

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,494 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VNM (+1.9%) có diễn biến tích cực hơn so với chỉ số trong khi TCB (-0.4%), HPG (-0.6%), VPB (-0.8%), và MBB (-0.8%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng mạnh. Giá trị bán ròng ở mức 320 tỷ đồng, tập trung chủ yếu trên HPG, SSI, và VIC.

Đồ thị VN30 Future: Volatility increases

Độ biến động gia tăng trên VN30F2108 và nhịp điều chỉnh cần xuất hiện để củng cố xu hướng. Cụ thể, hợp đồng này đóng cửa tiếp tục đóng cửa trên các đường MA chủ đạo và các đường MA này đang di chuyển hướng lên, xu hướng tăng đã được xác nhận. Vùng 1,450 điểm sẽ là vùng hỗ trợ quan trọng trong ngắn hạn và vùng 1,475 điểm sẽ là vùng hỗ trợ trong phiên. Tuy nhiên, trên đồ thị ngày, các đường MA chủ đạo đang dần hướng ngang, tín hiệu đầu tiên cho giai đoạn tích lũy. Trong trường hợp này, VN30F2108 được kì vọng bước vào giai đoạn tích lũy hoặc pullback và điểm mua thích hợp sẽ xuất hiện. Vùng 1,450 điểm là vùng mua cần lưu ý. Traders cần chờ nhịp pullback để có vị thế mua mới với tỉ lệ risk/reward phù hợp.

Chiến lược đầu tư

Mua VN30F2108 tại vùng 1,450 điểm, mục tiêu tại 1,500 điểm và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,415 điểm (Đồ thị giờ).

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	1,494.4	(0.2)					
VN30F2108	1,494.1	(0.4)	273,956	36,176	1,498	19/08/2021	11
VN30F2109	1,492.1	(0.5)	549	980	1,498	16/09/2021	39
VN30F2112	1,491.5	0.0	53	201	1,468	16/12/2021	130
VN30F2203	1,494.7	(0.3)	33	261	1,470	17/03/2022	221

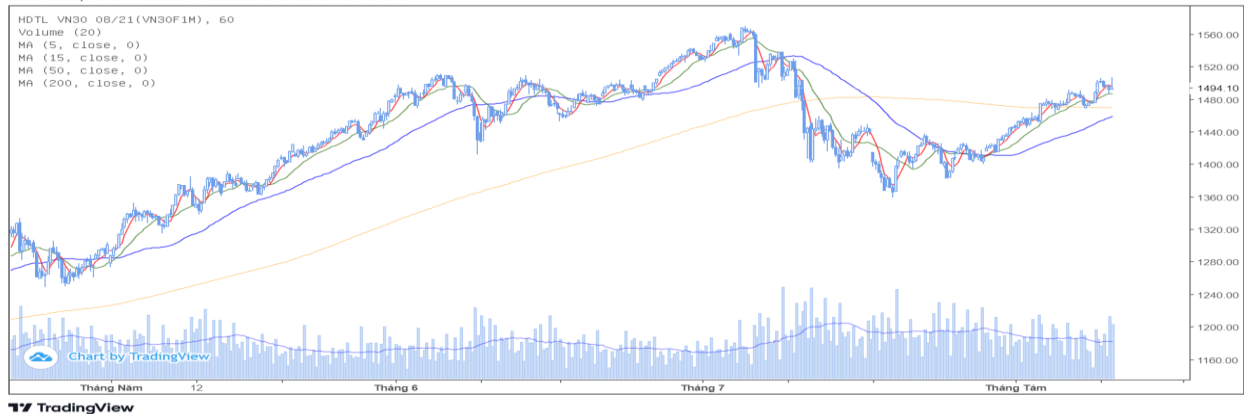
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

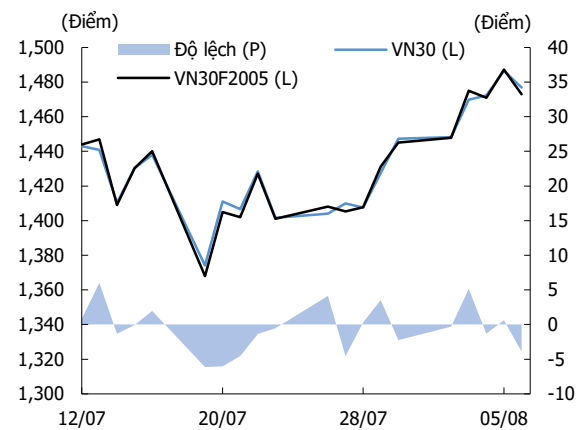
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, August 10, 2021 20:25:00 +07
VN30F2108, 60 O: 1492.50 H: 1506.80 L: 1491.30 C: 1494.10



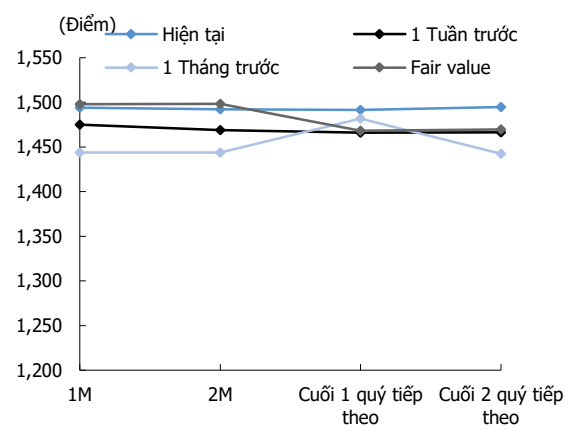
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



