

Lực cầu vẫn ở mức thấp

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,140 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua tăng mạnh và chiếm ưu thế với giá trị mua ròng ghi nhận ở mức 50 tỷ đồng, dẫn dắt chủ yếu bởi lực cầu trên VNM, STB, và HPG.

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)

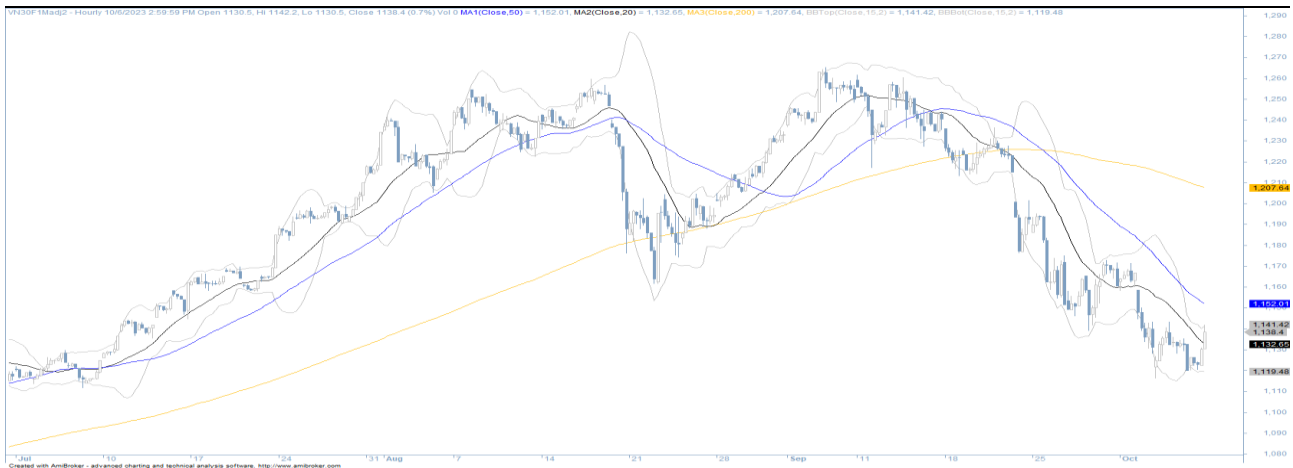
| | Giá đóng cửa | +/- % | KL giao dịch | KL Mở | Fair Value | Ngày thanh toán |
|------------|--------------|-------|--------------|--------|------------|-----------------|
| VN30 Index | 1,139.8 | 1.5 | | | | |
| VN30F2310 | 1,138.4 | 1.6 | 240,680 | 46,607 | 1,125 | 19/10/23 |
| VN30F2311 | 1,124.0 | - | 1,292 | 2,370 | 1,127 | 16/11/23 |
| VN30F2312 | 1,131.5 | 1.3 | 84 | 594 | 1,129 | 21/12/23 |
| VN30F2403 | 1,134.0 | 1.7 | 79 | 321 | 1,134 | 21/03/24 |

Nguồn: Bloomberg, KIS

Research Dept

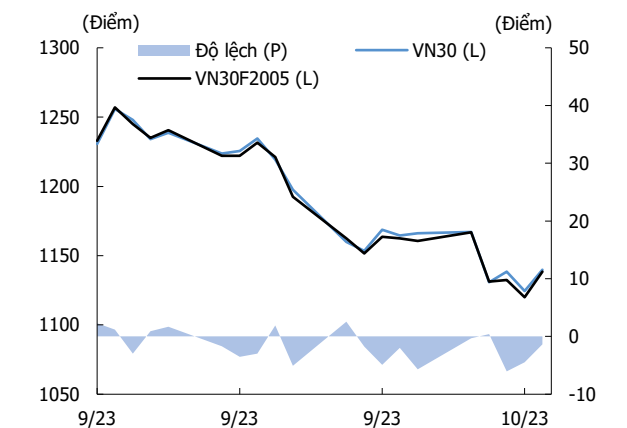
Researchdept@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



