

Đà giảm gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 1.4% trong phiên giao dịch trước, đóng cửa tại 1,440 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 78 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên HPG, VIC, và CTG.

Đồ thị VN30 Future: Kiểm định vùng hỗ trợ

VN30F2110 giảm trong phiên giao dịch trước và xu hướng giảm ngắn hạn đã được xác nhận. Vùng 1,420 điểm là vùng hỗ trợ chủ đạo trong phiên trong khi vùng 1,470 điểm là vùng kháng cự quan trọng. Hợp đồng này đóng cửa dưới các đường MA chủ đạo, xác nhận xu hướng giảm ngắn hạn. Tuy nhiên, Bollinger bands co thắt (đồ thị ngày) và vùng 1,420 điểm vẫn duy trì, đà giảm vẫn chưa đạt mức cực đại. Trong trường hợp này, traders có thể mở vị thế bán nhưng số lượng vị thế nên điều chỉnh ở mức thấp khi vùng 1,420 điểm vẫn còn duy trì.

Chiến lược đầu tư

Bán VN30F2110 sau phiên ATO và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên ngưỡng 1,450 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	1,439.2	(1.4)					
VN30F2110	1,434.0	(1.1)	132,794	39,401	1,428	21/10/2021	26
VN30F2111	1,434.0	(1.0)	319	299	1,429	18/11/2021	54
VN30F2112	1,429.5	(1.2)	24	232	1,429	16/12/2021	82
VN30F2203	1,429.9	(1.0)	33	123	1,431	17/03/2022	173

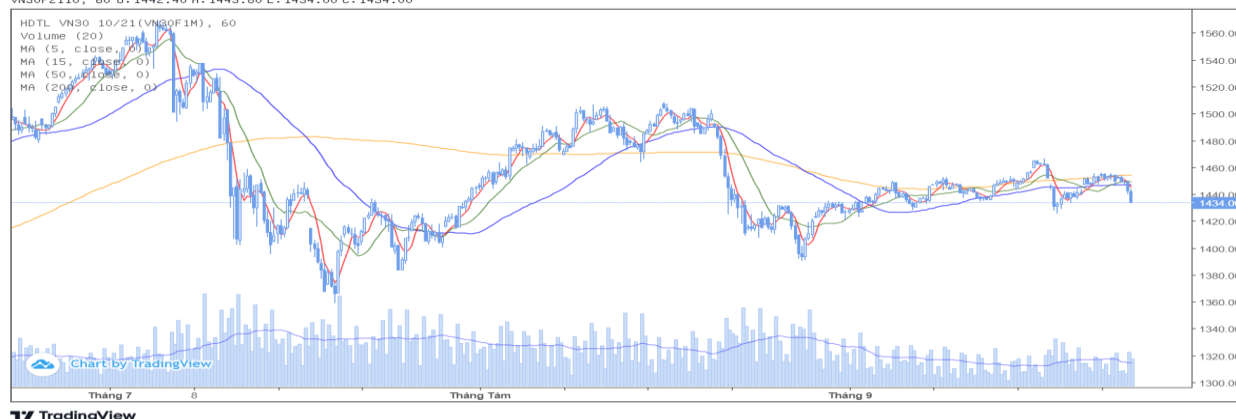
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

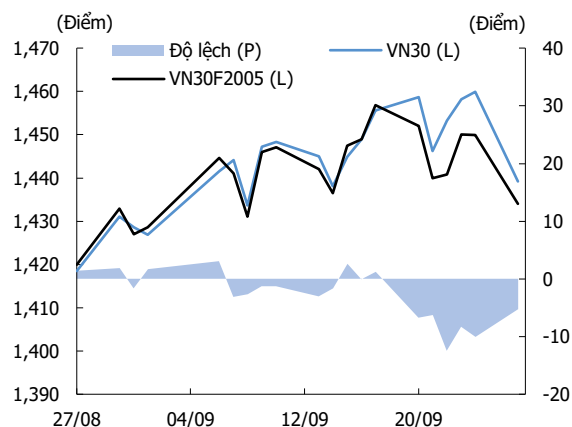
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

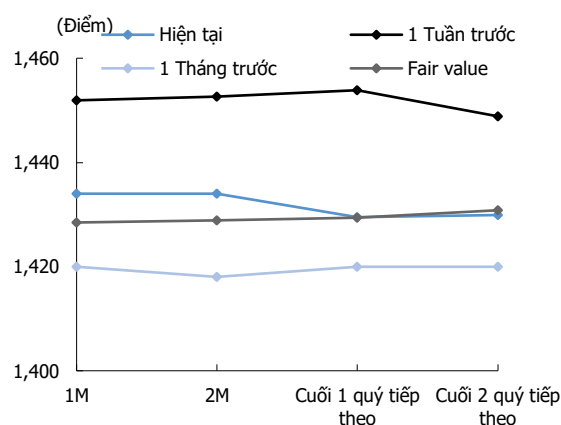
Published on TradingView.com, September 28, 2021 07:54:20 +07
 VN30F2110, 60 O: 1442.40 H: 1443.80 L: 1434.00 C: 1434.00



