

Vùng biến động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,407.5 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, TCB (+1.5%), HPG (+1.1%) và MBB (+0.7%) ảnh hưởng tích cực đến chỉ số trong khi TCB (-0.1%), VNM (-0.7%), và VPB (-1.2%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua chiếm ưu thế. Giá trị mua ròng ở mức 74 tỷ đồng. Cụ thể, KDH, VHM, và VRE chịu áp lực bán cao nhất trong khi HPG, MBB, và HDB thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Breakdown có xác suất cao

Đáy sau cao hơn đáy trước đã xuất hiện trên VN30F2108, nhưng sự tiếp tục của xu hướng tăng vẫn chưa được xác nhận. Cụ thể, xu hướng giảm ngắn hạn đã hình thành khi MA20 di chuyển hướng xuống (Đồ thị ngày). Vùng 1,400 điểm sẽ là vùng hỗ trợ quan trọng trong ngắn hạn, tiếp đến là vùng 1,350 điểm trong khi 1,450 điểm sẽ là vùng kháng cự quan trọng cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Đáng chú ý, các đường MA chủ đạo đã dần hướng ngang, tín hiệu cho giai đoạn tích lũy trong phiên. Trong trường hợp này, do xu hướng giảm đã được xác nhận trên đồ thị ngày nên breakdown có xác suất xuất hiện cao hơn so với breakout.

Chiến lược đầu tư

Bán VN30F2108 khi ngưỡng 1,400 điểm bị phá vỡ và chỉ dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên 1,410 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	1,407.5	(0.2)					
VN30F2108	1,407.8	0.2	314,607	37,765	1,410	19/08/2021	24
VN30F2109	1,407.0	0.1	352	383	1,411	16/09/2021	52
VN30F2112	1,408.8	(0.4)	27	347	1,377	16/12/2021	143
VN30F2203	1,406.0	(0.4)	38	55	1,378	17/03/2022	234

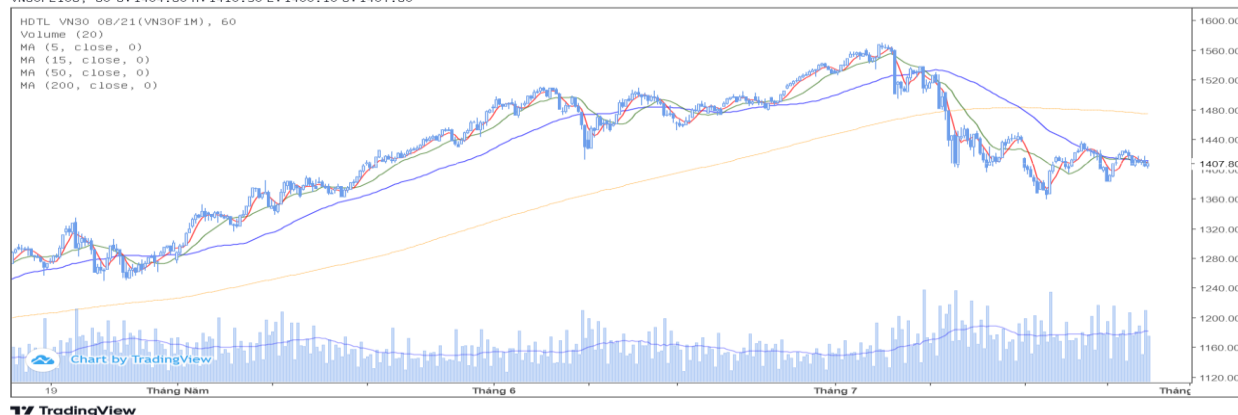
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

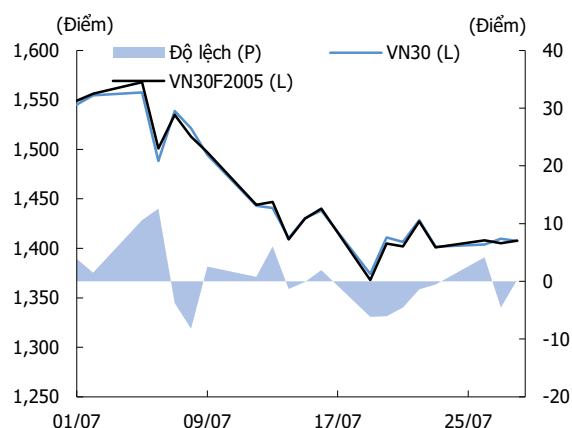
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, July 28, 2021 21:12:22 +07
VN30F2108, 60 O: 1404.30 H: 1410.50 L: 1400.10 C: 1407.80



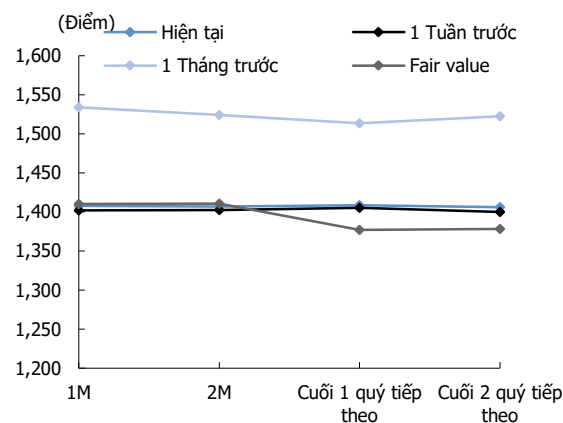
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



