

Lực cầu dần suy yếu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,075 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán quay trở lại với giá trị bán ròng ghi nhận ở mức 165 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu bởi áp lực bán trên CTG, HPG, và SSI.

Đò thị VN30 Future: Độ biến động bắt đầu gia tăng

Áp lực bán đã chững lại trên hợp đồng VN30F2304 khi lực cầu xuất hiện quanh vùng 1,050 điểm. Tuy nhiên, áp lực bán vẫn còn hiện hữu quanh vùng 1,080 điểm và hợp đồng này đã bắt đầu tích lũy ngắn hạn quanh vùng này. Mặc dù giai đoạn phục hồi xuất hiện, nhưng lực cầu vẫn ở mức thấp. Nếu vùng 1,050 điểm bị phá vỡ, vùng 1,000 điểm sẽ là điểm đến tiếp theo. Ở chiều ngược lại, giai đoạn phục hồi sẽ hoàn toàn chiếm ưu thế khi vùng 1,100 điểm bị phá vỡ. Trong ngắn hạn, hợp đồng này sẽ tiếp tục tăng điểm khi các đường MA chủ đạo đã bị phá vỡ. Ngưỡng hỗ trợ chủ đạo cho giai đoạn phục hồi là ngưỡng 1,050 điểm. Nếu vùng 1,050 điểm bị phá vỡ, giai đoạn phục hồi sẽ không còn. Đáng chú ý, tổng khối lượng OI (Open Interest) tăng trên mức 50,000 hợp đồng, điều này hàm ý rằng khả năng cao hợp đồng này sẽ xuất hiện xu hướng mới. Trong trường hợp này, traders đã có thể mở vị thế mua.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2304 nên tiếp tục được nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,050 điểm. (Đò thị giờ)

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

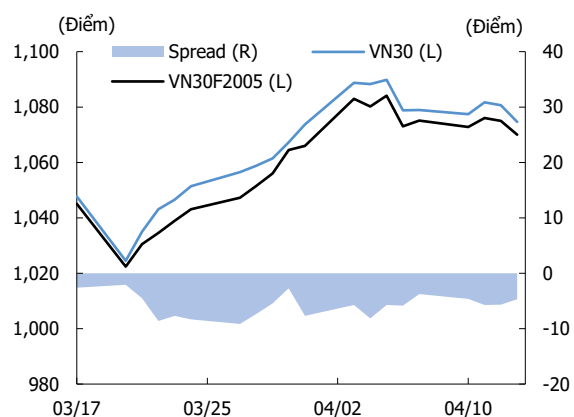
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	1,074.7	(0.6)				
VN30F2304	1,070.0	(0.5)	139,140	54,744	1,081	20/04/23
VN30F2305	1,068.1	(0.3)	2,132	4,347	1,084	18/05/23
VN30F2306	1,065.1	(0.5)	41	1,080	1,086	15/06/23
VN30F2309	1,062.5	(0.3)	41	304	1,095	21/09/23

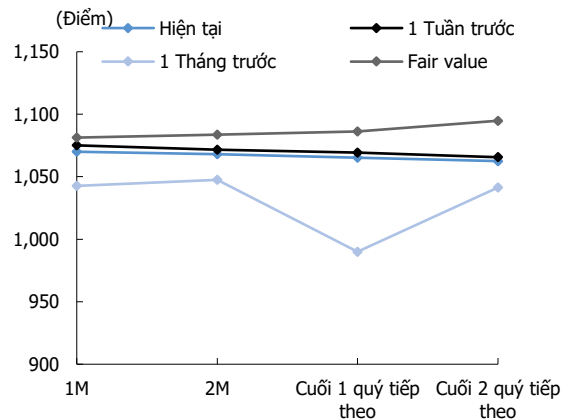
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

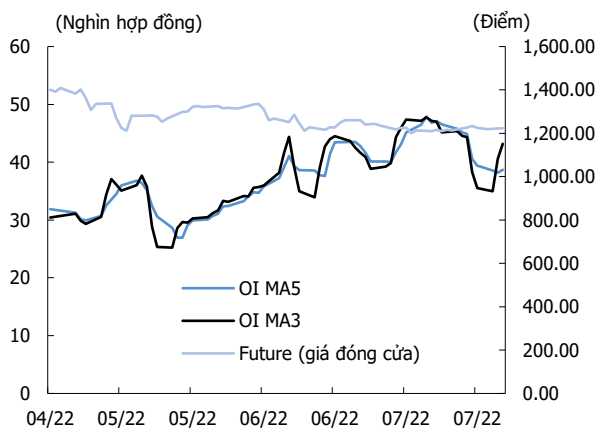
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch

