

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,520 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán đã quay trở lại và tăng mạnh. Giá trị bán ròng ở mức 200 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên VPB, HPG, và SSI.

Đồ thị VN30 Future: Duy trì giai đoạn tích lũy

VN30F2111 tiếp tục tích lũy sau khi phản ứng tích cực với vùng hỗ trợ quan trọng (1,500 điểm) và xu hướng tiếp theo vẫn chưa được xác nhận. Cụ thể, các đường MA chủ đạo hướng ngang và Bollinger bands dần co hẹp, điều này hàm ý rằng giai đoạn tích lũy sẽ tiếp tục. Vùng 1,500 điểm sẽ là vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn trong khi vùng 1,540 điểm là vùng kháng cự cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Trong trường hợp này, traders nên tiếp tục nắm giữ vị thế mua và chờ tín hiệu kế tiếp.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2111 nên được nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,510 điểm (Đồ thị giờ) hoặc thoát mọi vị thế khi phiên ATC kết thúc.

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	1,519.6	0.2					
VN30F2111	1,520.4	0.2	104,400	21,440	1,517	18/11/2021	3
VN30F2112	1,520.8	0.2	7,394	8,422	1,518	16/12/2021	31
VN30F2203	1,517.9	(0.0)	24	178	1,520	17/03/2022	122
VN30F2206	1,511.5	0.1	141	131	1,522	16/06/2022	213

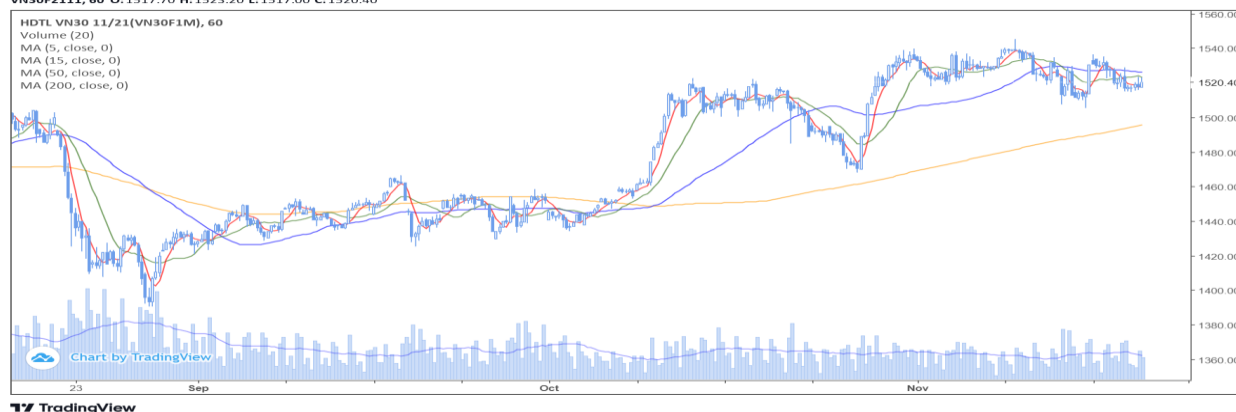
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

dang.lh@kisvn.vn

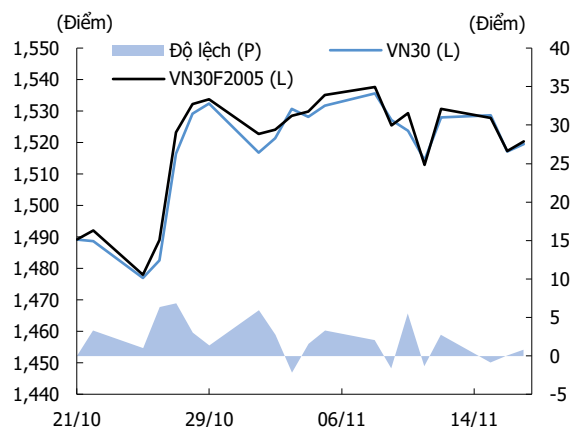
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, November 17, 2021 21:30:10 +07
 VN30F2111, 60 O: 1517.70 H: 1523.20 L: 1517.00 C: 1520.40



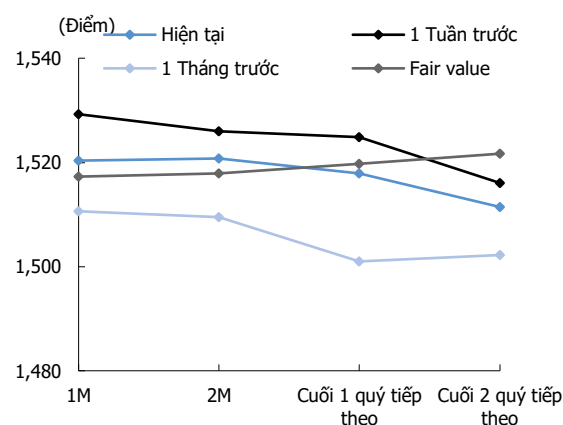
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