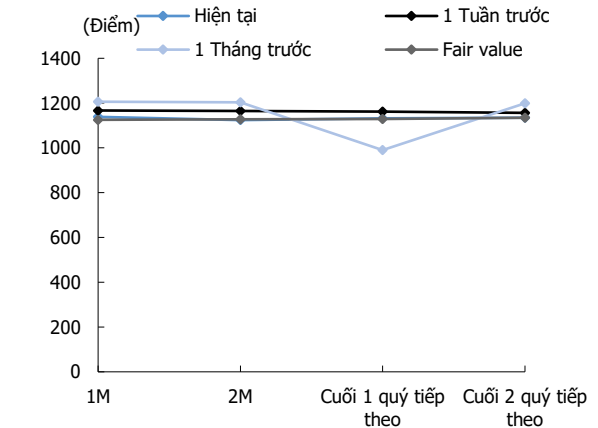
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch



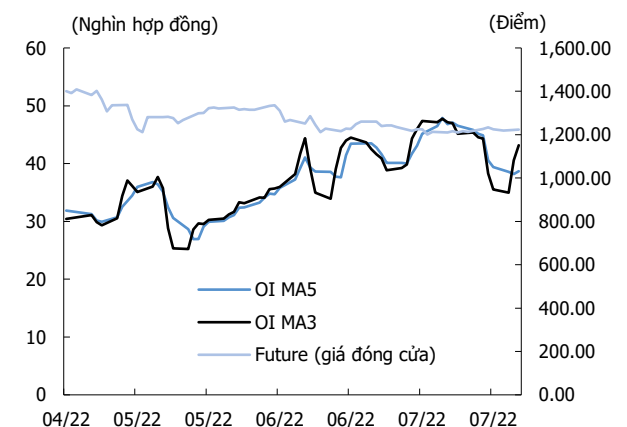
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



