

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,510 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán đã quay trở lại. Giá trị bán ròng ở mức 70 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên HPG, VNM, và GVR.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng tăng tiếp tục

VN30F2110 tích lũy trong phiên giao dịch trước nhưng xu hướng tăng vẫn duy trì. Vùng 1,430 điểm là vùng hỗ trợ chủ đạo trong phiên trong khi vùng 1,550 điểm là vùng kháng cự quan trọng. Mẫu nến thân hẹp xuất hiện trên đồ thị ngày với khối lượng giao dịch trên mức trung bình, tín hiệu cho sự gia tăng của độ biến động. Tuy nhiên, đà tăng vẫn duy trì khi các đường MA chủ đạo hướng lên. Trong trường hợp này, traders chỉ nên mở vị thế mua mới trên nhịp pullback.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua VN30F2110 tại vùng 1,457 điểm nên được tiếp tục nắm và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,435 điểm (Đồ thị giờ). Với vị thế mua mới, traders nên tiếp tục chờ nhịp pullback để mở vị thế.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	1,509.6	(0.0)					
VN30F2110	1,510.0	(0.2)	159,949	39,695	1,511	21/10/2021	11
VN30F2111	1,503.5	(0.4)	456	897	1,511	18/11/2021	39
VN30F2112	1,493.0	(0.8)	29	268	1,512	16/12/2021	67
VN30F2203	1,498.0	(0.2)	26	661	1,514	17/03/2022	158

Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

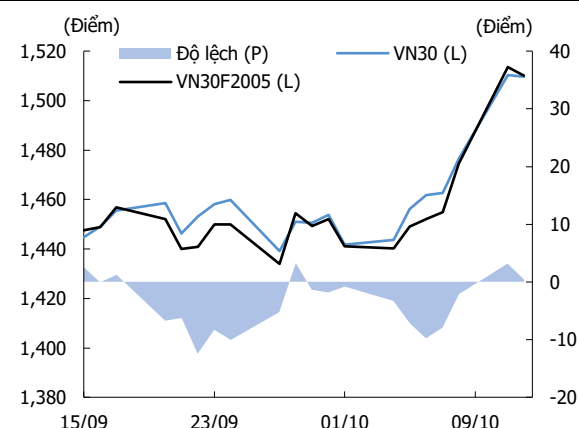
Published on TradingView.com, October 13, 2021 08:14:18 +07
 VN30F2110, 60 O: 1501.30 H: 1510.00 L: 1500.30 C: 1510.00



TradingView

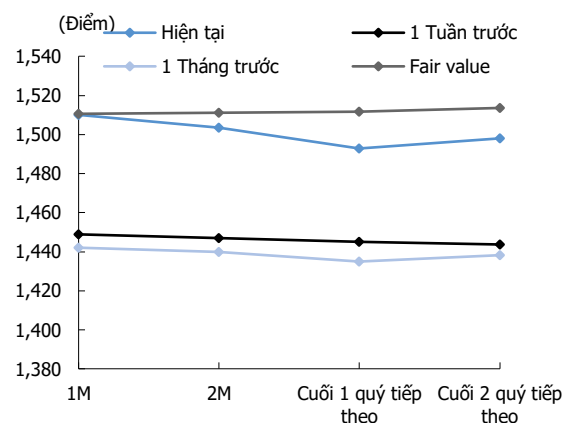
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



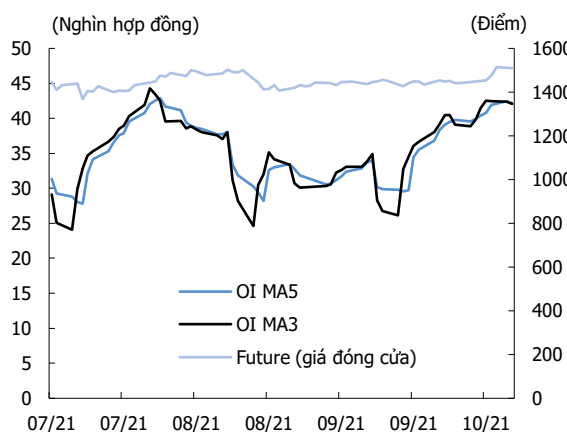
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



