

Kiểm định vùng đỉnh cũ

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 1.1%, đóng cửa tại 1,500 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, MBB (+4.7%), TCB (+3.4%), VPB (+3.1%), và HPG (+1.6%) đóng góp đáng kể cho đà tăng của chỉ số trong khi VNM (-0.4%) tiếp tục có diễn biến kém tích cực hơn so với chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tiếp tục chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 720 tỷ đồng, tập trung chủ yếu trên VHM, VIC, và HPG.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng tăng tiếp tục

VN30F2108 tăng mạnh trong phiên giao dịch trước và có khuynh hướng kiểm định lại vùng đỉnh cũ (1,580 điểm). Cụ thể, hợp đồng này đóng cửa trên các đường MA chủ đạo (Đồ thị ngày), sự trở lại của xu hướng tăng được xác nhận. Vùng 1,450 điểm sẽ là vùng hỗ trợ quan trọng trong ngắn hạn và vùng 1,490 điểm sẽ là vùng hỗ trợ trong phiên. Mặc dù hợp đồng này tăng mạnh trong phiên giao dịch trước nhưng vùng 1,510 điểm vẫn chưa bị phá vỡ. Trong trường hợp này, traders nên tiếp tục nắm giữ vị thế mua và mua thêm khi vùng 1,490 điểm được kiểm định lại.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2108 quanh vùng 1,485 điểm nên được tiếp tục nắm giữ và chỉ đóng vị thế khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,465 điểm. Với vị thế mua mới, traders có thể mở vị thế mua trên VN30F2108 tại vùng 1,490 điểm và dừng lỗ khi ngưỡng 1,465 điểm bị phá vỡ. (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	1,500.8	1.1					
VN30F2108	1,503.0	1.2	171,116	34,884	1,484	19/08/2021	5
VN30F2109	1,498.0	1.1	1,344	1,583	1,485	16/09/2021	33
VN30F2112	1,499.0	1.3	46	211	1,454	16/12/2021	124
VN30F2203	1,495.0	1.1	61	77	1,455	17/03/2022	215

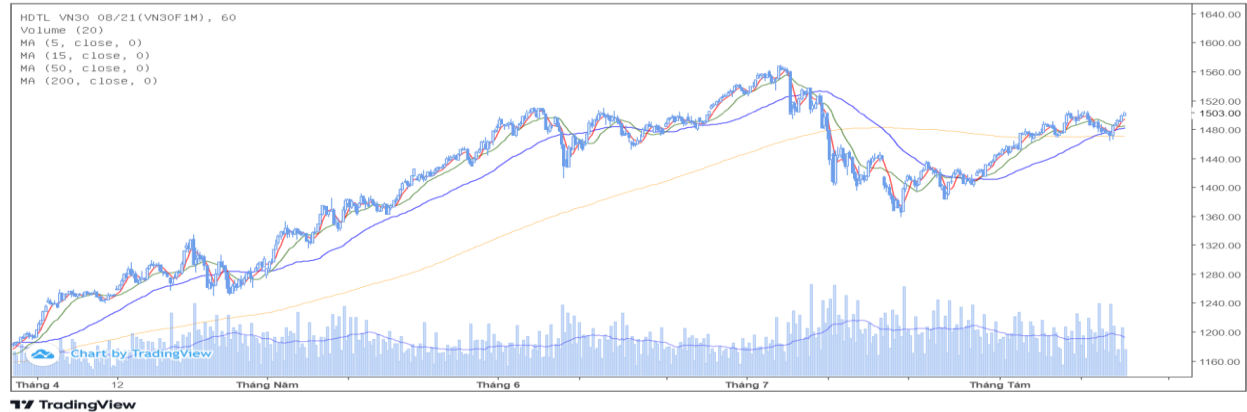
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

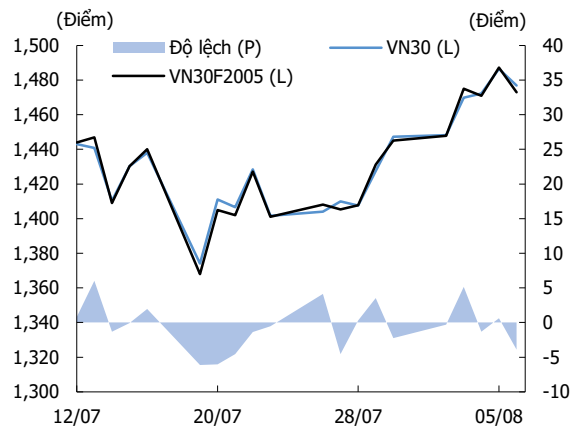
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, August 17, 2021 08:10:55 +07
VN30F2108, 60 O: 1499.30 H: 1503.90 L: 1498.20 C: 1503.00



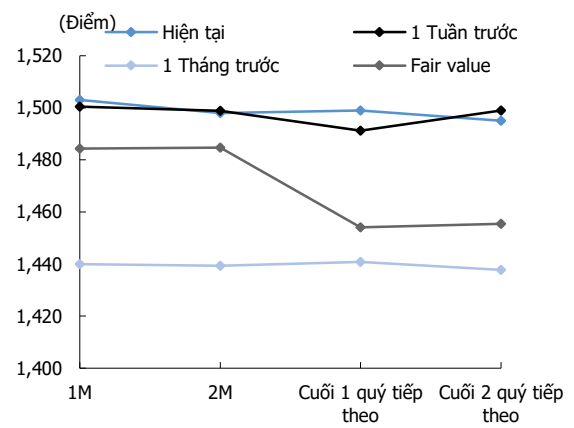
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