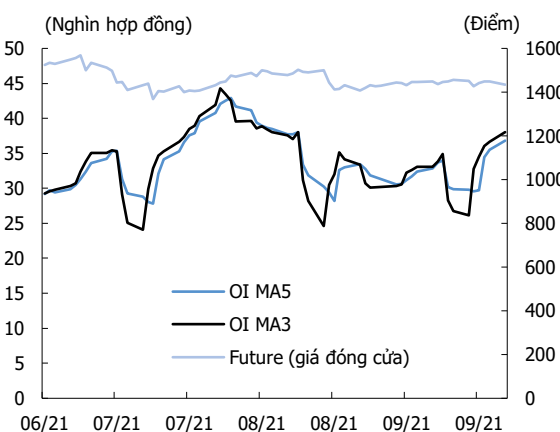
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

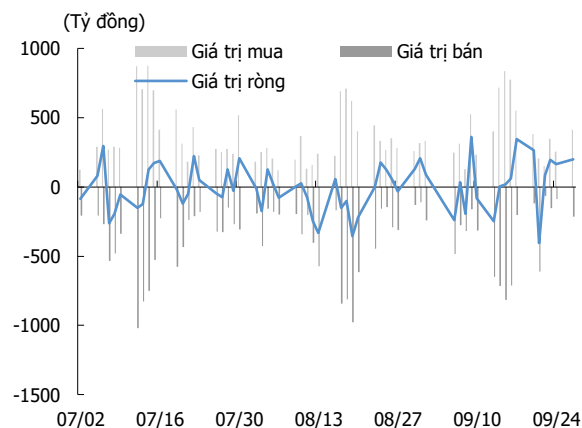
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	85,111	5.58	31,500	(1.6)	8.8	2.11	8,985	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	158,468	0.49	39,400	(0.8)	16.0	1.95	2,306	16.6	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	41,941	0.32	56,500	(3.9)	22.4	2.00	1,126	26.7	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	148,978	1.72	31,000	(2.2)	9.1	1.61	15,993	24.7	42,535	20,338
FPT	FPT Corp	CNTT	83,578	5.48	92,100	(0.6)	21.8	4.98	2,957	49.0	98,400	42,609
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	172,256	0.66	90,000	(1.1)	22.1	3.68	965	2.5	98,900	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	142,400	0.44	35,600	(3.8)	30.2	2.94	5,432	0.6	41,000	11,850
HDB	HDBank	Tài chính	50,801	2.74	25,500	0.0	9.6	1.94	3,623	18.0	30,320	14,434
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	227,224	9.65	50,800	0.0	9.0	3.08	28,022	26.0	56,300	19,037
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	25,765	1.29	41,350	(1.5)	21.0	2.98	3,558	30.9	43,050	21,455
MBB	MBBank	Tài chính	105,793	4.49	28,000	(2.4)	10.1	1.98	18,527	22.9	32,926	12,477
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	159,372	4.31	135,000	(5.2)	75.5	7.47	1,524	32.4	150,000	53,600
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	89,826	4.51	126,000	(3.4)	19.6	4.92	1,523	49.0	134,000	66,533
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	150,897	4.08	102,400	(0.6)	28.5	4.48	2,866	9.0	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	39,088	1.21	80,300	0.0	27.7	7.01	3,430	3.2	97,500	28,752
PLX	Petrolimex	Năng lượng	63,657	0.63	50,100	0.2	15.6	2.56	1,452	17.6	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	20,690	1.28	91,000	(1.1)	8.1	3.62	649	48.1	109,100	57,400
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	27,049	0.42	11,550	(0.4)	10.7	0.91	9,968	2.9	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	101,964	0.87	159,000	(0.6)	21.8	4.90	190	62.7	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	39,310	1.97	40,000	(4.3)	21.5	3.50	19,641	44.7	45,300	10,867
STB	Sacombank	Tài chính	49,958	3.50	26,500	(0.9)	13.8	1.57	23,434	15.5	33,900	12,950
TCB	Techcombank	Tài chính	173,790	8.70	49,500	(2.2)	10.7	2.08	17,314	22.5	58,600	21,200
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	46,867	1.99	40,000	(3.8)	9.5	2.11	5,932	30.0	42,100	18,088
VCB	Vietcombank	Tài chính	363,470	3.09	98,000	(1.5)	17.7	3.47	1,476	23.6	117,200	80,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	340,512	5.19	78,200	(1.8)	10.1	3.49	10,658	22.9	93,769	57,615
VIC	VinGroup	Bất động sản	327,629	7.12	86,100	(1.0)	48.7	3.60	2,843	13.9	129,689	80,889
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	69,868	2.70	129,000	3.2	30.1	4.12	770	17.5	138,500	99,400
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	185,588	5.73	88,800	(2.1)	19.4	5.87	3,371	54.6	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	165,473	8.25	67,000	0.0	13.3	2.74	11,805	15.4	73,300	22,900
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,193	1.59	28,250	(0.9)	23.6	2.11	4,766	29.6	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.