

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,165 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua tăng mạnh và chiếm ưu thế với giá trị mua ròng ghi nhận ở mức 310 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu bởi lực cầu trên VHM, SSI, và VNM.

Đồ thị VN30 Future: Đà tăng đột biến

VN30F2307 tiếp tục tăng mạnh và đà tăng vẫn chưa có dấu hiệu suy yếu. Giai đoạn giao động hẹp đã biến mất khi mẫu hình đáy sau cao hơn đáy trước và đỉnh sau cao hơn đỉnh trước đã được xác nhận. Tuy nhiên, giai đoạn điều chỉnh trong phiên khả năng cao sẽ xuất hiện khi hoạt động mua đang duy trì quanh ngưỡng cao. Ngưỡng 1,140 điểm đã bị phá vỡ và sẽ trở thành ngưỡng hỗ trợ trong phiên. Trên đồ thị ngày, hợp đồng này đang được giao dịch trên các đường MA chủ đạo, cho thấy đà tăng và xu hướng tăng vẫn duy trì. Vùng 1,050 điểm là vùng hỗ trợ quan trọng và khó có thể bị phá vỡ trong ngắn hạn, tiếp đến là vùng 1,080 -1,100 điểm. Với các biến động trong phiên, vùng 1,140 điểm nên được giữ vững, tiếp đến là vùng 1,110 điểm. Hợp đồng VN30F2307 khả năng cao sẽ tiếp tục tăng trong tuần giao dịch này.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2307 nên tiếp tục được nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,140 điểm (Đồ thị giờ).

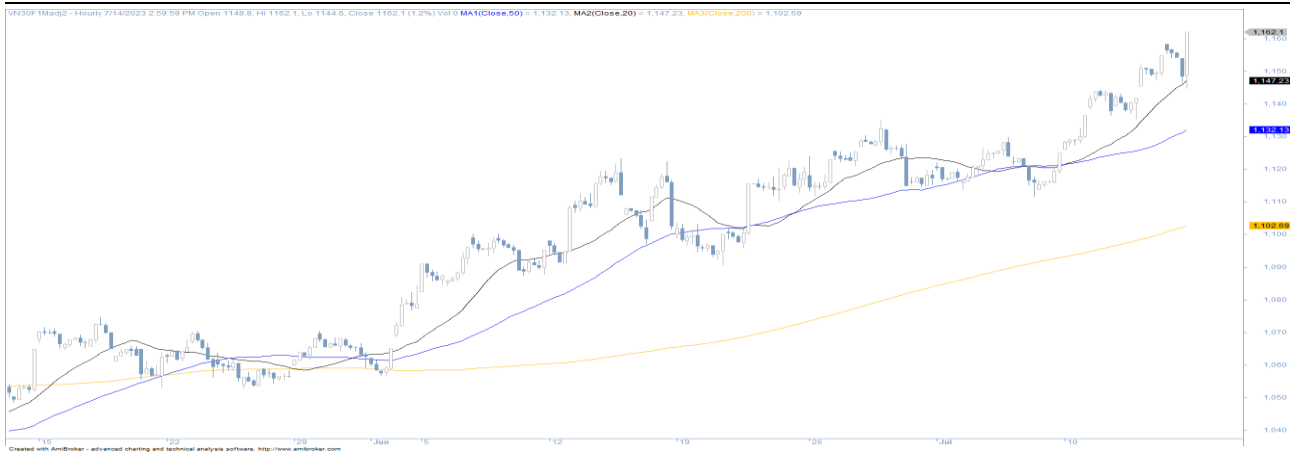
Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	1,164.6	0.3				
VN30F2307	1,161.8	-	136,277	50,701	1,161	20/07/23
VN30F2308	1,160.0	0.4	8,359	14,704	1,163	17/08/23
VN30F2309	1,157.0	0.3	361	614	1,165	21/09/23
VN30F2312	1,147.6	0.6	76	635	1,171	21/12/23

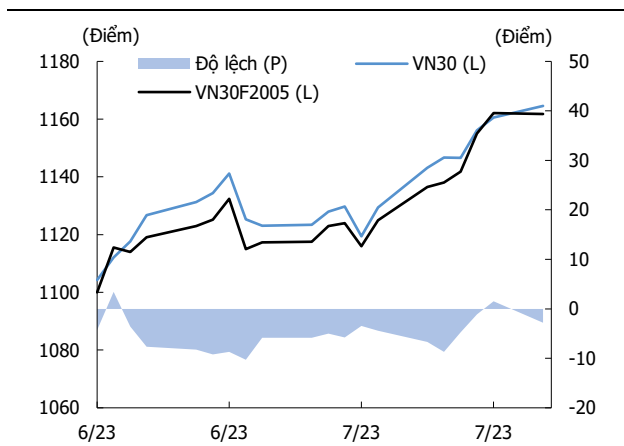
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



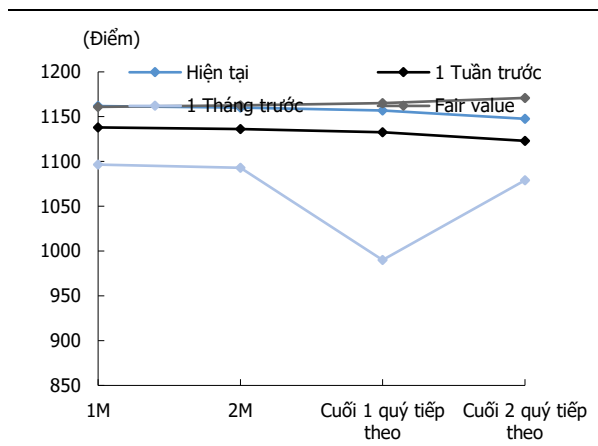
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch



