

Độ biến động gia tăng

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,531 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua tăng mạnh. Giá trị mua ròng ở mức 345 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động mua ròng tập trung chủ yếu trên HPG, VHM, và NVL.

Đồ thị VN30 Future: Mẫu hình chữ nhật

VN30F2111 tiếp tục dao động trong biên độ hẹp, hình thành mẫu hình chữ nhật ngắn hạn với cạnh trên và dưới lần lượt là ngưỡng 1,540 điểm và 1,520 điểm. Cụ thể, xu hướng tăng vẫn duy trì và được xác nhận bởi hệ thống tín hiệu các đường MA (Đồ thị ngày). Đáng chú ý, mẫu hình chữ nhật luôn có xác suất breakout cao hơn so với breakdown. Trong trường hợp này, traders tiếp tục nắm giữ vị thế mua và mở vị thế mua mới khi breakout xuất hiện tại ngưỡng 1,540 điểm.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2111 nên được tiếp tục nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,460 điểm (Đồ thị giờ). Với vị thế mua mới, traders có thể mua VN30F2111 khi breakout xuất hiện tại ngưỡng 1,540 điểm và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,520 điểm (Đồ thị giờ).

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	1,530.7	0.6					
VN30F2111	1,528.5	0.3	166,803	31,244	1,522	18/11/2021	17
VN30F2112	1,527.0	0.3	387	704	1,522	16/12/2021	45
VN30F2203	1,524.6	0.3	58	192	1,524	17/03/2022	136
VN30F2206	1,520.2	0.2	58	94	1,526	16/06/2022	227

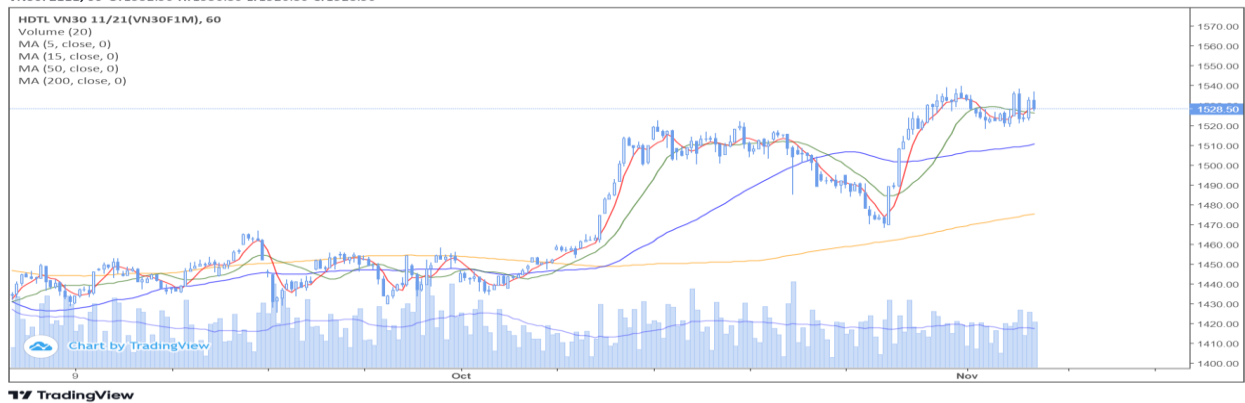
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

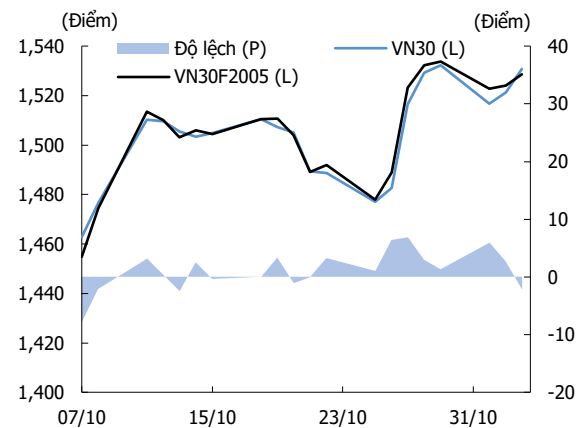
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, November 04, 2021 08:16:55 +07
VN30F2111, 60 O:1532.50 H:1536.80 L:1526.80 C:1528.50



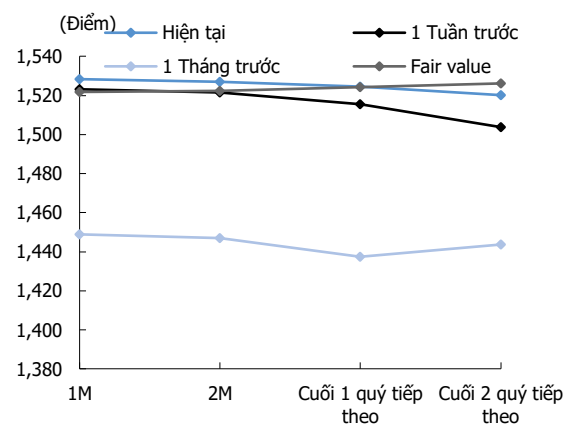
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



