

Vùng biến động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.2%, đóng cửa tại 1,444 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tiếp tục chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 730 tỷ đồng, tập trung chủ yếu trên VHM, SSI, và VIC.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng tăng ngắn hạn

Mặc dù VN30F2109 tích lũy trong phiên trước nhưng xu hướng tăng ngắn hạn đã được xác nhận. Tuy nhiên, hợp đồng này đang được giao dịch quanh các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý đã tăng vẫn chưa đại cải thiện đáng kể. 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. Đáng chú ý, vùng đáy 1,400 điểm nhận được lực cầu mạnh và đà tăng khả năng cao sẽ được cải thiện trong thời gian tới. Trong trường hợp này, traders có thể nắm giữ vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua (VN30F2109) quanh vùng 1,427 điểm nên được tiếp tục nắm giữ 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	1,444.1	0.2					
VN30F2109	1,441.0	(0.2)	167,859	29,762	1,442	16/09/2021	11
VN30F2110	1,437.0	(0.3)	351	417	1,410	21/10/2021	46
VN30F2112	1,439.9	(0.1)	36	481	1,411	16/12/2021	102
VN30F2203	1,436.9	(0.0)	23	137	1,412	17/03/2022	193

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

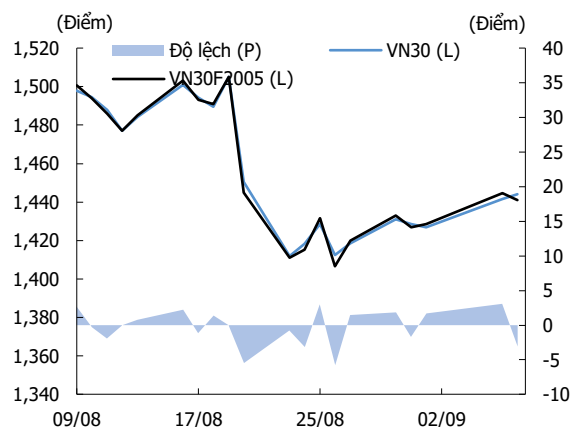
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



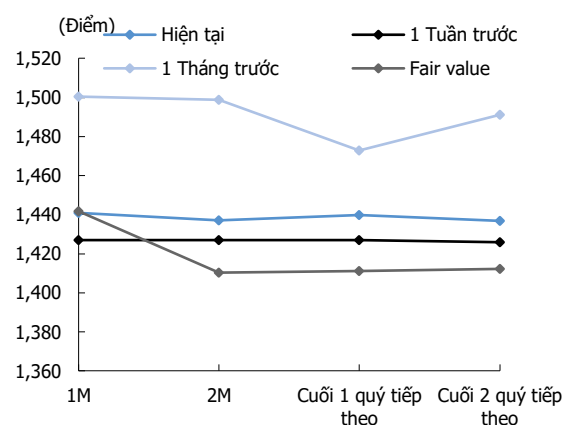
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



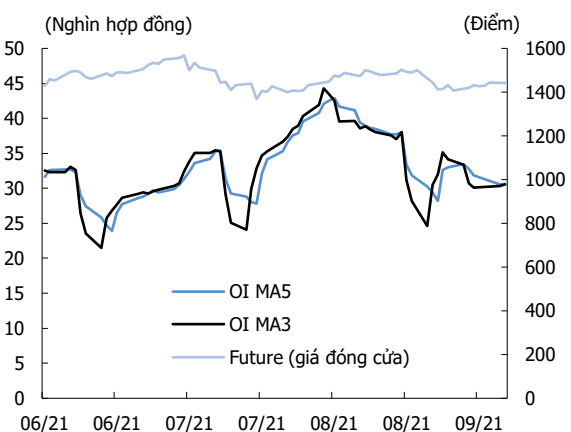
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