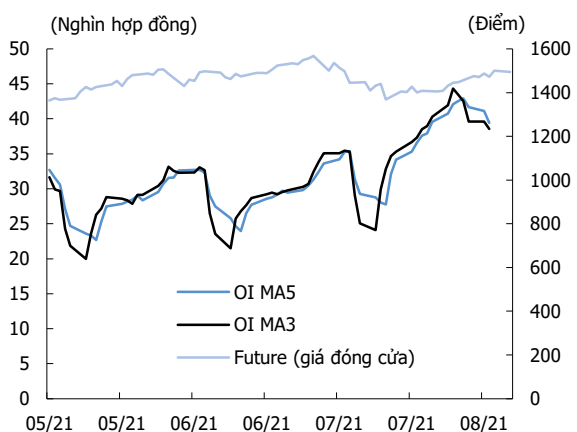
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



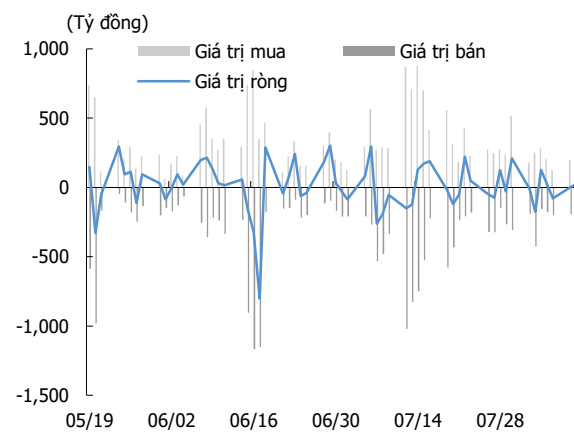
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 4. Khối lượng hợp đồng mở OI



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
ACB	Ngân hàng Á Châu	Tài chính	98,621	6.23	36,500	0.0	10.2	2.44	11,441	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	174,153	0.52	43,300	0.3	17.5	2.14	3,848	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	39,640	0.29	53,400	(0.9)	21.0	1.94	1,105	26.9	71,200	44,500
CTG	VietinBank	Tài chính	166,519	1.86	34,650	0.3	9.4	1.83	21,032	24.5	42,535	17,665
FPT	FPT Corp	CNTT	88,750	5.61	97,800	0.3	23.1	5.29	3,100	49.0	98,400	40,435
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	183,739	0.68	96,000	3.2	23.5	3.93	930	2.7	98,000	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	140,000	0.42	35,000	(0.6)	29.1	2.89	5,446	0.7	37,700	10,600
HDB	HDBank	Tài chính	56,658	2.95	35,550	0.1	11.5	2.30	4,997	18.3	37,900	15,818
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	220,962	9.04	49,400	(0.6)	12.2	3.35	31,940	26.7	56,300	17,704
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	26,107	1.26	41,900	(1.1)	21.5	3.09	3,971	30.7	42,400	20,823
MBB	MBBank	Tài chính	112,027	4.58	29,650	(0.8)	10.7	2.10	27,786	22.3	32,926	10,435
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	163,504	4.26	138,500	(1.8)	108.1	10.06	1,747	33.5	141,500	52,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	82,650	4.00	173,900	0.1	19.2	4.78	943	49.0	179,900	78,800
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	154,139	4.01	104,600	(1.3)	33.9	4.83	2,906	9.7	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	45,221	1.35	92,900	(0.7)	32.0	8.10	3,935	3.8	97,500	18,787
PLX	Petrolimex	Năng lượng	66,917	0.65	53,800	1.7	18.5	2.85	2,694	17.3	59,600	44,600
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,782	1.30	95,800	(0.7)	8.1	3.81	543	49.0	109,100	54,300
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	26,346	0.39	11,250	0.9	10.8	0.91	10,544	3.0	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	98,821	0.81	154,100	(0.6)	21.1	4.75	175	62.7	211,000	150,000
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	38,902	1.88	59,400	0.2	21.1	3.43	14,984	50.5	60,300	14,250
STB	Sacombank	Tài chính	57,688	3.90	30,600	(0.3)	15.9	1.82	34,220	15.6	33,900	10,500
TCB	Techcombank	Tài chính	183,307	8.86	52,300	(0.4)	11.3	2.20	19,793	22.5	58,600	19,300
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	38,580	1.72	36,000	0.3	8.6	1.90	5,775	30.0	40,900	17,024
VCB	Vietcombank	Tài chính	367,179	3.00	99,000	0.7	17.3	3.64	1,986	23.6	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	384,873	5.76	117,000	(0.3)	11.8	4.02	4,442	23.5	120,400	74,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	382,215	8.00	113,000	(0.1)	52.0	4.74	2,215	15.1	145,900	85,900
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	64,289	2.39	118,700	(0.7)	30.1	4.25	568	18.3	138,500	98,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	186,842	5.56	89,400	1.9	19.6	5.91	3,425	55.1	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	148,512	7.18	60,500	(0.8)	12.0	2.47	25,919	15.4	73,300	21,050
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,420	1.54	28,350	(0.9)	24.1	2.14	5,462	30.4	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.