

Kiểm định lại ngưỡng 1,050 điểm

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,061 điểm. Cụ thể, STB (-1.97%), TCB (-1.81%), HPG (-1.84%), GVR (-1.83%) và VIB (-1.41%) là bộ 5 mã giảm mạnh nhất rổ chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tiếp tục với giá trị bán ròng ghi nhận ở mức 386 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu lực bán trên HPG, VNM và CTG.

Đồ thị VN30 Future: Áp lực bán quanh vùng 1,080 điểm

Lực cầu quay trở lại quanh vùng 1,050 điểm, xác nhận giai đoạn phục hồi và tăng khả năng kiểm định vùng 1,100 điểm. Tuy nhiên, áp lực bán duy trì ở mức cao quanh vùng 1,080 điểm. Điều này hàm ý rằng giai đoạn phục hồi trong phiên có khả năng bị gián đoạn. Các đường MA chủ đạo trên đồ thị dài hạn vẫn chưa xác nhận cho sự củng cố xu hướng. Vùng 1,050 điểm là vùng hỗ trợ quan trọng và khó có thể bị phá vỡ trong ngắn hạn. Trên đồ thị giờ, giai đoạn phục hồi có thể bị chững lại và giai đoạn biến động có thể xuất hiện. Vị thế mua mới có tỉ lệ risk/reward tốt nên traders có thể mở vị thế mua sau phiên ATO.

Chiến lược đầu tư

Mua VN30F2306 sau phiên ATO và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,050 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
VN30 Index	1,061.6	(0.6)				
VN30F2306	1,056.1	(0.3)	183,543	47,436	1,070	15/06/23
VN30F2307	1,052.2	(0.5)	698	864	1,073	20/07/23
VN30F2309	1,051.0	(0.1)	46	272	1,078	21/09/23
VN30F2312	1,048.1	(0.4)	89	136	1,085	21/12/23

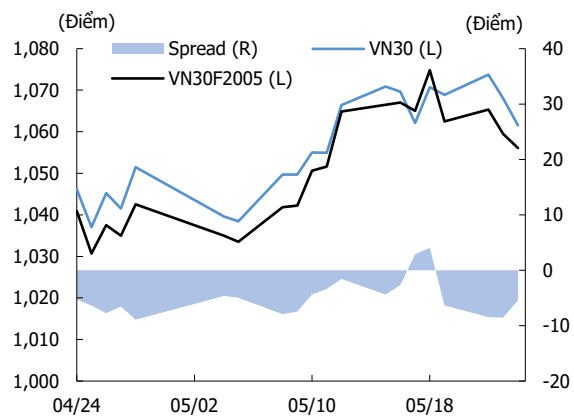
Nguồn: Bloomberg, KIS

Research Dept

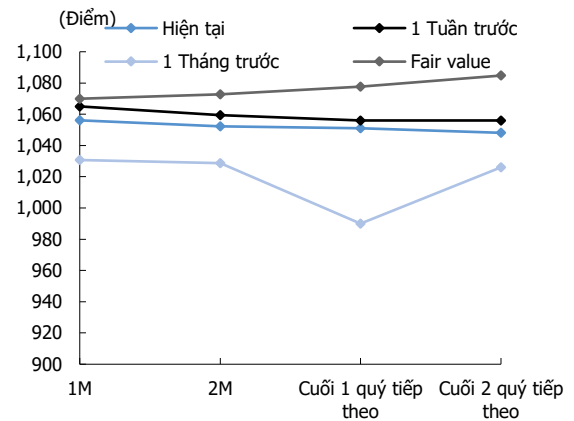
Researchdept@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

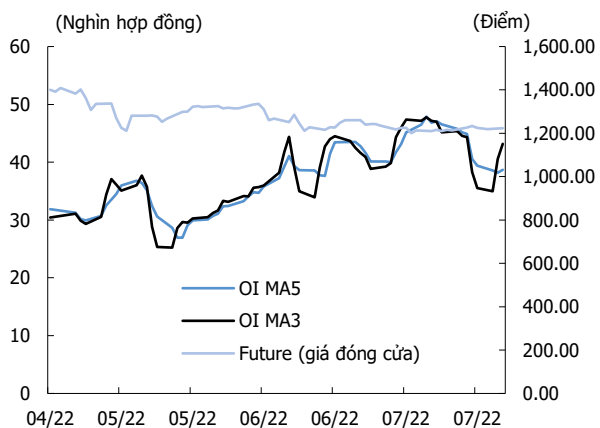
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch

