

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,113 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 STB, VHM, và HPG.

Đò thị VN30 Future: Kiểm định lại vùng 1,100 điểm

Áp lực bán giảm hợp đồng VN30F2311 khi hợp đồng này kiểm định đường MA200. Tuy nhiên, xu hướng tăng vẫn chưa thể trở lại. 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. Các mẫu nền giảm xuất hiện đã làm suy yếu đà phục hồi và rủi ro nắm giữ vị thế mua gia tăng. Tuy nhiên, trong phiên giao dịch trước, lực cầu đã dần quay trở lại khi hợp đồng này kiểm định lại đường MA200. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy hơn.

Chiến lược đầu tư

Tín hiệu mua đã hoàn toàn biến mất trong giai đoạn này. Các mẫu nền giảm xuất hiện đã làm suy yếu đà phục hồi và rủi ro nắm giữ vị thế mua gia tăng. Bên cạnh đó, MA200 đang được kiểm định và vị thế bán mới sẽ rất rủi ro. Do vậy, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ tín hiệu tin cậy hơn.

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	1,113.3	(0.3)				
VN30F2311	1,109.2	(0.3)	242,088	49,333	1,119	16/11/23
VN30F2312	1,113.6	0.4	501	1,346	1,121	21/12/23
VN30F2403	1,106.4	(0.3)	470	361	1,127	21/03/24
VN30F2406	1,101.0	(0.4)	97	73	1,132	20/06/24

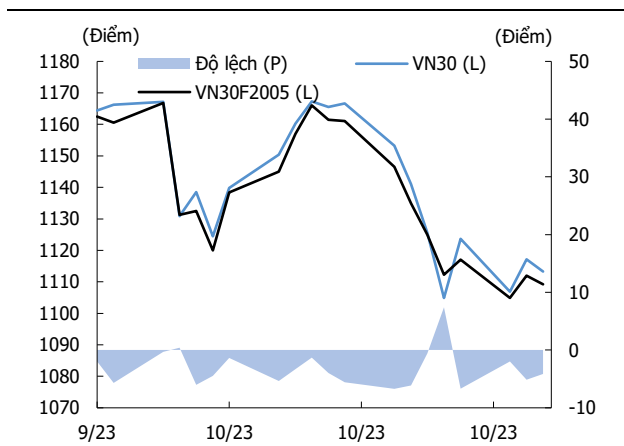
Nguồn: Bloomberg, KIS

Research Dept

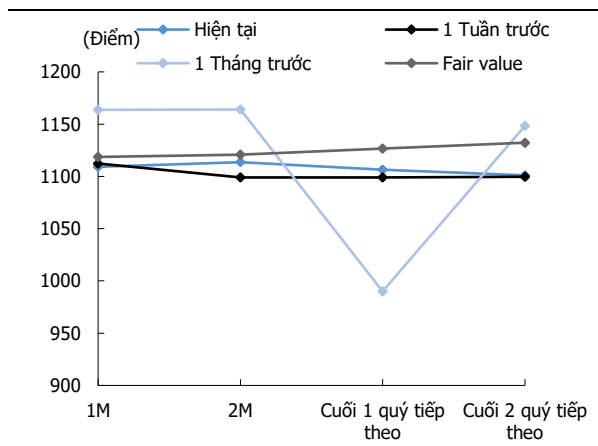
Researchdept@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

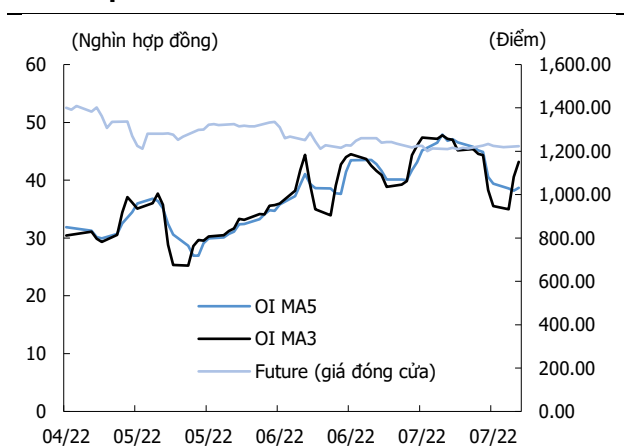
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Continuous Adjustment