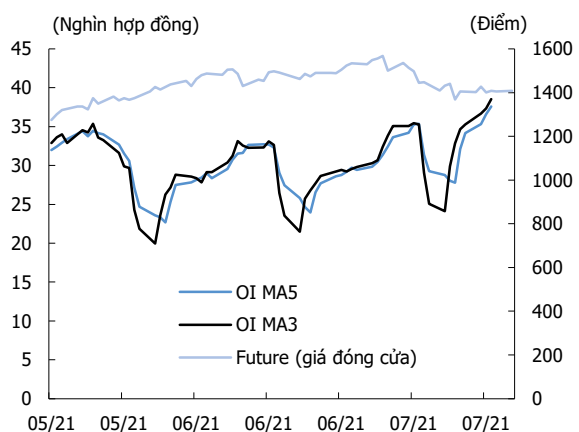
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



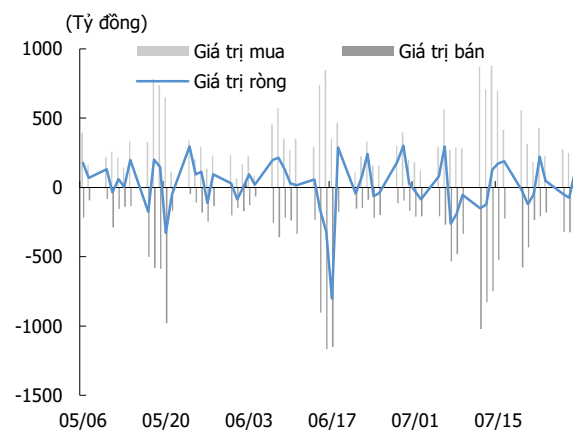
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	162,892	0.57	40,500	0.7	19.8	2.06	3,922	16.7	50,600	35,800
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	37,265	0.32	50,200	(0.6)	19.7	1.82	1,114	26.9	71,200	39,200
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	158,109	2.75	32,900	1.2	8.9	1.73	21,730	24.5	42,535	15,805
FPT	CTCP FPT	CNTT	83,487	5.81	92,000	(1.3)	21.7	4.97	2,964	49.0	95,000	38,087
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	170,533	0.74	89,100	0.1	21.9	3.65	932	2.8	98,000	63,300
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	52,435	3.19	32,900	1.2	10.6	2.13	5,558	17.9	37,900	13,879
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	208,885	9.99	46,700	1.1	11.5	3.16	32,938	26.7	56,300	15,667
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	24,145	1.26	38,750	(1.3)	19.9	2.86	4,193	31.6	40,500	19,697
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	104,282	5.44	27,600	0.7	10.0	1.96	29,540	21.8	32,926	9,797
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	146,977	4.47	124,500	(0.8)	97.2	9.04	1,830	33.3	126,500	49,000
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	74,671	4.22	157,100	(0.6)	17.4	4.32	920	49.0	179,900	71,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	153,402	4.65	104,100	(2.3)	33.7	4.80	2,950	9.7	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	44,248	1.54	90,900	1.2	31.3	7.93	3,979	3.8	97,500	18,027
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	62,813	0.71	50,500	0.4	17.3	2.68	2,748	17.3	59,600	41,000
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	20,486	1.43	90,100	0.0	15.5	3.58	552	49.0	109,100	49,800
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	24,824	0.43	10,600	(1.9)	10.2	0.86	10,935	3.0	15,200	8,810
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	16,194	0.63	52,400	(0.8)	8.1	1.36	676	49.0	61,000	31,600
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	11,263	0.34	18,250	(0.3)	16.1	1.42	3,284	8.9	25,300	13,100
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	34,318	1.79	52,400	0.8	18.6	2.97	14,415	48.4	59,000	13,250
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	52,126	4.31	28,900	(0.7)	19.3	1.75	36,796	14.3	33,900	9,900
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	174,194	9.85	49,700	(0.1)	10.8	2.09	20,470	22.5	58,600	17,500
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,644	0.36	19,150	1.9	7.5	1.32	5,447	13.2	27,400	17,600
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	36,651	1.84	34,200	0.3	8.1	1.81	5,715	30.0	40,900	15,960
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	359,761	3.44	97,000	2.1	17.0	3.56	2,045	23.6	117,200	75,100
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	350,333	4.60	106,500	(1.2)	13.5	3.85	4,190	23.2	120,400	71,200
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	355,832	5.60	105,200	0.9	48.4	4.41	2,074	15.3	145,900	79,900
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	61,960	2.69	114,400	(0.4)	30.1	4.10	568	18.3	138,500	94,300
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	181,617	7.90	86,900	(0.7)	18.6	5.80	3,694	55.2	117,200	84,000
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	138,202	7.81	56,300	(1.2)	11.1	2.30	28,388	15.4	73,300	19,400
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	61,807	1.30	27,200	(1.6)	23.1	2.05	5,675	30.6	38,300	25,050

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.