

Đà tăng suy yếu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 0.5% trong phiên giao dịch trước, đóng cửa tại 1,438 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tiếp tục chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 870 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tiếp tục tập trung chủ yếu trên HPG, VCB, và MSN.

Đồ thị VN30 Future: Đà tăng dần suy yếu

Đà tăng dần suy yếu trên VN30F2109 khi hợp đồng này không còn giữ vững kênh giá tăng. Cụ thể, hợp đồng này đã phá vỡ kênh giá tăng và đóng cửa dưới MA20, tín hiệu cho sự suy yếu của đà tăng. Vùng 1,450 điểm vẫn chưa bị phá vỡ, xu hướng tăng ngắn hạn vẫn chưa hoàn toàn chiếm ưu thế. 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, xác suất cho sự quay trở lại của đà giảm vẫn duy trì. Trong trường hợp này, traders có thể nắm giữ vị thế mua nhưng nên thoát vị thế khi vùng cầu trong phiên bị phá vỡ.

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 1,430 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	1,438.2	(0.5)					
VN30F2109	1,436.5	(0.4)	130,215	30,273	1,445	16/09/2021	4
VN30F2110	1,436.0	(0.3)	4,910	4,515	1,414	21/10/2021	39
VN30F2112	1,435.9	(0.2)	43	274	1,414	16/12/2021	95
VN30F2203	1,433.0	(0.4)	49	111	1,416	17/03/2022	186

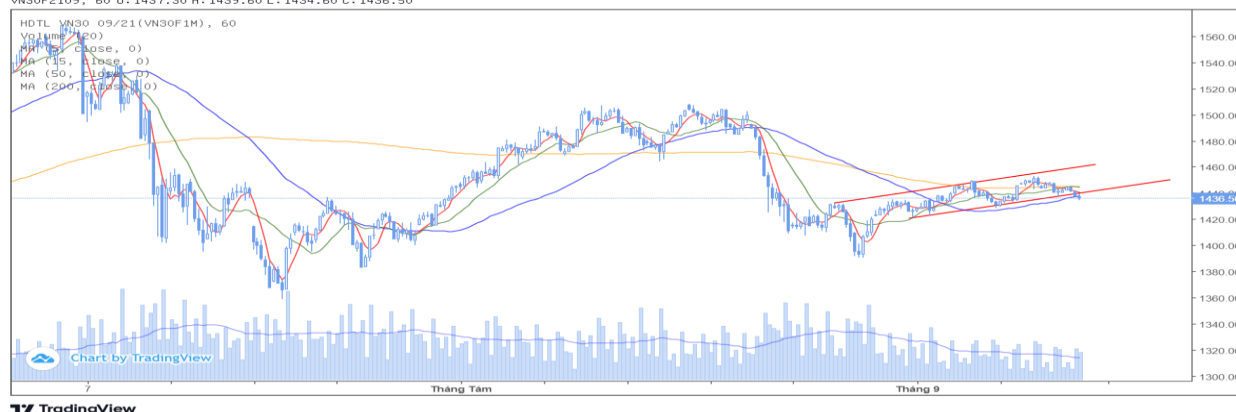
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

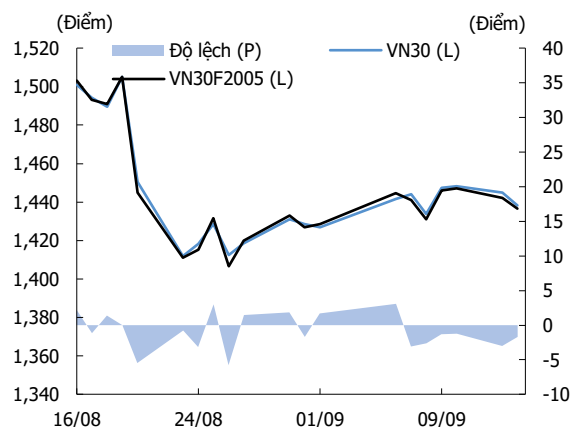
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

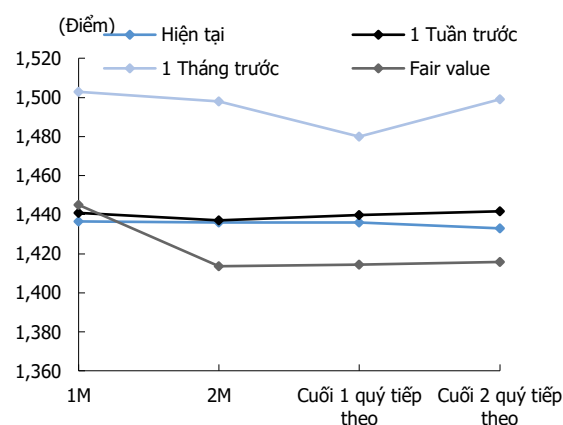
Published on TradingView.com, September 14, 2021 19:48:54 +07
 VN30F2109, 60 O:1437.30 H:1439.60 L:1434.60 C:1436.50



