

Basis chuyển âm, canh short

Chuyên viên phân tích

Nghiêm Phú Cường

cuong.nghiempphu@mbs.com.vn

Đồ thị kỹ thuật chỉ số VN30F1M (15 Phút)



Nhận định thị trường

Thị trường phái sinh phản ánh lo ngại trên thị trường cơ sở khi Basis thu hẹp và chuyển từ dương sang âm. Vùng hỗ trợ 1.257 - 1.260 điểm tuy có phản ứng tích cực nhưng Long/Short khó khăn khi chỉ số Vn30 chỉ dao động trong biên độ hẹp ở phiên sáng. Nhịp hồi trong phiên chiều khá thuận lợi để Long nhưng rủi ro là basis lại chuyển sang âm. Có thể thị trường phái sinh đang phát tín hiệu trước thị trường cơ sở và có sự phòng vệ của lực Short.

Lực SHORT đang chiếm ưu thế, chúng tôi khuyến nghị chiến lược LONG chỉ nên bắt đáy tại những vùng hỗ trợ mạnh với kỳ vọng thấp. Cụ thể như sau: LONG tại vùng 1.257 – 1.260 điểm, cắt lỗ khi giảm qua 1.248 điểm. Chiến lược giao dịch SHORT tại vùng cản 1.280 – 1.285 điểm, cắt lỗ khi vượt qua 1.294 điểm.

Vùng Hỗ trợ/Kháng cự của chỉ số VN30F1M

Khung thời gian	15m	Daily
Tổng kết	LONG	SHORT
Hỗ trợ	1.255 - 1.260	1.280 - 1.285
Kháng cự	1.280 - 1.285	1.255 - 1.260

Chiến lược đầu tư

Chiến lược giao dịch trong ngày	Lực SHORT đang chiếm ưu thế, chúng tôi khuyến nghị chiến lược LONG chỉ nên bắt đáy tại những vùng hỗ trợ mạnh với kỳ vọng thấp. Cụ thể như sau: LONG tại vùng 1.257 – 1.260 điểm, cắt lỗ khi giảm qua 1.248 điểm. Chiến lược giao dịch SHORT tại vùng cản 1.280 – 1.285 điểm, cắt lỗ khi vượt qua 1.294 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	SHORT tại các nhịp hồi phục với kỳ vọng phái sinh về 1.300 điểm

Thị trường chứng khoán trong nước

Index	Last	Chg.	Chg.%
Vn-Index	1,236.60	9.64	0.79%
VN30	1,281.01	9.01	0.71%

Thị trường chứng khoán thế giới

Dow Jones	40,347.97	-494.82	-1.21%
S&P500	5,446.68	-75.62	-1.37%
S&P 500 VIX	20.46	1.87	10.06%
Nikkei 225	35,917.50	-2,182.00	-5.73%
Kospi	2,675.65	-102.03	-3.67%
Shanghai	2,905.34	-27.05	-0.92%
Hang Seng	16,945.51	-359.45	-2.08%
FTSE 100	8,240.25	-43.11	-0.52%
DAX	17,805.05	-281.70	-1.56%
CAC 40	7,301.64	-68.81	-0.93%

Thị trường hàng hóa

Vàng	2,507.90	27.10	1.09%
Dầu WTI	76.47	0.16	0.21%
Dầu Brent	79.69	0.17	0.21%

HĐTL chỉ số VN30

Index	Last	Chg.	Basis
VN30F2408	1,275.9	0.90	-5.11
VN30F2409	1,279.1	0.00	-1.91
VN30F2412	1,274.1	-3.70	-6.91
VN30F2503	1,281.0	2.00	-0.01

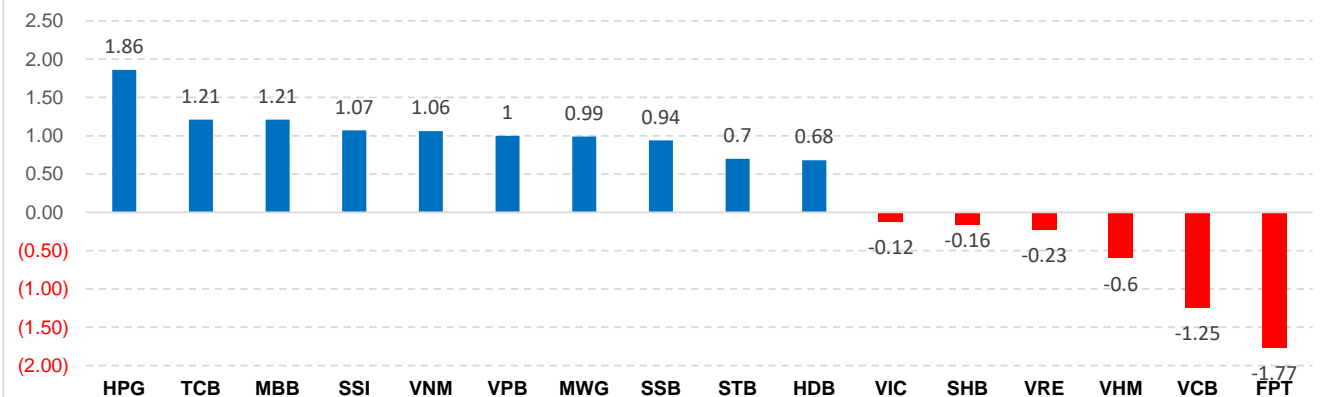
Dữ liệu được cập nhật lúc 17h hàng ngày

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					1,281.01	9.01		
VN30F2408	15/08/2024	13	270,992	55,375	1,275.9	0.9	1281.55	5.65
VN30F2409	19/09/2024	48	786	1,380	1,279.1	0.0	1283.14	4.04
VN30F2412	19/12/2024	139	92	586	1,274.1	-3.7	1287.28	13.18
VN30F2503	20/03/2025	230	55	49	1,281.0	2.0	1291.43	10.43

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



Tuyên bố miễn trách nhiệm:

Bản quyền năm 2024 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.