Hình 2. Độ lệch

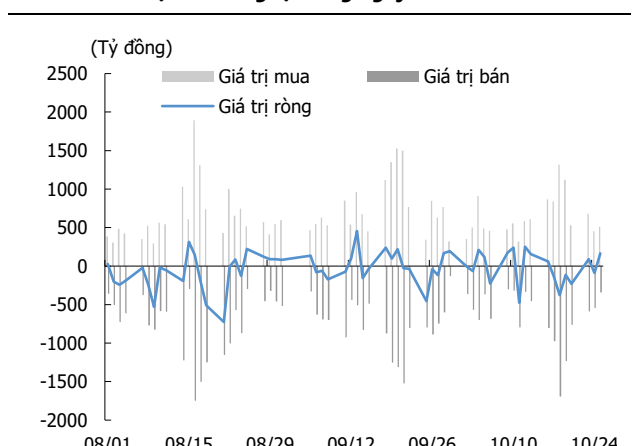
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	85,061	6.42	21,900	0.0	5.7	1.27	7,946	30.0	24,400	15,565
BCM	Becamex IDC	Tài chính	64,791	0.23	62,600	(1.3)	188.4	3.83	238	2.3	86,000	61,700
BID	BIDV	Tài chính	206,135	0.73	40,750	(1.3)	10.1	1.88	1,387	17.2	49,500	31,300
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	30,324	0.27	40,850	0.2	18.1	1.43	660	26.5	53,700	40,150
CTG	VietinBank	CNTT	139,367	1.86	29,000	(1.7)	8.0	1.19	6,031	27.2	33,650	22,000
FPT	FPT Corp	Dịch vụ tiện ích	115,440	8.71	90,900	(1.2)	18.8	4.88	2,340	49.0	100,800	53,304
GAS	PV Gas	Nguyên vật liệu	184,658	0.82	80,400	(1.0)	14.5	2.80	644	2.4	100,000	76,333
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Tài chính	82,000	0.29	20,500	0.2	28.5	1.65	3,222	0.3	23,700	9,300
HDB	HDBank	Nguyên vật liệu	50,620	3.15	17,500	(0.3)	6.3	1.31	5,924	19.8	18,050	11,348
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	139,846	6.83	24,050	0.2	7.1	1.43	26,138	24.9	29,400	11,800
MBB	MBBank	Tài chính	92,811	4.53	17,800	(0.6)	5.1	1.13	9,721	23.2	19,700	11,478
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	94,436	3.77	66,000	(1.3)	71.6	3.55	1,937	29.4	110,000	64,900
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	63,621	4.24	43,500	1.2	40.8	2.74	7,396	47.5	59,300	35,250
PLX	Petrolimex	Bất động sản	44,915	0.40	35,350	(0.4)	16.8	1.81	1,282	17.2	42,200	22,950
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Bất động sản	26,229	0.58	11,200	0.0	16.6	0.85	8,607	4.7	14,200	8,910
SAB	SABECO	Năng lượng	88,753	0.87	69,200	0.1	20.2	3.67	527	61.9	99,500	67,500
SHB	SHB	Tài chính	38,179	2.71	10,550	(0.5)	8.1	0.80	18,436	6.1	13,600	6,072
SSB	SeABank	Dịch vụ tiện ích	63,551	3.38	25,900	0.4	18.4	2.29	1,344	0.1	31,300	23,075
SSI	Chứng khoán SSI	TD thiết yếu	46,173	2.87	30,800	(0.8)	22.9	2.05	26,373	45	37,000	13,050
STB	Sacombank	Tài chính	55,708	4.95	29,550	(1.5)	8.2	1.33	21,517	23.5	33,700	14,450
TCB	Techcombank	Tài chính	109,738	6.33	31,200	(0.5)	6.4	0.87	5,210	22.5	36,150	19,300
TPB	TPBank	Tài chính	36,877	1.96	16,750	(0.3)	6.7	1.14	7,166	29.8	20,100	13,183
VCB	Vietcombank	Tài chính	479,544	4.68	85,800	(0.2)	14.8	3.16	1,240	23.5	93,700	58,002
VHM	Vinhomes	Tài chính	195,511	4.34	44,900	0.7	14.0	1.40	5,348	25.0	66,200	39,400
VIB	VIBBank	Bất động sản	46,424	2.06	18,300	(1.1)	5.2	1.37	4,965	20.5	22,000	13,500
VIC	VinGroup	Bất động sản	170,483	4.54	44,700	2.9	79.0	1.36	12,356	12.8	76,600	41,500
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	55,678	2.47	102,800	(0.8)	30.1	3.75	987	17.5	118,000	92,900
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	144,207	5.12	69,000	(1.8)	19.6	4.31	2,956	55.2	85,600	65,500
VPB	VPBank	Tài chính	166,612	8.76	21,000	(0.2)	13.7	1.34	16,962	13.7	23,150	13,650
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	60,103	2.13	26,450	(0.6)	14.4	1.64	5,212	33.4	32,000	22,200

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.