

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,194 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng mạnh và chiếm ưu thế với giá trị bán ròng ghi nhận ở mức 750 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu bởi lực bán trên CTG, MWG, và HPG.

Đò thị VN30 Future: Xu hướng tăng chứng lại

Áp lực bán đã hạn nhiệt trên VN30F2309 nhưng xu hướng tăng vẫn chưa thể trở lại. Bên cạnh đó, Bollinger bands đã dần co hẹp, điều này hàm ý cho sự suy yếu của xu hướng tăng. Giai đoạn điều chỉnh đã xuất hiện khi hợp đồng này rơi vào vùng quá mua. Tuy nhiên, các đường MA chủ đạo duy trì chuyển động hướng ngang, áp lực bán khó có thể kéo dài trong ngắn hạn và giai đoạn biến động sẽ xuất hiện. Ngưỡng 1,180-1,200 điểm đã bị phá vỡ và sẽ trở thành ngưỡng hỗ trợ trong tuần. Đáng chú ý, hợp đồng này đang kiểm định đường MA trung hạn (MA50), điều này hàm ý rằng áp lực bán đã đạt đến cực đại trong ngắn hạn và đảo chiều xu hướng giảm vẫn chưa được xác nhận khi đường MA50 chưa bị phá vỡ. Mặc dù xu hướng giảm vẫn chưa được xác nhận nhưng xu hướng tăng đã hoàn toàn bị chứng lại. Hợp đồng VN30F2309 sẽ duy trì dao động quanh vùng 1,180-1,260 điểm. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy.

Chiến lược đầu tư

Mặc dù xu hướng giảm vẫn chưa được xác nhận nhưng xu hướng tăng đã hoàn toàn bị chứng lại. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

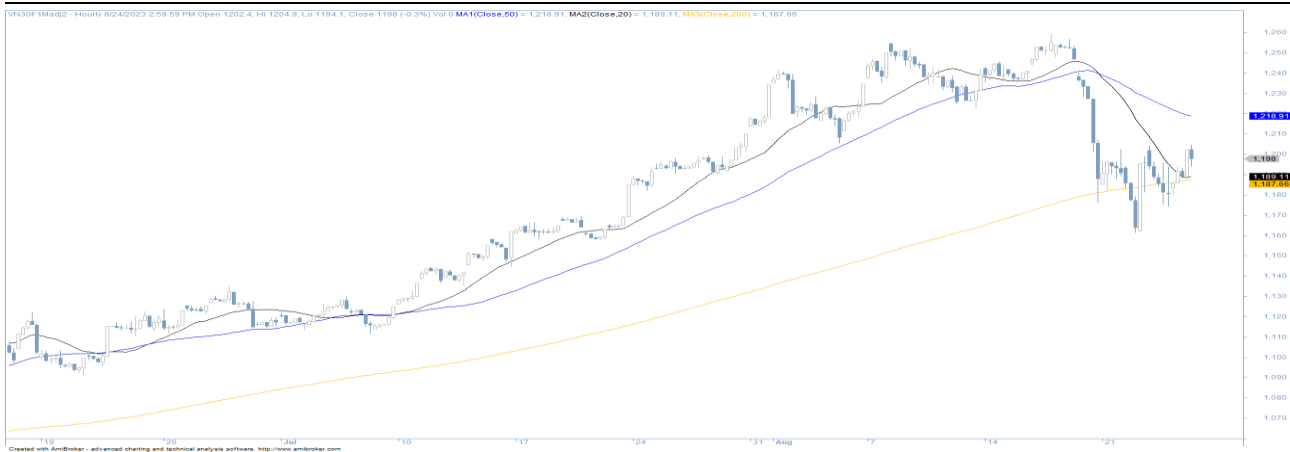
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	1,193.9	(0.7)				
VN30F2309	1,194.5	(0.3)	264,401	50,159	1,204	21/09/23
VN30F2310	1,193.0	(0.5)	811	1,204	1,205	19/10/23
VN30F2312	1,190.6	(0.5)	55	595	1,209	21/12/23
VN30F2403	1,182.6	(0.5)	54	235	1,215	21/03/24