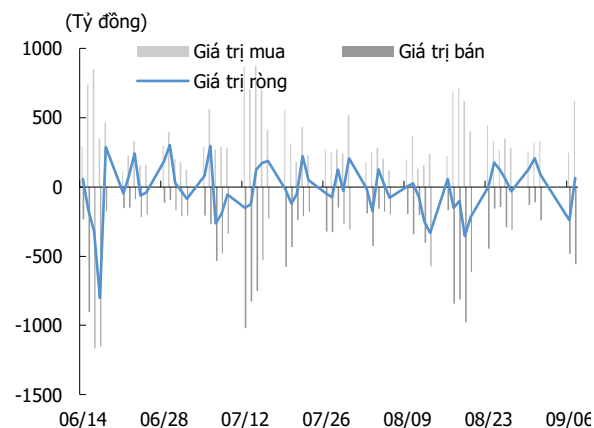
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	87,813	5.74	32,500	1.4	9.1	2.17	10,640	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	159,674	0.49	39,700	1.5	16.1	1.96	2,881	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	41,050	0.32	55,300	(2.0)	21.9	1.96	1,172	27.1	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	156,908	1.81	32,650	1.9	9.6	1.69	18,767	24.5	42,535	19,214
FPT	FPT Corp	CNTT	84,848	5.55	93,500	(1.5)	22.1	5.05	3,090	49.0	98,400	42,174
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	169,767	0.65	88,700	(1.9)	21.8	3.63	1,019	2.5	98,900	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	155,400	0.48	38,850	(1.1)	32.9	3.21	6,024	0.7	41,000	11,800
HDB	HDBank	Tài chính	53,192	2.87	26,700	1.3	10.1	2.04	4,459	18.4	30,320	13,867
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	226,777	9.60	50,700	(1.0)	9.0	3.07	28,713	26.3	56,300	18,037
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	25,297	1.27	40,600	(0.9)	20.7	2.93	3,598	30.3	42,400	21,455
MBB	MBBank	Tài chính	108,060	4.57	28,600	1.1	10.3	2.03	23,004	22.5	32,926	11,201
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	153,233	4.13	129,800	(1.0)	72.6	7.18	1,472	33.0	141,500	53,600
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	78,634	3.93	110,300	(0.6)	17.2	4.31	1,473	49.0	119,933	60,200
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	154,434	4.16	104,800	0.0	29.1	4.59	2,943	9.3	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	40,402	1.24	83,000	(3.5)	28.6	7.24	3,854	3.6	97,500	23,199
PLX	Petrolimex	Năng lượng	62,688	0.63	50,400	(1.4)	15.7	2.57	2,223	17.6	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	19,599	1.21	86,200	(0.3)	8.1	3.43	591	48.5	109,100	57,400
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	28,220	0.43	12,050	(2.8)	11.2	0.95	10,385	3.1	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	95,359	0.81	148,700	(0.3)	20.4	4.58	186	62.6	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	39,557	1.98	60,400	0.7	21.4	3.49	14,729	47.0	63,600	15,300
STB	Sacombank	Tài chính	52,598	3.68	27,900	1.3	14.5	1.66	27,176	16.1	33,900	11,050
TCB	Techcombank	Tài chính	174,019	8.71	49,650	1.4	10.8	2.09	19,612	22.5	58,600	20,950
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	39,009	1.80	36,400	4.6	8.7	1.92	4,969	30.0	40,900	18,088
VCB	Vietcombank	Tài chính	370,888	3.14	100,000	0.0	18.1	3.54	1,758	23.5	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	367,107	5.58	109,600	1.1	10.9	3.76	7,446	23.5	121,900	74,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	357,310	7.74	93,900	(1.2)	53.2	3.92	2,558	14.7	129,689	79,467
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	67,485	2.60	124,600	(0.9)	30.1	3.98	718	17.7	138,500	99,400
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	180,363	5.55	86,300	(0.6)	18.9	5.70	3,348	54.8	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	156,829	7.80	63,500	3.9	12.6	2.60	17,142	15.4	73,300	22,450
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	61,807	1.53	27,200	(3.2)	22.8	2.03	4,685	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.