

Phái sinh thận trọng khi dòng tiền dịch chuyển !

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 đi vào trạng thái giằng co ở vùng 1,264 điểm dù có trụ mới thay thế nhóm cổ phiếu ngân hàng dẫn dắt trong thời gian vừa qua. Nổi bật là tác động từ các cổ phiếu như: FPT, VHM, MWG, ... Tâm lý thận trọng đang xuất hiện khi dòng tiền có xu hướng dịch chuyển từ nhóm cổ phiếu Bluechips sang nhóm cổ phiếu trung bình (Midcap). Do vậy, tác động đến thị trường phái sinh sẽ ít hơn, biên độ dao động hẹp hơn và khó trading trong phiên. Về kỹ thuật, khu vực 1,271; 1,275 điểm có thể là vùng cản đối với phái sinh trong các phiên sắp tới. Thanh khoản có dấu hiệu giảm, phiên cuối tuần còn 183,275 HĐ so với mức 219,341 HĐ ở phiên trước đó. Khối ngoại đang Short ròng trở lại khi nhóm Bluechip có dấu hiệu "hạ nhiệt". Khả năng retest đỉnh 2023 ở khu vực 1,254 -1,260 điểm có thể diễn ra trong tuần sau. Nhà đầu tư nên thận trọng, canh các điểm Short trong phiên nếu dòng tiền tiếp tục dịch chuyển sang nhóm Midcap.

Vùng Hỗ trợ/Kháng cự của chỉ số VN30F1M

Khung thời gian	15m	Daily
Tổng kết	SHORT	SHORT
Hỗ trợ	1,260 - 1,261	1,250 -1,251
Kháng cự	1,271 - 1,275	1,273-1,275

Chiến lược đầu tư

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh LONG quanh khu vực 1,260 – 1,261 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro nếu dễ mất mốc 1,257 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1,268 điểm. Chiến lược SHORT sẽ được kích hoạt nếu chỉ số phản ứng tiêu cực tại vùng kháng cự ngắn hạn 1,271; 1,275 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	1,258.28	5.55	0.44%
VN30	1,267.07	1.32	0.10%

Thị trường chứng khoán thế giới

Dow Jones	39,087.38	90.99	0.23%
S&P500	5,137.08	40.81	0.80%
S&P 500 VIX	13.11	0.00	0.00%
Nikkei 225	39,940.00	751.00	1.92%
Kospi	2,642.36	-9.93	-0.37%
Shanghai	3,027.02	11.85	0.39%
Hang Seng	16,589.44	78.00	0.47%
FTSE 100	7,682.50	52.48	0.69%
DAX	17,735.00	-0.07	0.00%
CAC 40	7,934.17	6.74	0.09%

Thị trường hàng hóa

Vàng	2,091.60	0.00	0.00%
Dầu WTI	79.81	1.55	1.98%
Dầu Brent	83.46	1.55	1.89%

HĐTL chỉ số VN30

Index	Last	Chg.	Basis
VN30F2403	1,266.8	4.00	-0.27
VN30F2404	1,268.7	4.80	1.63
VN30F2406	1,263.7	2.80	-3.37
VN30F2409	1,263.7	3.30	-3.37

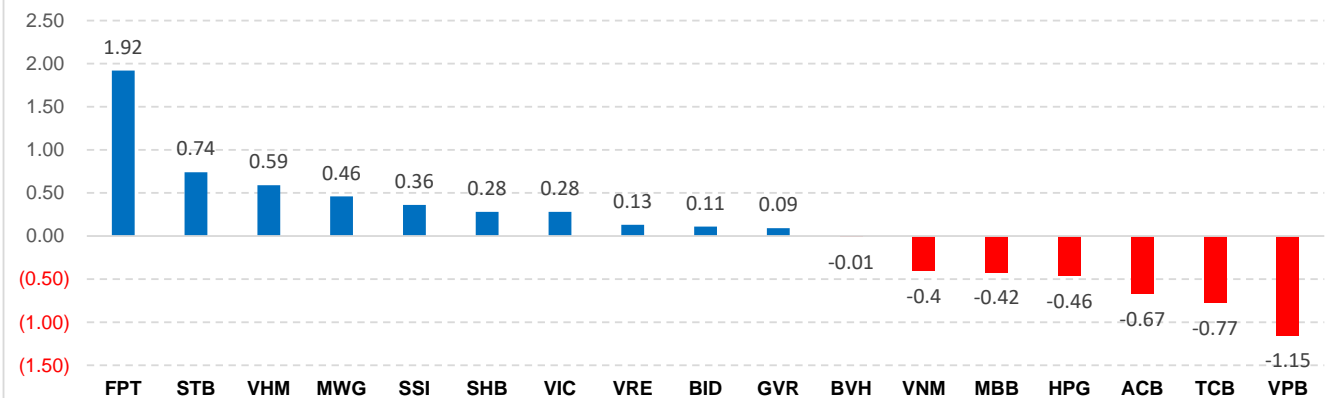
Dữ liệu được cập nhật lúc 17h hàng ngày

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					1,267.07	1.32		
VN30F2403	21/03/2024	17	182,964	45,610	1,266.8	4.0	1267.79	0.99
VN30F2404	17/04/2024	44	223	1,438	1,268.7	4.8	1269.00	0.30
VN30F2406	20/06/2024	108	36	716	1,263.7	2.8	1271.88	8.18
VN30F2409	19/09/2024	199	52	420	1,263.7	3.3	1275.98	12.28

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.