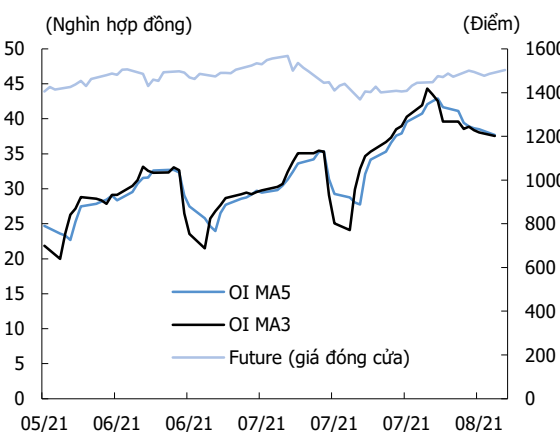
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



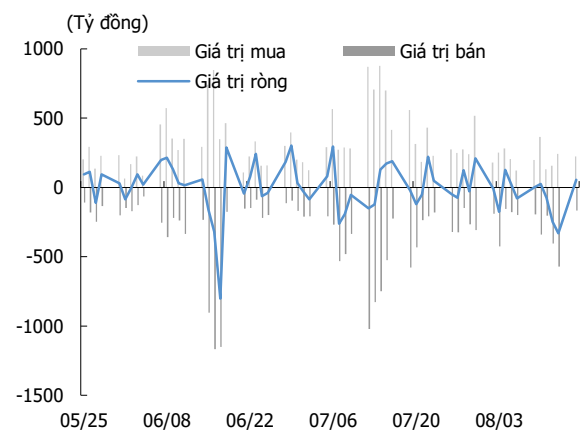
Nguồn: Bloomberg, KIS

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
ACB	Ngân hàng Á Châu	Tài chính	96,460	6.07	35,700	1.0	9.9	2.39	11,477	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	174,153	0.52	43,300	1.8	17.5	2.14	3,744	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	40,234	0.30	54,200	(0.4)	22.3	1.93	1,105	27.0	71,200	44,500
CTG	VietinBank	Tài chính	168,682	1.87	35,100	2.3	10.3	1.82	20,369	24.4	42,535	17,897
FPT	FPT Corp	CNTT	85,847	5.40	94,600	0.6	22.3	5.11	3,201	49.0	98,400	40,435
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	180,294	0.67	94,200	1.3	23.1	3.86	971	2.7	98,900	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	148,800	0.44	37,200	6.9	31.0	3.07	5,534	0.6	37,700	10,700
HDB	HDBank	Tài chính	56,977	2.95	35,750	2.9	10.8	2.18	4,715	18.3	37,900	16,273
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	221,186	9.01	49,450	1.6	8.8	3.00	31,091	26.6	56,300	17,741
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	25,983	1.25	41,700	(0.2)	21.2	3.01	4,044	30.7	42,400	20,909
MBB	MBBank	Tài chính	117,128	4.77	31,000	4.7	11.2	2.20	26,613	22.1	32,926	10,754
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	157,601	4.09	133,500	0.0	74.7	7.38	1,655	33.5	141,500	52,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	80,844	3.89	170,100	(0.5)	17.7	4.43	942	49.0	179,900	80,800
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	152,960	3.96	103,800	0.3	28.9	4.54	2,856	9.6	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	44,637	1.32	91,700	0.1	31.6	8.00	3,889	3.8	97,500	19,814
PLX	Petrolimex	Năng lượng	64,803	0.62	52,100	(1.5)	16.9	2.70	2,730	17.7	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	21,486	1.27	94,500	0.0	8.1	3.76	546	48.9	109,100	55,000
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	26,814	0.40	11,450	1.3	10.5	0.90	10,560	2.9	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	97,218	0.79	151,600	(0.1)	20.8	4.67	177	62.6	211,000	150,000
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	40,670	1.96	62,100	5.3	22.0	3.59	15,006	50.2	62,500	14,250
STB	Sacombank	Tài chính	57,122	3.85	30,300	2.0	15.8	1.80	32,850	15.9	33,900	10,550
TCB	Techcombank	Tài chính	189,265	9.11	54,000	3.4	11.7	2.27	19,508	22.5	58,600	19,750
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	39,759	1.77	37,100	1.9	8.8	1.96	5,574	30.0	40,900	17,024
VCB	Vietcombank	Tài chính	373,113	3.04	100,600	1.0	18.2	3.56	1,979	23.5	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	388,544	5.68	116,000	(3.3)	11.7	3.98	4,686	23.8	121,900	74,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	374,097	7.80	110,600	(0.3)	58.2	4.23	2,265	15.0	145,900	85,900
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	63,531	2.35	117,300	(0.6)	30.1	3.74	567	18.3	138,500	98,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	187,051	5.54	89,500	(0.4)	19.6	5.91	3,435	55.1	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	161,031	7.75	65,600	3.1	13.0	2.68	24,796	15.4	73,300	21,050
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,761	1.54	28,500	1.8	23.9	2.13	5,422	30.1	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.