

Nắm giữ vị thế bán

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,124 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán tăng mạnh và chiếm ưu thế với giá trị bán ròng ghi nhận ở mức 360 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu bởi lực bán trên VNM, CTG, và MWG.

Đồ thị VN30 Future: Phá vỡ ngưỡng 1,160 điểm

Áp lực bán tăng mạnh, hợp đồng VN30F2310 đóng cửa dưới các đường MA chủ đạo, phá vỡ ngưỡng 1,160 điểm và xu hướng tăng đã hoàn toàn biến mất. Các đường MA chủ đạo di chuyển hướng xuống, điều này hàm ý rằng đà giảm đang hiện hữu và xu hướng tăng đã hoàn toàn biến mất. Áp lực bán quanh vùng 1,160 điểm vẫn duy trì và chưa được hấp thụ hoàn toàn, do vậy vùng này sẽ là vùng kháng cự quan trọng. Tín hiệu mua đã hoàn toàn biến mất trong giai đoạn này. Mặc dù ngưỡng quá bán đã được xác nhận và độ biến động đang ở mức cao nhưng áp lực bán quanh vùng 1,160 điểm vẫn duy trì và ngưỡng này sẽ là ngưỡng kháng cự mạnh. Do vậy, vị thế bán mới có thể mở.

Chiến lược đầu tư

Vị thế bán trên VN30F2310 nên được nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa trên 1,160 điểm (Đồ thị giờ).

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

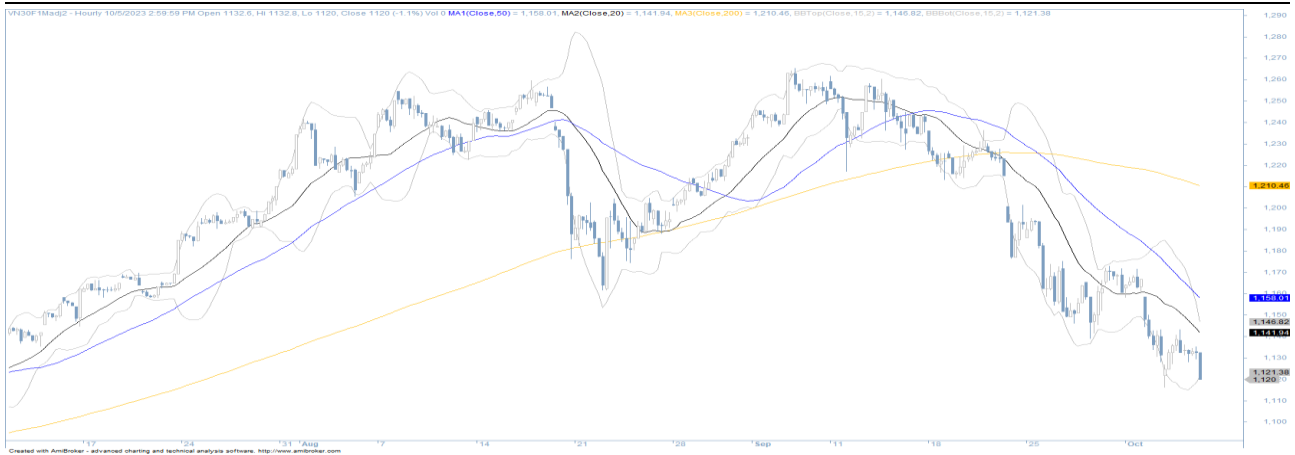
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	1,124.5	(1.1)				
VN30F2310	1,120.0	(1.1)	250,256	45,818	1,139	19/10/23
VN30F2311	1,124.0	(0.9)	649	1,855	1,141	16/11/23
VN30F2312	1,117.0	(1.5)	116	586	1,143	21/12/23
VN30F2403	1,115.0	(1.0)	53	326	1,149	21/03/24

