

Dao động trong biên độ hẹp

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tích lũy trong phiên trước, đóng cửa tại 1,428 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, chỉ HPG (+1.2%) đóng góp tích cực cho chỉ số VN30 trong khi TCB (-1.4%) và MBB (-1.8%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tiếp tục chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 270 tỷ đồng, tập trung chủ yếu trên MSN, VHM, và VNM.

Đồ thị VN30 Future: Độ biến động gia tăng

Độ biến động gia tăng trên VN30F2109 trong phiên giao dịch trước. Cụ thể, hợp đồng này đang được giao dịch quanh các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý cho sự không rõ ràng về xu hướng sắp tới. Vùng 1,440-1,450 điểm là vùng kháng cự trong phiên và vùng 1,400 điểm vẫn đóng vai trò là vùng hỗ trợ quan trọng trong ngắn hạn. Tuy nhiên, đà tăng có xác suất cao sẽ quay trở lại khi hợp đồng này phản ứng tích cực với vùng 1,400 điểm. Trong trường hợp này, traders có thể mở vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Mua VN30F2109 sau phiên ATO và chỉ đóng vị thế khi xuất hiện giá đóng cửa dưới 1,405 điểm (Đồ thị giờ).

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

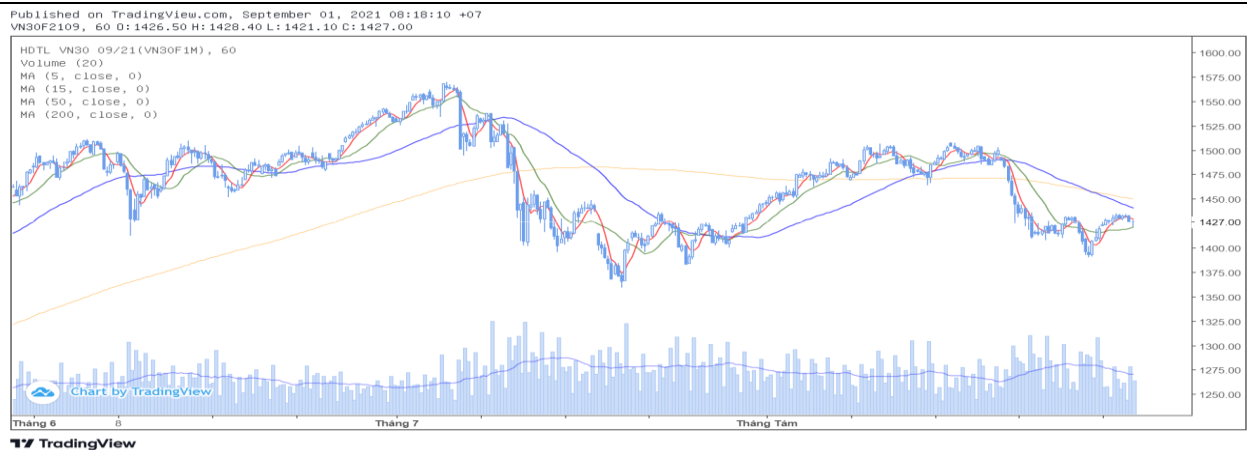
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,428.7	(0.2)					
VN30F2109	1,427.0	(0.4)	190,833	29,633	1,431	16/09/2021	14
VN30F2110	1,427.0	(0.3)	221	247	1,400	21/10/2021	49
VN30F2112	1,426.9	1.2	27	215	1,401	16/12/2021	105
VN30F2203	1,423.3	(0.3)	90	155	1,402	17/03/2022	196

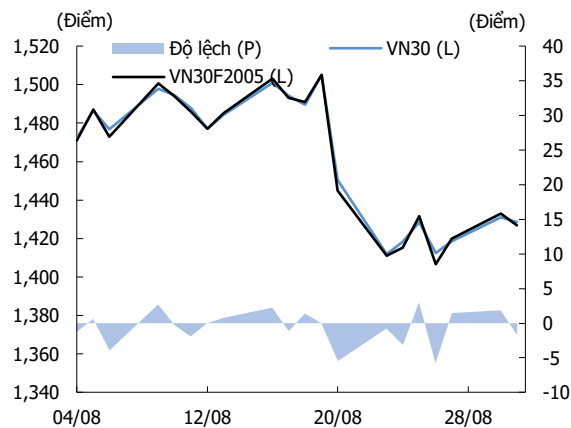
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

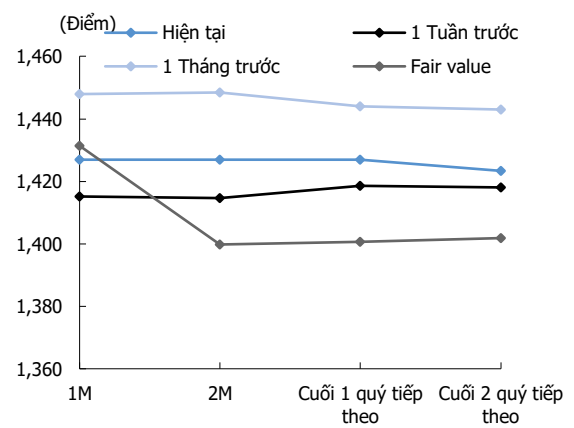
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

