

HĐTL VN30 - ĐÀ HỒI PHỤC TIẾP DIỄN

MBS Research | **BẢN TIN PHÁI SINH** | 02/02/2021

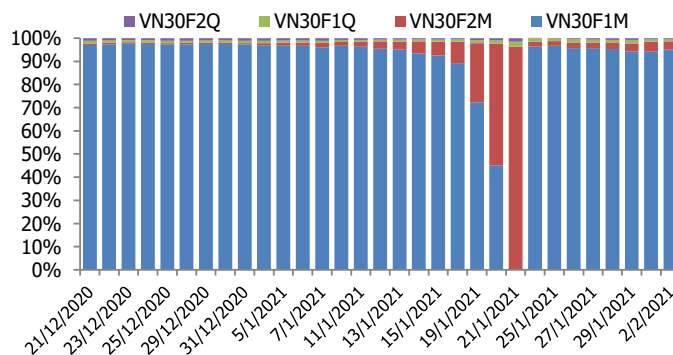
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2102	18/2/2021	16	1092.00	34,318
VN30F2103	18/3/2021	44	1096.10	1,308
VN30F2106	17/6/2021	135	1101.00	318
VN30F2109	16/9/2021	226	1102.90	172

TỶ TRỌNG VỊ THỂ MỞ GIỮA CÁC KỲ HẠN



DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

- Sau nhịp điều chỉnh phiên trước, thị trường đã bật tăng trở lại trong phiên giao dịch hôm nay với các HĐTL đóng cửa tăng mạnh từ 53,1 đến 62 điểm, cao hơn mức tăng 49,84 điểm của chỉ số cơ sở VN30. Do đó, đa số basis các hợp đồng đều mạnh hơn đáng kể so với phiên liền trước. Cụ thể, basis của VN30F2102 đã tăng lên +12,30 điểm trong khi basis hợp đồng VN30F2103 cũng đạt +16,40 điểm vào cuối phiên giao dịch hôm nay. Basis HĐTL tháng 2 trở lại trạng thái dương cho thấy tâm lý giới đầu tư kỳ vọng vào nhịp phục hồi tiếp diễn của thị trường.
- Thị trường đóng cửa cao nhất 4 phiên vừa qua giúp chỉ số VN30-Index củng cố vùng đáy xung quanh ngưỡng 1.000 điểm, VN30-Index đã có 3 phiên test vùng hỗ trợ này cho đến thời điểm hiện tại là thành công. Trong khi các yếu tố tác động bên ngoài tạm thời được giải tỏa, thì ở trong nước thời gian dập dịch cũng bước vào giai đoạn quyết liệt và chủ động để củng cố sức đề kháng của nền kinh tế qua đó tạo niềm tin cho nhà đầu tư. Về kỹ thuật, một phiên tăng điểm chưa làm thay đổi xu hướng chính của thị trường, trong khi các yếu tố tạo rủi ro vẫn chủ đạo là tác động liên quan đến bệnh dịch vì vậy chừng nào mức đáy của VN-Index hay VN30-Index vẫn trụ vững thì có thể kỳ vọng thị trường tích lũy và đi lên.
- Thị trường tiếp tục xuất hiện những nhịp dao động rộng tại vùng đáy kỹ thuật, các nhịp rung lắc mạnh trong phiên sẽ xuất hiện với tần suất dày hơn và đây có thể được xem là cơ hội canh Long nếu chỉ số có những nhịp điều chỉnh kiểm nghiệm hỗ trợ quanh ngưỡng hỗ trợ 1076-1079 điểm và quản trị rủi ro nếu thủng 1076 điểm. Trong khi đó, trạng thái Short có thể canh lướt ngắn hạn trong phiên ở các nhịp giá tiếp cận kháng cự 1105 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày

Canh Long nếu chỉ số có những nhịp điều chỉnh kiểm nghiệm hỗ trợ quanh ngưỡng hỗ trợ 1076-1079 điểm và quản trị rủi ro nếu thủng 1076 điểm. Trong khi đó, trạng thái Short có thể canh lướt ngắn hạn trong phiên ở các nhịp giá tiếp cận kháng cự 1105 điểm.

Chiến lược giao dịch ngắn hạn

Thị trường xuất hiện những nhịp dao động rộng tại vùng đáy kỹ thuật, do đó hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.

Chiến lược giao dịch spread

Xem xét mở vị thế Long Spread đối với cặp hợp đồng (VN30F2103-VN30F2102), kỳ vọng chốt lời khi chênh lệch giá hai hợp đồng tăng lên khoảng -4 điểm.