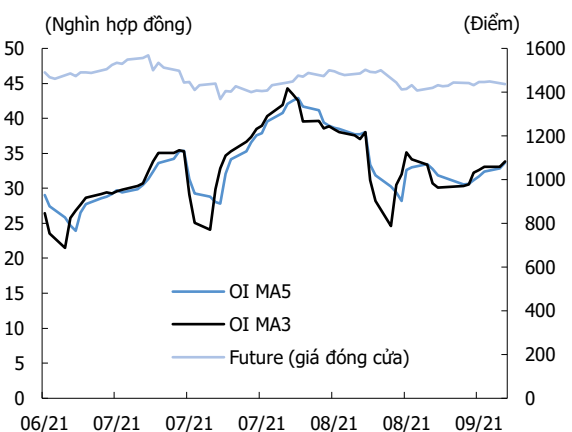
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

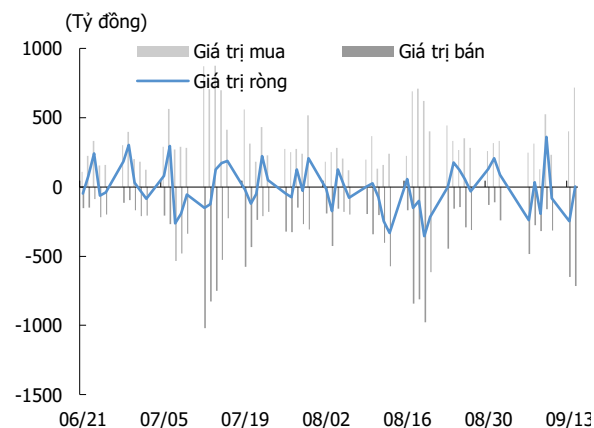
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	85,111	5.59	31,500	(1.3)	8.8	2.11	9,784	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	155,652	0.48	38,700	(1.1)	15.7	1.91	2,572	16.6	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	40,085	0.31	54,000	(1.1)	21.4	1.92	1,140	27.0	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	149,939	1.74	31,200	(2.0)	9.1	1.62	17,844	24.6	42,535	19,486
FPT	FPT Corp	CNTT	85,121	5.59	93,800	0.9	22.2	5.07	2,978	49.0	98,400	42,609
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	170,342	0.66	89,000	0.5	21.8	3.64	986	2.5	98,900	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	152,000	0.47	38,000	0.8	32.2	3.14	5,957	0.7	41,000	11,850
HDB	HDBank	Tài chính	49,407	2.67	24,800	(1.6)	9.4	1.89	4,068	18.4	30,320	14,352
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	224,988	9.57	50,300	(1.0)	9.0	3.05	28,291	26.3	56,300	18,148
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	25,702	1.29	41,250	0.0	21.0	2.97	3,449	30.3	42,400	21,455
MBB	MBBank	Tài chính	104,282	4.43	27,600	(1.1)	10.0	1.96	21,200	22.7	32,926	11,456
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	159,962	4.33	135,500	3.8	75.8	7.49	1,467	32.5	141,500	53,600
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	88,757	4.46	124,500	(0.4)	19.4	4.86	1,502	49.0	125,000	61,600
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	151,781	4.11	103,000	0.0	28.6	4.51	2,882	9.3	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	39,185	1.21	80,500	0.0	27.8	7.02	3,667	3.5	97,500	27,839
PLX	Petrolimex	Năng lượng	63,657	0.63	50,100	(0.4)	15.6	2.56	1,913	17.7	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	20,236	1.25	89,000	(3.3)	8.1	3.54	630	48.3	109,100	57,400
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	26,932	0.42	11,500	(3.0)	10.7	0.91	10,182	3.1	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	106,453	0.91	166,000	2.8	22.8	5.11	182	62.6	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	41,802	2.10	42,500	(2.5)	22.8	3.72	21,357	46.1	45,300	10,338
STB	Sacombank	Tài chính	50,241	3.53	26,650	(0.9)	13.9	1.58	25,146	16.1	33,900	11,200
TCB	Techcombank	Tài chính	169,988	8.54	48,500	(0.9)	10.5	2.04	18,550	22.5	58,600	21,200
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	40,295	1.87	37,600	(1.3)	9.0	1.99	5,284	30.0	40,900	18,088
VCB	Vietcombank	Tài chính	364,583	3.10	98,300	0.2	17.8	3.48	1,642	23.6	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	358,398	5.47	107,000	0.0	10.7	3.67	7,974	23.1	121,900	74,900
VIC	VinGroup	Bất động sản	350,080	7.62	92,000	0.0	52.1	3.84	2,503	14.6	129,689	80,889
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	68,135	2.63	125,800	(1.7)	30.1	4.01	739	17.7	138,500	99,400
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	181,826	5.62	87,000	(0.2)	19.0	5.75	3,268	54.6	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	157,817	7.88	63,900	(1.4)	12.6	2.61	14,067	15.4	73,300	22,850
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,307	1.60	28,300	1.4	23.7	2.11	4,453	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.