,995	4.40	102,200	(1.3)	33.1	4.71	3,079	8.1	107,200	40,081
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	44,637	1.50	91,700	(0.3)	34.0	8.38	4,063	3.2	92,900	17,038
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	70,524	0.77	56,700	1.3	19.5	3.01	2,583	17.3	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,714	1.46	95,500	0.4	19.2	3.77	507	49.0	104,900	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	29,039	0.49	12,400	2.9	12.0	1.01	14,035	3.1	15,200	8,660
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	18,543	0.70	60,000	5.4	8.1	1.56	680	49.0	61,000	30,400
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	13,917	0.41	22,550	6.9	19.9	1.76	3,050	8.8	25,300	13,000
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	32,995	1.64	50,500	2.2	18.2	2.87	14,330	47.7	53,600	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	53,027	4.22	29,400	0.7	19.7	1.78	40,822	11.6	33,900	9,900
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	175,946	9.58	50,200	(1.0)	12.3	2.24	15,216	22.5	55,200	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	8,862	0.38	22,200	(1.3)	8.7	1.53	6,373	14.6	27,400	17,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	37,937	1.84	35,400	(0.6)	9.3	2.03	5,565	30.0	40,900	15,878
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	386,465	3.56	104,200	0.2	18.3	3.83	2,035	23.3	108,500	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	358,557	4.53	109,000	(0.9)	13.8	3.94	4,162	22.6	113,100	70,900
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	395,744	6.00	117,000	(1.8)	53.8	4.91	2,278	14.1	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	63,098	2.64	116,500	0.0	30.1	4.17	530	18.3	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	190,186	7.97	91,000	(0.9)	19.4	6.07	3,964	54.8	117,200	86,100
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	162,013	8.82	66,000	(1.2)	14.3	2.89	23,280	15.4	72,200	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	74,646	1.51	32,850	0.2	27.9	2.48	6,622	30.5	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.