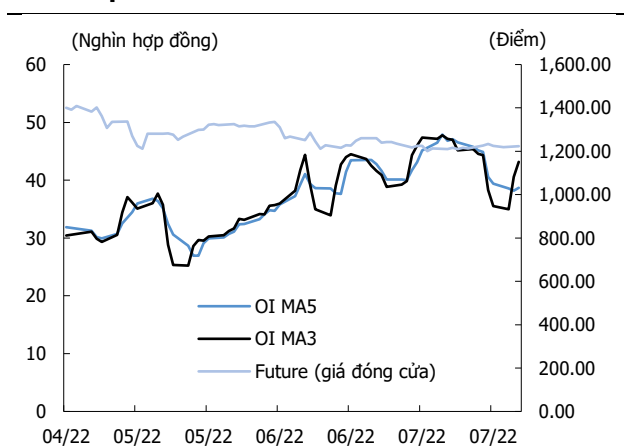
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



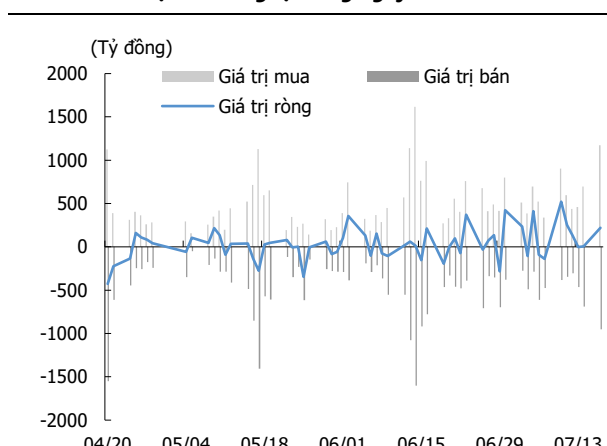
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	85,449	6.44	22,000	0.0	5.9	1.37	7,835	30.0	23,043	15,174
BID	BIDV	Tài chính	233,704	0.83	46,200	(1.2)	11.7	2.23	1,032	17.1	48,000	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	35,112	0.31	47,300	1.1	21.8	1.68	756	27.0	60,300	41,200
CTG	VietinBank	Tài chính	142,731	1.90	29,700	(0.7)	8.4	1.27	4,472	27.2	31,250	19,500
FPT	FPT Corp	CNTT	100,328	7.56	79,000	0.9	17.9	4.41	991	49.0	79,200	53,304
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	189,481	0.84	99,000	0.0	13.0	3.00	536	2.9	120,000	91,600
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	88,000	0.31	22,000	1.9	26.4	1.77	3,336	0.5	27,350	9,300
HDB	HDBank	Tài chính	47,538	2.95	18,900	0.0	6.0	1.22	2,078	19.5	21,800	13,050
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	158,744	7.74	27,300	(0.7)	239.1	1.65	20,222	26.0	28,050	11,800
BCM	Becamex IDC Corp	Nguyên vật liệu	82,800	0.29	80,000	(1.1)	68.4	4.88	186	2.7	101,800	61,000
MBB	MBBank	Tài chính	96,982	4.73	18,600	(0.3)	5.4	1.20	11,141	23.2	20,826	11,478
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	115,469	4.58	80,700	(1.3)	52.4	4.35	1,170	30.2	117,000	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	71,175	4.73	48,650	(1.6)	26.5	2.97	3,314	49.0	75,400	35,250
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	29,934	1.46	15,350	1.3	42.4	0.81	27,277	3.4	86,800	10,050
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	13,097	0.52	19,500	3.2	14.7	1.60	11,767	2.9	58,700	9,940
PLX	Petrolimex	Năng lượng	52,031	0.46	40,950	0.1	28.5	2.08	863	17.7	44,400	22,950
VIB	VIBBank	Tài chính	51,751	2.29	20,400	0.7	8.1	1.58	6,426	20.5	22,750	13,500
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,264	0.69	13,350	0.4	16.7	1.01	6,741	7.3	14,750	8,910
SAB	SABECO	TD thiết yếu	98,437	0.96	153,500	(0.2)	20.1	4.09	138	62.3	203,000	150,000
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	43,175	2.68	28,800	1.1	25.7	1.89	19,148	58	29,200	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	52,786	4.68	28,000	(3.4)	9.3	1.30	16,406	24.8	30,650	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	112,200	6.47	31,900	(0.2)	5.9	0.96	3,968	22.5	39,950	19,300
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	40,180	2.14	18,250	0.6	6.3	1.19	5,257	29.2	21,050	13,148
VCB	Vietcombank	Tài chính	495,968	4.84	104,800	(0.2)	14.0	1.40	738	23.5	106,400	62,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	256,908	5.69	59,000	4.6	7.1	1.63	1,657	24.0	63,100	39,400
VIC	VinGroup	Bất động sản	201,757	5.37	52,900	2.9	79.0	1.77	1,996	13.0	74,500	49,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	52,699	2.34	97,300	(0.6)	30.1	3.48	654	17.5	129,200	92,900
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	151,104	5.36	72,300	(1.4)	20.9	4.80	3,291	53.8	85,600	65,500
VPB	VPBank	Tài chính	137,285	8.52	20,450	2.8	11.4	1.38	12,526	16.9	21,733	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	65,102	2.31	28,650	2.3	19.0	1.89	3,830	32.2	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.