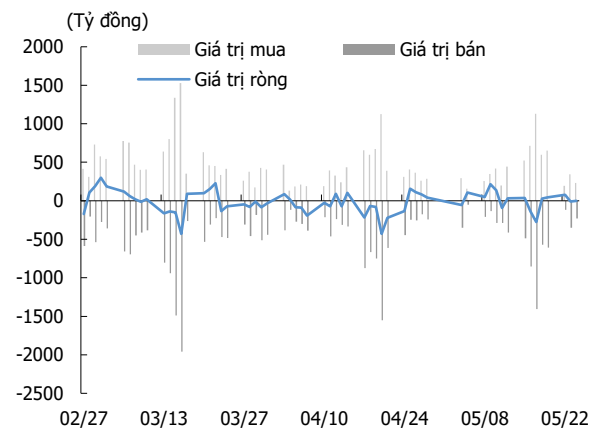
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	84,942	7.03	25,150	(0.8)	5.8	1.36	4,148	30.0	26,500	17,450
BID	BIDV	Tài chính	220,046	0.86	43,500	(0.8)	11.0	2.10	729	17.2	48,000	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	32,996	0.32	44,450	(0.3)	20.5	1.58	312	27.2	60,300	41,200
CTG	VietinBank	Tài chính	133,360	1.95	27,750	(0.5)	7.9	1.19	2,449	27.6	31,250	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	89,782	7.38	81,300	(0.9)	16.0	3.95	655	49.0	98,000	61,300
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	177,040	0.86	92,500	(0.8)	12.1	2.80	261	3.0	134,000	91,600
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	64,400	0.25	16,100	(1.8)	19.3	1.30	2,374	0.5	28,200	9,300
HDB	HDBank	Tài chính	49,048	3.34	19,500	0.0	6.2	1.26	2,186	19.6	21,800	13,050
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	123,855	6.63	21,300	(1.8)	186.5	1.29	18,597	24.5	28,462	11,800
BCM	Becamex IDC Corp	Nguyên vật liệu	79,695	0.31	77,000	0.4	65.8	4.70	73	2.8	101,800	58,200
MBB	MBBank	Tài chính	84,332	4.51	18,600	(0.8)	4.7	1.04	7,565	23.2	23,950	13,200
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	102,223	4.48	71,800	2.0	46.6	3.87	1,057	30.3	121,500	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	55,535	4.05	37,950	(0.8)	20.7	2.32	2,050	49.0	79,000	35,250
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	25,839	1.38	13,250	0.4	36.6	0.70	19,008	6.0	86,800	10,050
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	9,168	0.40	13,650	0.4	10.3	1.12	6,723	2.9	58,700	9,940
PLX	Petrolimex	Năng lượng	47,393	0.46	37,300	(0.5)	26.0	1.89	886	17.9	47,900	22,950
VIB	VIBBank	Tài chính	44,261	2.15	21,000	(1.4)	8.1	1.36	4,026	20.5	27,300	16,200
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,615	0.77	13,500	(1.1)	16.9	1.02	7,863	7.8	16,400	8,910
SAB	SABECO	TD thiết yếu	101,643	1.09	158,500	(0.3)	20.7	4.22	147	62.5	203,000	149,000
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	34,030	2.32	22,700	(0.7)	20.3	1.49	18,464	58	28,855	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	51,655	5.03	27,400	(2.0)	9.1	1.27	16,805	25.7	28,500	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	104,814	6.63	29,800	(1.8)	5.5	0.90	3,594	22.5	39,950	19,300
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	37,171	2.17	23,500	(0.8)	5.8	1.10	3,791	30.0	33,100	18,300
VCB	Vietcombank	Tài chính	438,231	4.69	92,600	(0.2)	14.0	1.40	706	23.5	96,300	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	237,313	5.77	54,500	1.5	6.6	1.51	2,028	24.4	70,500	39,400
VIC	VinGroup	Bất động sản	200,613	5.86	52,600	0.0	79.0	1.76	1,823	12.8	79,500	49,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	53,295	2.59	98,400	(0.3)	30.1	3.52	335	17.6	133,200	94,000
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	138,564	5.39	66,300	(1.0)	19.2	4.40	1,302	55.3	85,600	64,500
VPB	VPBank	Tài chính	130,236	8.87	19,400	(0.8)	10.8	1.31	13,934	17.5	21,733	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	62,830	2.45	27,650	(0.2)	18.4	1.83	2,841	33.3	31,650	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.