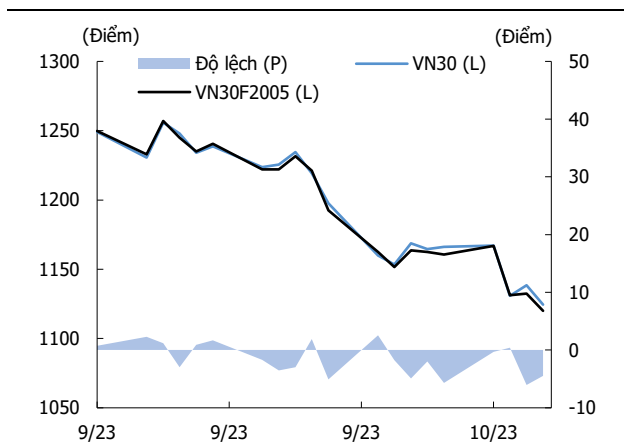
Nguồn: Bloomberg, KIS

Research Dept

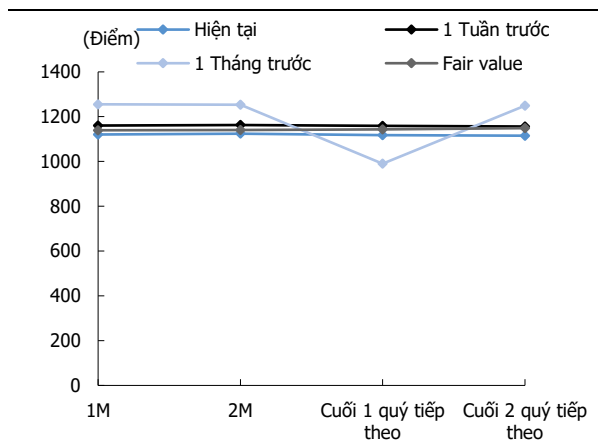
Researchdept@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

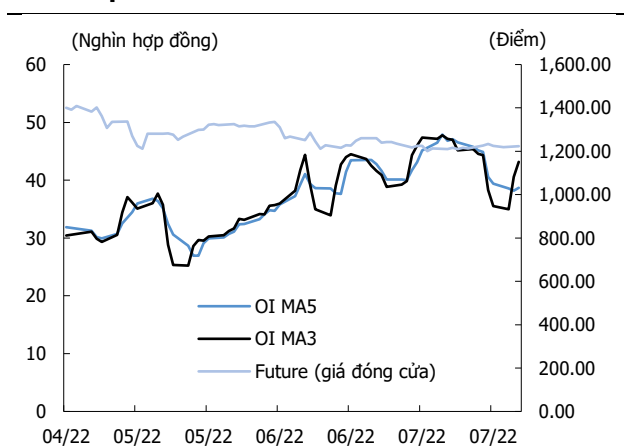
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch