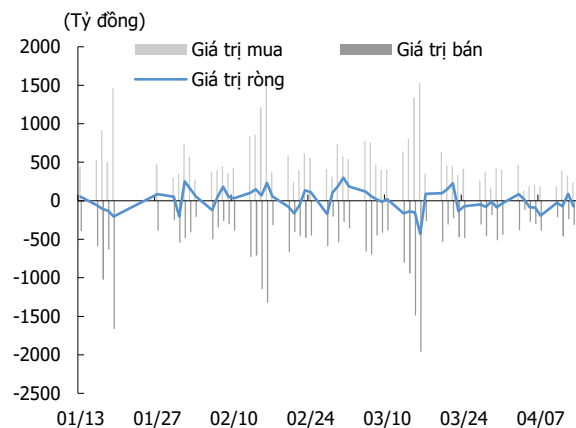
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	84,267	6.95	24,950	0.4	6.2	1.44	3,792	30.0	27,320	17,450
BID	BIDV	Tài chính	227,381	0.88	44,950	1.2	12.5	2.29	1,187	17.2	48,000	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	35,928	0.35	48,400	(0.2)	23.2	1.76	351	27.4	70,000	41,200
CTG	VietinBank	Tài chính	141,289	2.06	29,400	(0.3)	8.4	1.32	2,528	28.1	31,900	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	87,323	7.21	79,600	(0.9)	16.4	4.15	759	49.0	99,083	61,300
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	191,395	0.93	100,000	0.2	13.0	3.20	233	3.0	134,000	92,600
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	63,800	0.25	15,950	(2.4)	16.6	1.30	2,196	0.5	37,200	9,300
HDB	HDBank	Tài chính	49,551	3.37	19,700	0.3	6.4	1.34	2,529	19.4	22,480	13,050
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	118,912	6.35	20,450	(1.4)	14.0	1.24	23,089	23.6	35,038	11,800
BCM	Becamex IDC Corp	Nguyên vật liệu	82,593	0.32	79,800	(0.3)	58.8	4.88	88	2.8	101,800	58,200
MBB	MBBank	Tài chính	84,105	4.49	18,550	(0.8)	4.8	1.11	8,789	23.2	27,417	13,200
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	112,759	4.93	79,200	(0.4)	31.5	4.31	931	30.3	127,500	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	60,072	4.37	41,050	0.7	14.5	2.51	2,249	49.0	81,400	35,250
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	28,277	1.51	14,500	(3.7)	12.4	0.75	18,488	6.2	87,800	10,050
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	9,403	0.41	14,000	(1.1)	8.2	1.15	6,639	2.9	67,131	9,940
PLX	Petrolimex	Năng lượng	47,266	0.46	37,200	0.5	32.2	1.92	957	17.8	55,700	22,950
VIB	VIBBank	Tài chính	44,577	2.16	21,150	(0.7)	8.1	1.37	3,858	20.5	33,556	16,200
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,498	0.76	13,450	(1.5)	15.3	1.03	8,485	7.7	16,400	8,910
SAB	SABECO	TD thiết yếu	108,697	1.16	169,500	(0.9)	21.3	4.70	125	62.6	203,000	149,000
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	32,606	2.22	21,750	(1.1)	14.9	1.46	17,193	58.1	40,368	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	49,864	4.84	26,450	1.3	9.9	1.29	18,934	26.5	31,500	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	106,221	6.70	30,200	(1.6)	5.3	0.95	3,675	22.5	48,350	19,300
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	36,697	2.14	23,200	0.4	5.9	1.14	5,863	30.0	40,000	18,300
VCB	Vietcombank	Tài chính	417,408	4.46	88,200	(0.1)	14.0	1.40	864	23.5	96,300	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	219,896	5.34	50,500	(2.1)	7.6	1.51	2,380	24.3	73,500	39,400
VIC	VinGroup	Bất động sản	202,139	4.91	53,000	(0.2)	79.0	1.80	1,809	12.8	82,200	49,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	53,782	2.61	99,300	(0.4)	30.1	3.61	276	17.5	144,300	94,000
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	153,612	5.97	73,500	(1.1)	20.2	5.15	1,404	55.6	85,600	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	138,292	9.40	20,600	(0.2)	7.6	1.43	18,543	17.5	27,067	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	64,534	2.51	28,400	(1.0)	23.2	1.93	2,265	32.9	32,400	21,400

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 © 2023 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.