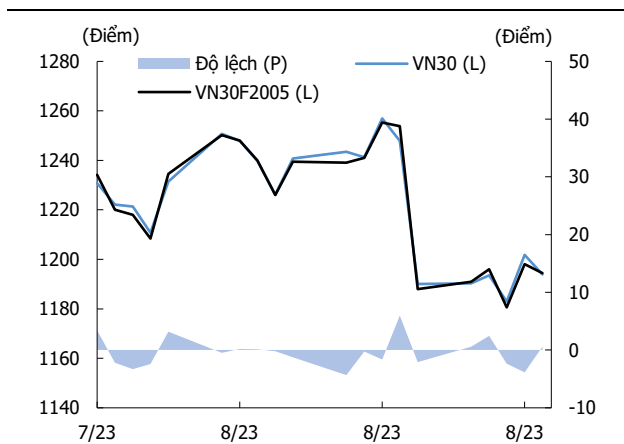
Nguồn: Bloomberg, KIS

Research Dept

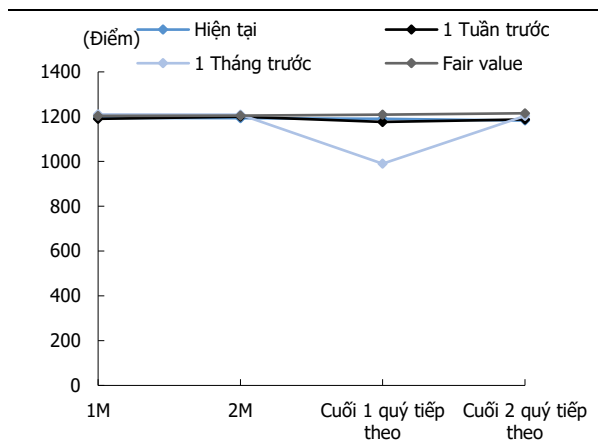
Researchdept@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

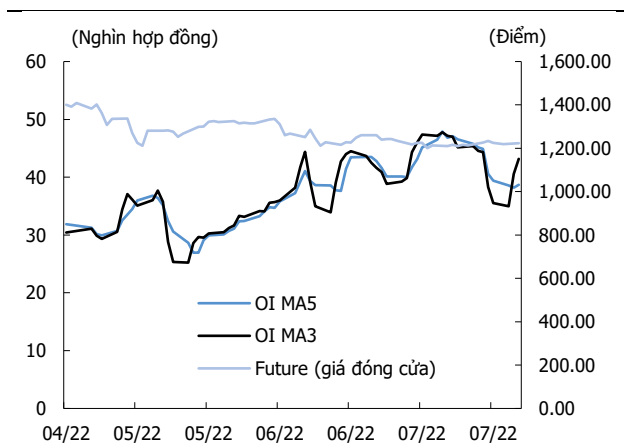
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch