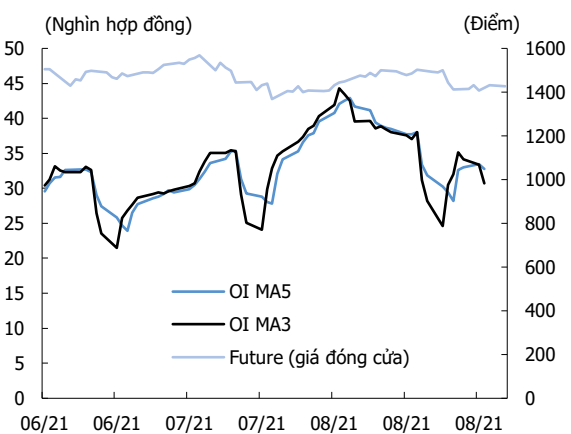
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

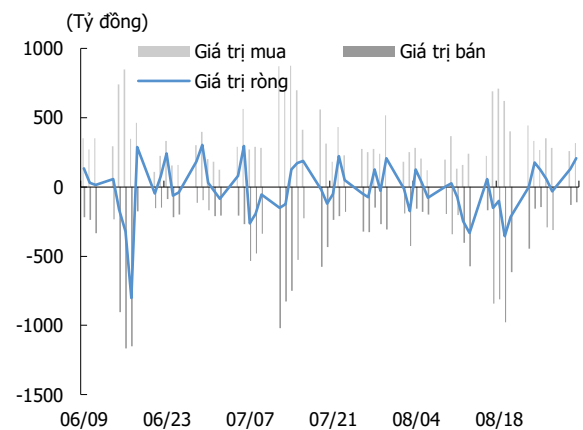
Nguồn: Bloomberg, KIS

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
ACB	Ngân hàng Á Châu	Tài chính	86,462	5.72	32,000	(0.5)	8.9	2.14	11,220	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	156,658	0.49	38,950	(1.3)	15.8	1.93	3,155	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	42,312	0.33	57,000	3.6	22.6	2.02	1,139	27.0	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	152,823	1.78	31,800	(1.5)	9.3	1.65	19,047	24.4	42,535	19,214
FPT	FPT Corp	CNTT	83,850	5.54	92,400	0.2	21.8	4.99	3,161	49.0	98,400	42,174
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	171,107	0.67	89,400	2.2	21.9	3.66	1,064	2.5	98,900	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	155,000	0.48	38,750	3.1	32.8	3.20	5,931	0.6	39,900	11,700
HDB	HDBank	Tài chính	51,698	2.82	25,950	(2.8)	9.8	1.98	4,925	18.4	30,320	13,648
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	220,515	9.44	49,300	1.2	8.8	2.99	29,560	26.3	56,300	17,926
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	24,768	1.25	39,750	0.6	20.2	2.87	3,694	30.4	42,400	21,455
MBB	MBBank	Tài chính	105,415	4.51	27,900	(1.8)	10.1	1.98	24,402	22.5	32,926	11,201
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	159,372	4.34	135,000	1.8	75.5	7.47	1,485	33.2	141,500	53,600
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	79,133	4.00	111,000	0.4	17.3	4.34	1,486	49.0	119,933	60,200
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	153,844	4.19	104,400	0.4	29.0	4.57	2,924	9.3	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	42,787	1.33	87,900	2.8	30.3	7.67	3,913	3.6	97,500	21,526
PLX	Petrolimex	Năng lượng	61,818	0.63	49,700	0.3	16.1	2.58	2,423	17.7	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	19,554	1.22	86,000	(0.5)	8.1	3.42	571	49.0	109,100	57,400
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	27,751	0.43	11,850	(0.8)	10.9	0.93	10,686	3.0	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	96,192	0.82	150,000	1.9	20.6	4.62	188	62.5	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	40,474	2.05	61,800	(1.0)	21.9	3.57	14,825	47.0	63,600	14,800
STB	Sacombank	Tài chính	51,561	3.65	27,350	(2.0)	14.2	1.62	28,939	16.0	33,900	11,050
TCB	Techcombank	Tài chính	169,988	8.60	48,500	(1.4)	10.5	2.04	19,956	22.5	58,600	20,950
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	36,544	1.71	34,100	(1.6)	8.1	1.80	5,060	30.0	40,900	18,088
VCB	Vietcombank	Tài chính	368,662	3.15	99,400	0.1	18.0	3.52	1,918	23.5	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	356,388	5.48	106,400	(0.5)	10.6	3.65	6,837	23.5	121,900	74,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	358,071	7.84	94,100	0.0	53.3	3.93	2,635	14.8	129,689	79,467
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	68,514	2.67	126,500	(0.3)	30.1	4.04	691	18.0	138,500	99,400
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	182,662	5.68	87,400	0.0	19.1	5.78	3,363	54.9	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	152,136	7.65	61,600	0.0	12.2	2.52	20,082	15.4	73,300	22,450
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	62,034	1.55	27,300	0.4	22.8	2.04	5,029	29.7	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.