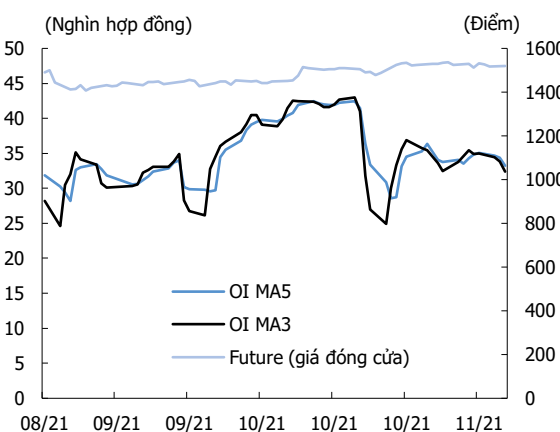
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



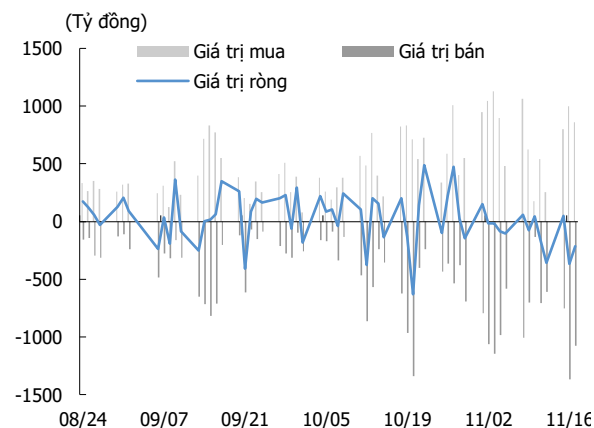
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	89,975	5.47	33,300	0.5	9.3	2.12	5,881	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	175,360	0.50	43,600	1.9	17.8	2.12	1,737	16.6	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	47,657	0.34	64,200	(0.6)	26.0	2.24	1,480	26.5	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	154,985	1.66	32,250	(0.5)	9.3	1.63	11,193	24.8	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	89,204	5.42	98,300	0.0	22.1	5.25	2,158	49.0	101,500	46,087
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	224,698	0.80	117,400	0.6	27.4	4.57	1,618	2.7	128,400	72,500
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	160,000	0.46	40,000	1.7	32.1	3.25	4,965	0.6	43,300	16,600
HDB	HDBank	Tài chính	55,383	2.77	27,800	(0.4)	9.9	2.01	3,122	17.7	30,320	15,884
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	229,908	8.87	51,400	(1.2)	7.3	2.73	27,287	25.1	58,400	24,000
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	31,054	1.44	48,300	0.1	26.0	3.18	3,002	31.1	51,100	22,000
MBB	MBBank	Tài chính	108,438	4.27	28,700	0.2	9.8	1.93	12,921	23.2	32,926	13,982
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	177,670	5.08	150,500	(1.0)	74.1	8.26	1,283	32.2	155,100	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	98,310	4.57	137,900	0.0	22.5	5.23	1,460	49.0	139,900	72,933
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	152,076	3.81	103,200	0.1	43.4	4.44	2,623	8.1	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	43,809	1.25	90,000	(0.6)	27.8	7.08	3,938	3.2	99,700	30,927
PLX	Petrolimex	Năng lượng	78,904	0.56	62,100	5.6	23.4	3.22	1,688	17.3	62,100	45,500
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	24,192	1.38	106,400	(1.5)	8.1	4.35	670	48.4	112,000	72,400
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	33,137	0.47	14,150	0.7	11.4	1.10	15,586	3.0	15,200	9,700
SAB	SABECO	TD thiết yếu	109,338	0.86	170,500	(0.1)	29.0	5.15	175	62.7	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	45,041	2.10	45,850	2.5	21.1	3.33	14,889	41.1	46,800	11,660
STB	Sacombank	Tài chính	52,786	3.59	28,000	(0.2)	15.0	1.58	15,074	16.8	33,900	13,600
TCB	Techcombank	Tài chính	183,270	8.52	52,200	0.4	10.5	2.09	13,788	22.5	58,600	22,850
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	50,675	2.17	43,250	(1.0)	9.8	2.05	5,307	29.9	44,950	19,766
VCB	Vietcombank	Tài chính	363,470	2.86	98,000	0.8	17.2	3.32	1,071	23.6	117,200	85,500
VHM	Vinhomes	Bất động sản	363,590	6.37	83,500	0.6	10.1	4.14	10,465	22.9	93,769	59,000
VIC	VinGroup	Bất động sản	366,442	7.49	96,300	1.6	77.2	3.61	2,555	13.6	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	69,272	2.48	127,900	0.0	30.1	4.08	924	16.9	138,500	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	185,588	5.31	88,800	0.2	19.7	5.97	3,451	54.6	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	160,704	7.47	36,150	0.0	13.0	2.58	11,982	15.2	40,722	13,194
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	69,192	1.62	30,450	1.3	31.9	2.27	5,716	29.4	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.