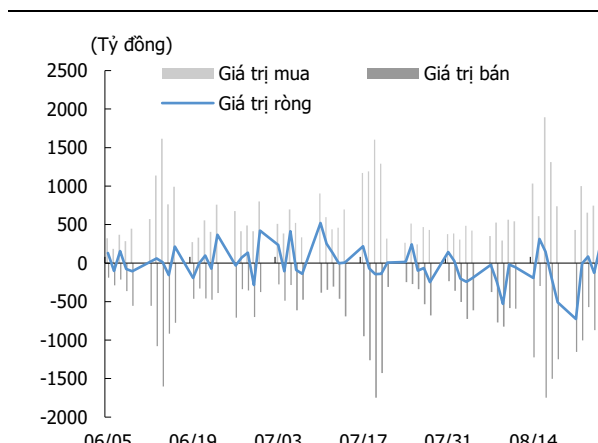
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	ACB	Tài chính	85,255	6.00	21,950	(0.5)	5.9	1.36	10,244	30.0	24,400	15,174
BCM	Becamex IDC	Tài chính	68,828	0.23	66,500	(0.7)	171.6	4.04	254	2.6	101,800	65,800
BID	BIDV	Tài chính	228,645	0.76	45,200	(1.3)	11.2	2.09	1,592	17.2	49,500	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	33,330	0.28	44,900	(1.1)	19.8	1.57	953	26.6	60,300	41,200
CTG	VietinBank	CNTT	149,699	1.86	31,150	(1.9)	8.6	1.28	6,335	27.6	32,900	19,500
FPT	FPT Corp	Dịch vụ tiện ích	115,059	8.10	90,600	0.7	19.6	4.76	1,394	49.0	91,000	53,304
GAS	PV Gas	Nguyên vật liệu	194,075	0.80	101,400	(1.0)	15.2	2.94	611	2.9	120,000	91,600
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Tài chính	78,600	0.26	19,650	(0.8)	27.4	1.58	3,312	0.5	27,350	9,300
HDB	HDBank	Nguyên vật liệu	47,004	2.72	16,250	0.3	5.9	1.22	2,931	19.9	18,957	11,348
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	150,894	6.87	25,950	(1.3)	7.4	1.54	24,645	26.1	28,700	11,800
MBB	MBBank	Tài chính	94,375	4.30	18,100	(0.8)	5.2	1.15	11,950	23.2	20,826	11,478
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	114,038	4.25	79,700	(0.4)	86.5	4.28	1,716	30.1	117,000	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	73,859	4.59	50,500	0.4	47.3	3.18	5,335	48.8	75,400	35,250
PLX	Petrolimex	Bất động sản	47,711	0.39	37,550	(0.7)	18.4	1.93	1,299	17.2	43,500	22,950
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Bất động sản	29,273	0.61	12,500	(0.8)	18.5	0.94	9,306	6.1	14,750	8,910
SAB	SABECO	Năng lượng	100,168	0.91	156,200	1.8	22.8	4.14	181	62.2	203,000	150,000
SHB	SHB	Tài chính	43,246	2.86	11,950	(1.2)	8.1	0.91	26,325	6.9	13,600	6,072
SSB	SeABank	Dịch vụ tiện ích	69,194	3.44	28,200	(0.9)	20.1	2.50	1,026	0.3	31,300	23,075
SSI	Chứng khoán SSI	TD thiết yếu	48,272	2.80	32,200	0.6	29.4	2.21	21,059	45	32,500	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	58,630	4.85	31,100	(1.4)	8.6	1.40	21,276	23.7	32,900	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	118,355	6.37	33,650	(0.4)	6.6	0.98	5,385	22.5	39,150	19,300
TPB	TPBank	Tài chính	41,501	2.06	18,850	0.3	7.0	1.34	7,241	29.4	20,476	13,148
VCB	Vietcombank	Tài chính	481,780	4.39	86,200	(0.9)	14.9	3.17	1,095	23.5	93,700	52,498
VHM	Vinhomes	Tài chính	235,571	4.87	54,100	(2.3)	14.0	1.40	2,996	24.3	66,200	39,400
VIB	VIBBank	Bất động sản	49,721	2.06	19,600	(0.8)	5.6	1.47	6,156	20.5	21,700	13,500
VIC	VinGroup	Bất động sản	242,185	6.01	63,500	(1.1)	79.0	2.09	6,175	13.2	76,600	49,700
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	52,536	2.17	97,000	(0.5)	30.1	3.43	839	17.6	122,800	92,900
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	156,538	5.18	74,900	0.3	21.3	4.68	4,088	54.7	85,600	65,500
VPB	VPBank	Tài chính	135,607	7.86	20,200	(1.5)	11.7	1.32	17,378	16.3	23,000	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	65,216	2.16	28,700	(1.2)	17.9	1.84	5,718	32.6	32,000	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.