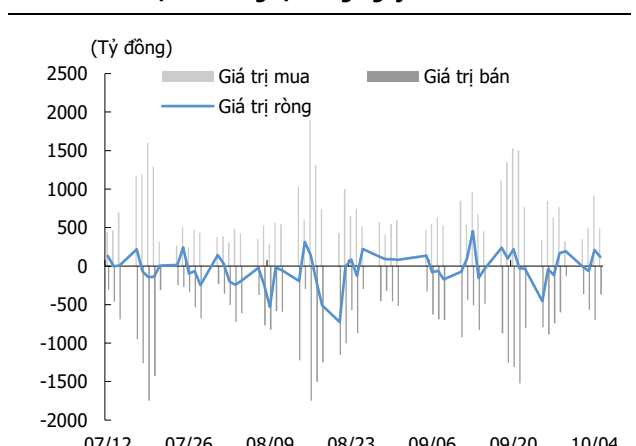
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	83,895	6.27	21,600	0.0	5.8	1.33	8,538	30.0	24,400	15,174
BCM	Becamex IDC	Tài chính	71,312	0.25	68,900	(0.1)	207.4	4.21	266	2.3	90,000	64,000
BID	BIDV	Tài chính	210,435	0.74	41,600	(2.1)	10.4	1.92	1,616	17.2	49,500	28,000
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	31,103	0.27	41,900	(0.4)	18.5	1.46	851	26.4	53,700	41,200
CTG	VietinBank	CNTT	135,042	1.78	28,100	(2.8)	7.7	1.15	6,920	27.3	33,650	19,500
FPT	FPT Corp	Dịch vụ tiện ích	116,329	8.69	91,600	(1.0)	19.9	4.82	2,020	49.0	100,800	53,304
GAS	PV Gas	Nguyên vật liệu	193,385	0.85	84,200	(1.9)	15.2	2.93	707	2.5	100,000	76,333
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Tài chính	79,200	0.28	19,800	1.5	27.6	1.60	3,249	0.3	23,700	9,300
HDB	HDBank	Nguyên vật liệu	49,029	3.02	16,950	(0.9)	6.1	1.27	4,907	19.9	18,050	11,348
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	144,788	7.00	24,900	(1.4)	7.4	1.48	27,082	25.0	29,400	11,800
MBB	MBBank	Tài chính	94,114	4.55	18,050	(0.6)	5.2	1.15	11,396	23.2	19,700	11,478
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	104,165	4.12	72,800	(1.0)	79.0	3.91	2,026	29.8	110,000	69,100
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	68,740	4.53	47,000	(4.5)	44.0	2.96	7,047	48.4	62,300	35,250
PLX	Petrolimex	Bất động sản	43,708	0.38	34,400	(5.1)	16.4	1.76	1,435	17.3	42,200	22,950
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Bất động sản	25,526	0.56	10,900	(3.1)	16.2	0.82	9,273	5.4	14,200	8,910
SAB	SABECO	Năng lượng	89,138	0.86	69,500	(0.7)	20.3	3.68	502	30.9	101,500	69,300
SHB	SHB	Tài chính	37,998	2.67	10,500	(1.4)	8.1	0.80	21,684	6.2	13,600	6,072
SSB	SeABank	Dịch vụ tiện ích	60,116	3.17	24,500	0.2	17.5	2.17	1,265	0.2	31,300	23,075
SSI	Chứng khoán SSI	TD thiết yếu	47,448	2.92	31,650	(0.3)	28.9	2.17	25,602	45	37,000	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	56,368	4.95	29,900	(1.0)	8.3	1.35	23,928	22.4	33,700	14,050
TCB	Techcombank	Tài chính	111,848	6.39	31,800	(1.4)	6.3	0.92	5,716	22.5	36,150	19,300
TPB	TPBank	Tài chính	36,437	1.92	16,550	(0.3)	6.1	1.18	7,854	29.9	20,100	13,148
VCB	Vietcombank	Tài chính	472,278	4.57	84,500	(2.1)	14.6	3.11	1,279	23.5	93,700	52,498
VHM	Vinhomes	Tài chính	193,987	4.26	44,550	(0.1)	14.0	1.40	5,126	24.2	66,200	39,400
VIB	VIBBank	Bất động sản	46,931	2.06	18,500	(2.1)	5.2	1.38	5,433	20.5	22,000	13,500
VIC	VinGroup	Bất động sản	173,915	4.59	45,600	(1.1)	79.0	1.50	11,705	12.9	76,600	43,850
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	51,724	2.27	95,500	(1.3)	30.1	3.48	990	17.5	118,000	92,900
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	151,940	5.34	72,700	(2.3)	20.7	4.54	3,530	55.2	85,600	65,500
VPB	VPBank	Tài chính	140,263	8.59	20,800	(1.0)	12.0	1.36	18,337	16.5	23,000	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	60,898	2.14	26,800	(0.7)	16.7	1.72	6,233	33.4	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.