

Biến động mạnh ở tuần đáo hạn

Chuyên viên cao cấp phân tích
Ngô Quốc Hưng
hung.ngoquoc@mbs.com.vn

Đồ thị kỹ thuật chỉ số VN30F1M (15 Phút)



Nhận định thị trường

Thị trường phái sinh giảm hơn 12 điểm trong phiên sáng không bắt giờ sau khi ảnh hưởng từ chứng khoán thế giới cuối tuần trước. Nhịp giảm đáng chú ý hôm nay bắt đầu từ phiên chiều xuyên qua ngưỡng hỗ trợ kỹ thuật MA50 ở khu vực 1,250 điểm và giảm dứt khoát kể từ thời điểm 14h. Biên độ giảm riêng trong phiên chiều hơn 41 điểm, buộc các vị thế Long phải cover. Thanh khoản lên mức cao nhất trong vòng 1 tháng trở lại đây, tăng 28% so với phiên cuối tuần trước, đạt 332,240 hợp đồng. Rủi VN30 chỉ còn duy nhất SHB tăng điểm, trong 29 cổ phiếu còn lại, có tới 6 cổ phiếu giảm sàn. Phiên giảm mạnh nhất của chỉ số VN30 trong vòng 1 năm khiến basis vẫn còn dương 8.4 điểm. Cả 4 hợp đồng đóng cửa với mức giảm từ 45 - 49 điểm, tuần này hợp đồng tháng 4 đáo hạn, sau một phiên giảm mạnh như hôm nay thì cơ hội hồi lại sẽ có, basis dương nên cơ hội cho cả Long và Short, trong đó Short dài có xác suất cao.

Vùng Hỗ trợ/Kháng cự của chỉ số VN30F1M

Khung thời gian	15m	Daily
Tổng kết	SHORT	SHORT
Hỗ trợ	1,220 - 1,225	1,200 - 1,210
Kháng cự	1,248 - 1,250	1,264 - 1,271

Chiến lược đầu tư

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh LONG quanh khu vực 1,225 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro nếu để mất mốc 1,219 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1,250 điểm. Chiến lược SHORT sẽ được kích hoạt nếu chỉ số phản ứng tiêu cực tại vùng kháng cự ngắn hạn 1,250; 1,262, điểm hoặc dưới mốc 1,219 điểm. □
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.

Thị trường chứng khoán trong nước

Index	Last	Chg.	Chg.%
Vn-Index	1,216.61	-59.99	-4.70%
VN30	1,227.90	-56.84	-4.42%

Thị trường chứng khoán thế giới

Dow Jones	37,983.24	-475.84	-1.24%
S&P500	5,123.41	-75.65	-1.46%
S&P 500 VIX	16.83	-0.48	-2.77%
Nikkei 225	39,209.50	-357.50	-0.90%
Kospi	2,670.14	-11.68	-0.44%
Shanghai	3,057.38	37.90	1.26%
Hang Seng	16,600.46	-121.23	-0.72%
FTSE 100	7,960.13	-35.45	-0.44%
DAX	18,082.60	178.45	1.00%
CAC 40	8,062.72	51.89	0.65%

Thị trường hàng hóa

Vàng	2,367.25	-6.85	-0.29%
Dầu WTI	84.61	-1.05	-1.23%
Dầu Brent	89.46	-0.99	-1.09%

HĐTL chỉ số VN30

Index	Last	Chg.	Basis
VN30F2404	1,236.3	-49.70	8.40
VN30F2405	1,240.0	-45.00	12.10
VN30F2406	1,242.1	-47.60	14.20
VN30F2409	1,244.0	-45.00	16.10

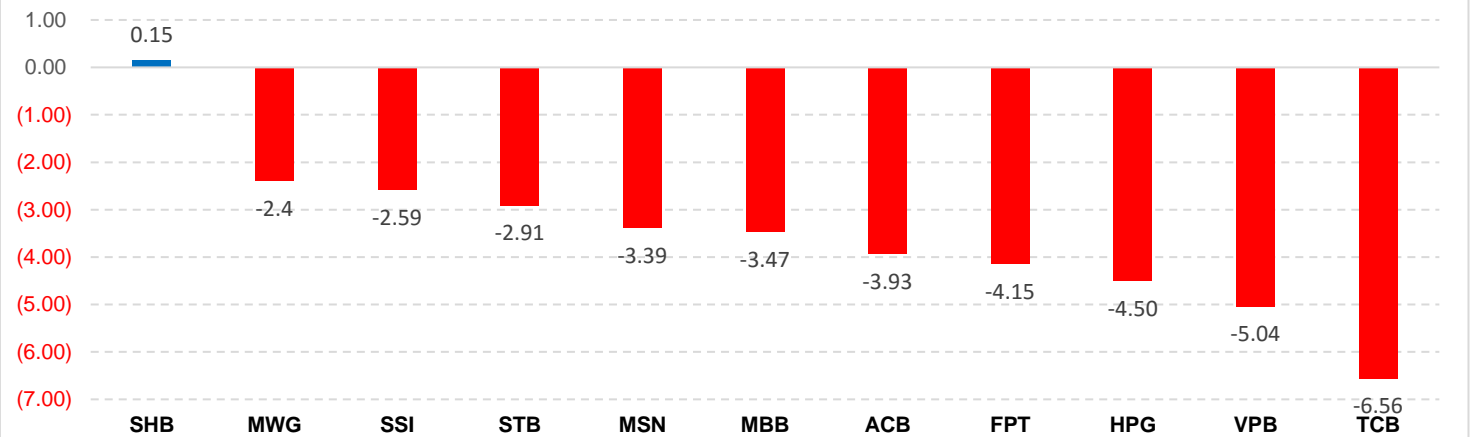
Dữ liệu được cập nhật lúc 17h hàng ngày

Đồ thị kỹ thuật chỉ số VN30F1M (Hàng ngày)



Mã chỉ số	Ngày đáo hạn	Số ngày tới hạn	KLGD (HĐ)	KL mở (OI)	Giá đóng cửa	+/- (Điểm)	Giá lý thuyết tham khảo	Chênh lệch
VN30					1,227.90	-56.84		
VN30F2404	17/04/2024	2	310,619	50,326	1,236.3	-49.7	1227.94	-8.36
VN30F2405	16/05/2024	31	21,077	4,642	1,240.0	-45.0	1229.20	-10.80
VN30F2406	20/06/2024	66	313	862	1,242.1	-47.6	1230.73	-11.37
VN30F2409	19/09/2024	157	231	515	1,244.0	-45.0	1234.70	-9.30

Top cổ phiếu ảnh hưởng đến chỉ số VN30 (Điểm)



Tuyên bố miễn trách nhiệm:

Bản quyền năm 2023 thuộc về Công ty CP Chứng khoán MB (MBS). Những thông tin sử dụng trong báo cáo được thu thập từ những nguồn đáng tin cậy và MBS không chịu trách nhiệm về tính chính xác của chúng. Quan điểm thể hiện trong báo cáo này là của (các) tác giả và không nhất thiết liên hệ với quan điểm chính thức của MBS. Không một thông tin cũng như ý kiến nào được viết ra nhằm mục đích quảng cáo hay khuyến nghị mua/bán bất kỳ chứng khoán nào. Báo cáo này không được phép sao chép, tái bản bởi bất kỳ cá nhân hoặc tổ chức nào khi chưa được phép của MBS.