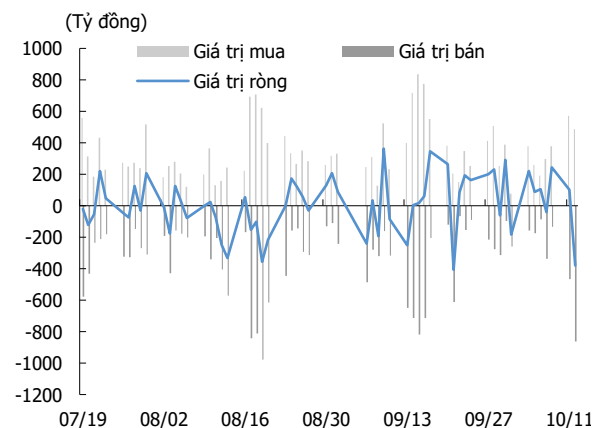
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	Ngân hàng Á Châu	Tài chính	88,084	5.50	32,600	0.0	9.1	2.18	8,031	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	161,886	0.48	40,250	0.6	16.3	1.99	1,803	16.6	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	45,950	0.34	61,900	(0.2)	24.5	2.20	1,206	26.6	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	148,017	1.63	30,800	(0.6)	9.0	1.60	13,132	24.5	42,535	21,849
FPT	FPT Corp	CNTT	89,839	5.61	99,000	(0.2)	23.4	5.35	2,855	49.0	99,500	43,652
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	214,362	0.79	112,000	(0.4)	27.5	4.58	1,204	2.5	114,500	69,400
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	151,200	0.44	37,800	0.0	32.0	3.12	5,034	0.6	41,000	13,200
HDB	HDBank	Tài chính	50,901	2.62	25,550	(0.4)	9.7	1.95	2,926	17.7	30,320	14,434
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	254,957	10.30	57,000	(0.3)	10.1	3.45	27,337	25.5	57,600	20,593
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	28,000	1.30	43,550	(0.2)	22.2	3.14	3,520	30.8	43,950	21,455
MBB	MBBank	Tài chính	108,627	4.39	28,750	(0.2)	10.4	2.04	14,662	23.2	32,926	12,734
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	171,768	4.42	145,500	(1.0)	81.4	8.05	1,362	32.3	150,000	66,500
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	94,175	4.50	132,100	2.0	20.6	5.16	1,547	49.0	134,000	67,867
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	151,781	3.90	103,000	(1.0)	28.6	4.51	2,476	8.9	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	43,079	1.27	88,500	(0.3)	30.5	7.72	3,379	3.2	97,500	28,752
PLX	Petrolimex	Năng lượng	69,883	0.65	55,000	0.2	17.1	2.81	1,409	17.6	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	22,737	1.34	100,000	(2.0)	8.1	3.98	642	48.3	109,100	61,800
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	29,742	0.44	12,700	2.4	11.8	1.00	11,600	3.0	15,200	9,350
SAB	SABECO	TD thiết yếu	104,529	0.84	163,000	0.0	22.4	5.02	185	62.7	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	40,686	1.94	41,400	(1.2)	22.2	3.62	17,391	44.8	45,300	10,867
STB	Sacombank	Tài chính	50,147	3.35	26,600	0.4	13.8	1.58	20,154	15.7	33,900	13,000
TCB	Techcombank	Tài chính	186,078	8.87	53,000	0.0	11.5	2.23	14,342	22.5	58,600	21,200
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	50,030	2.20	42,700	(0.9)	10.2	2.26	6,291	30.0	43,300	18,088
VCB	Vietcombank	Tài chính	359,761	2.91	97,000	(0.5)	17.5	3.43	1,284	23.5	117,200	82,800
VHM	Vinhomes	Bất động sản	352,268	5.11	80,900	(0.1)	10.5	3.61	10,389	22.9	93,769	57,615
VIC	VinGroup	Bất động sản	353,504	7.31	92,900	1.1	52.6	3.88	2,822	13.8	129,689	80,889
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	71,764	2.64	132,500	0.0	30.1	4.23	823	17.6	138,500	99,400
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	188,932	5.55	90,400	0.4	19.8	5.97	3,354	54.8	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	163,150	7.74	36,700	(0.3)	13.1	2.70	17,151	15.4	40,722	12,722
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	69,987	1.65	30,800	1.1	25.8	2.30	4,818	29.7	38,300	25,050

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 © 2021 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.