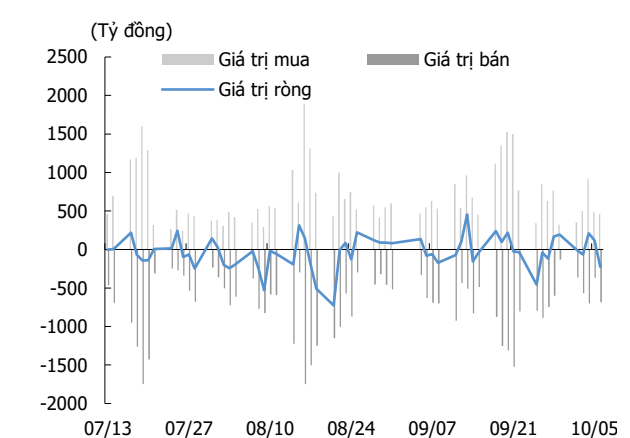
Nguồn: Bloomberg, KIS

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 | 84,672 | 6.24 | 21,800 | 0.9 | 5.9 | 1.35 | 8,451 | 30.0 | 24,400 | 15,174 |
| BCM | Becamex IDC | Tài chính | 71,933 | 0.25 | 69,500 | 0.9 | 209.2 | 4.25 | 264 | 2.3 | 87,500 | 64,000 |
| BID | BIDV | Tài chính | 213,470 | 0.74 | 42,200 | 1.4 | 10.5 | 1.95 | 1,605 | 17.2 | 49,500 | 28,000 |
| BVH | Tập đoàn Bảo Việt | Tài chính | 31,103 | 0.27 | 41,900 | 0.0 | 18.5 | 1.46 | 846 | 26.4 | 53,700 | 41,200 |
| CTG | VietinBank | CNTT | 137,925 | 1.79 | 28,700 | 2.1 | 7.9 | 1.18 | 6,913 | 27.2 | 33,650 | 19,500 |
| FPT | FPT Corp | Dịch vụ tiện ích | 117,726 | 8.68 | 92,700 | 1.2 | 20.1 | 4.87 | 2,011 | 49.0 | 100,800 | 53,304 |
| GAS | PV Gas | Nguyên vật liệu | 193,385 | 0.84 | 84,200 | 0.0 | 15.2 | 2.93 | 705 | 2.5 | 100,000 | 76,333 |
| GVR | Tập đoàn CN Cao su VN | Tài chính | 80,800 | 0.28 | 20,200 | 2.0 | 28.1 | 1.63 | 3,209 | 0.3 | 23,700 | 9,300 |
| HDB | HDBank | Nguyên vật liệu | 49,463 | 3.00 | 17,100 | 0.9 | 6.2 | 1.28 | 4,975 | 19.9 | 18,050 | 11,348 |
| HPG | Hòa Phát | Nguyên vật liệu | 145,079 | 6.92 | 24,950 | 0.2 | 7.4 | 1.48 | 26,828 | 25.0 | 29,400 | 11,800 |
| MBB | MBBank | Tài chính | 94,636 | 4.51 | 18,150 | 0.6 | 5.2 | 1.15 | 11,241 | 23.2 | 19,700 | 11,478 |
| MSN | Tập đoàn Masan | TD thiết yếu | 104,022 | 4.06 | 72,700 | (0.1) | 78.9 | 3.91 | 2,041 | 29.7 | 110,000 | 69,100 |
| MWG | Thế giới di động | TD không thiết yếu | 70,642 | 4.59 | 48,300 | 2.8 | 45.3 | 3.04 | 7,015 | 48.3 | 60,500 | 35,250 |
| PLX | Petrolimex | Bất động sản | 44,471 | 0.39 | 35,000 | 1.7 | 16.7 | 1.79 | 1,435 | 17.3 | 42,200 | 22,950 |
| POW | Điện lực Dầu khí Việt Nam | Bất động sản | 26,229 | 0.57 | 11,200 | 2.8 | 16.6 | 0.85 | 9,277 | 5.3 | 14,200 | 8,910 |
| SAB | SABECO | Năng lượng | 89,266 | 0.85 | 69,600 | 0.1 | 20.3 | 3.69 | 505 | 30.9 | 101,500 | 68,300 |
| SHB | SHB | Tài chính | 38,722 | 2.69 | 10,700 | 1.9 | 8.1 | 0.81 | 21,547 | 6.2 | 13,600 | 6,072 |
| SSB | SeABank | Dịch vụ tiện ích | 60,116 | 3.13 | 24,500 | 0.0 | 17.5 | 2.17 | 1,274 | 0.2 | 31,300 | 23,075 |
| SSI | Chứng khoán SSI | TD thiết yếu | 49,397 | 3.00 | 32,950 | 4.1 | 30.1 | 2.26 | 25,765 | 45 | 37,000 | 13,050 |
| STB | Sacombank | Tài chính | 58,347 | 5.06 | 30,950 | 3.5 | 8.6 | 1.40 | 23,906 | 22.3 | 33,700 | 14,050 |
| TCB | Techcombank | Tài chính | 112,727 | 6.35 | 32,050 | 0.8 | 6.3 | 0.93 | 5,689 | 22.5 | 36,150 | 19,300 |
| TPB | TPBank | Tài chính | 36,987 | 1.92 | 16,800 | 1.5 | 6.2 | 1.19 | 7,862 | 29.8 | 20,100 | 13,148 |
| VCB | Vietcombank | Tài chính | 477,308 | 4.55 | 85,400 | 1.1 | 14.7 | 3.14 | 1,274 | 23.5 | 93,700 | 52,498 |
| VHM | Vinhomes | Tài chính | 200,519 | 4.35 | 46,050 | 3.4 | 14.0 | 1.40 | 5,154 | 24.2 | 66,200 | 39,400 |
| VIB | VIBBank | Bất động sản | 47,438 | 2.06 | 18,700 | 1.1 | 5.3 | 1.40 | 5,367 | 20.5 | 22,000 | 13,500 |
| VIC | VinGroup | Bất động sản | 175,250 | 4.56 | 45,950 | 0.8 | 79.0 | 1.52 | 11,762 | 12.9 | 76,600 | 43,850 |
| VJC | Vietjet Air | Công nghiệp | 52,536 | 2.28 | 97,000 | 1.6 | 30.1 | 3.54 | 989 | 17.5 | 118,000 | 92,900 |
| VNM | VINAMILK | TD thiết yếu | 155,075 | 5.38 | 74,200 | 2.1 | 21.1 | 4.63 | 3,446 | 55.2 | 85,600 | 65,500 |
| VPB | VPBank | Tài chính | 141,275 | 8.54 | 20,950 | 0.7 | 12.1 | 1.37 | 18,150 | 16.4 | 23,000 | 13,650 |
| VRE | Vincom Retail | Bất động sản | 62,375 | 2.16 | 27,450 | 2.4 | 17.1 | 1.76 | 6,175 | 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.