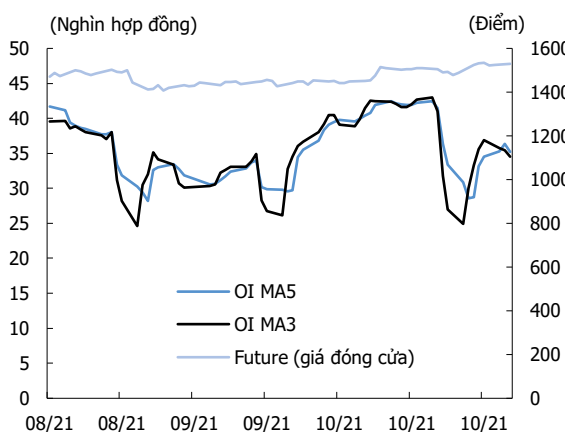
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



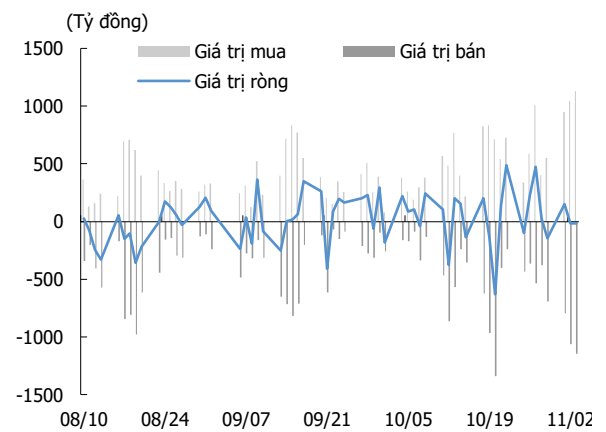
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	91,461	5.52	33,850	2.1	9.4	2.15	6,868	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	173,148	0.49	43,050	2.6	17.6	2.09	1,688	16.6	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	47,137	0.33	63,500	(2.0)	25.7	2.21	1,408	26.6	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	158,590	1.69	33,000	1.9	9.6	1.67	11,868	24.5	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	87,208	5.26	96,100	0.0	21.6	5.13	2,429	49.0	101,500	44,957
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	229,674	0.82	120,000	(1.3)	28.0	4.67	1,551	2.6	128,400	69,900
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	157,200	0.45	39,300	(6.7)	31.6	3.20	5,083	0.6	43,300	14,600
HDB	HDBank	Tài chính	54,188	2.69	27,200	6.3	9.1	1.57	2,696	17.5	30,320	15,190
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	248,695	9.53	55,600	0.2	7.8	2.96	26,528	24.9	58,400	22,370
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	30,347	1.40	47,200	(6.3)	25.4	3.11	3,254	30.9	51,100	21,773
MBB	MBBank	Tài chính	110,138	4.30	29,150	2.6	9.9	1.96	13,155	23.2	32,926	13,175
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	171,768	4.88	145,500	0.0	71.6	7.98	1,252	32.2	152,500	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	91,822	4.24	128,800	(0.1)	21.0	4.89	1,454	49.0	134,800	68,000
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	155,023	3.85	105,200	(2.7)	44.3	4.53	2,628	8.6	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	45,513	1.29	93,500	(1.9)	28.8	7.36	3,765	3.4	99,700	30,927
PLX	Petrolimex	Năng lượng	67,341	0.48	53,000	(2.4)	16.5	2.70	1,534	17.5	59,600	45,150
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	23,760	1.35	104,500	(0.5)	8.1	4.27	615	48.0	109,100	70,600
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	29,508	0.42	12,600	(1.9)	10.2	0.98	13,578	3.0	15,200	9,550
SAB	SABECO	TD thiết yếu	110,685	0.86	172,600	4.5	29.3	5.21	187	62.7	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	40,964	1.89	41,700	(1.5)	19.2	3.03	15,485	43.0	45,300	11,263
STB	Sacombank	Tài chính	52,598	3.55	27,900	4.7	14.9	1.58	16,337	16.3	33,900	13,250
TCB	Techcombank	Tài chính	188,536	8.69	53,700	4.1	10.8	2.15	13,282	22.5	58,600	21,500
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	51,788	2.21	44,200	0.9	10.0	2.09	5,745	30.0	44,950	18,825
VCB	Vietcombank	Tài chính	366,066	2.86	98,700	0.8	17.3	3.35	1,105	23.5	117,200	84,000
VHM	Vinhomes	Bất động sản	360,977	6.28	82,900	(2.5)	10.0	4.11	10,714	22.9	93,769	58,077
VIC	VinGroup	Bất động sản	362,637	7.36	95,300	(0.5)	76.4	3.57	2,755	13.7	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	70,301	2.50	129,800	(1.7)	30.1	4.14	879	17.1	138,500	103,000
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	184,334	5.24	88,200	(1.1)	19.6	5.93	3,483	54.8	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	170,706	7.88	38,400	2.3	13.8	2.74	13,362	15.4	40,722	12,944
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	72,032	1.67	31,700	2.8	33.2	2.36	5,324	29.8	38,300	25,100

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.