

Vùng nhiễu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 đóng cửa tại 1,553 điểm. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán đã quay trở lại và chiếm ưu thế. Giá trị bán ròng ở mức 160 tỷ đồng. Đáng chú ý, hoạt động bán ròng tập trung chủ yếu trên VPB, PNJ, and HDB.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng tăng vẫn chưa bị phá vỡ

VN30F2112 nhận được lực cầu quanh vùng 1,540 điểm, nhịp điều chỉnh tạm thời bị chững lại. Cụ thể, các đường MA chủ đạo nằm dưới giá đóng cửa (Đồ thị ngày), điều này hàm ý rằng xu hướng tăng vẫn chưa bị phá vỡ. Vùng 1,540 điểm sẽ là vùng hỗ trợ chủ đạo trong ngắn hạn trong khi vùng 1,580 điểm tiếp tục là vùng kháng cự cho sự tiếp tục của xu hướng tăng. Đáng chú ý, hợp đồng này đang được giao dịch quanh các đường MA chủ đạo, điều này hàm ý rằng tín hiệu trading không tin cậy có thể xuất hiện. Traders nên tiếp tục nắm giữ vị thế mua và hạn chế giao dịch trong giai đoạn này.

Chiến lược đầu tư

Vị thế mua trên VN30F2112 nên được tiếp tục nắm giữ và dừng lỗ khi xuất hiện giá đóng cửa dưới ngưỡng 1,500 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	1,553.0	(0.9)					
VN30F2112	1,551.9	(0.3)	151,111	28,075	1,567	16/12/2021	19
VN30F2201	1,546.6	(0.4)	250	281	1,568	20/01/2022	54
VN30F2203	1,545.0	(0.6)	37	171	1,569	17/03/2022	110
VN30F2206	1,539.9	(0.7)	25	174	1,571	16/06/2022	201

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đặng Lê

dang.lh@kisvn.vn

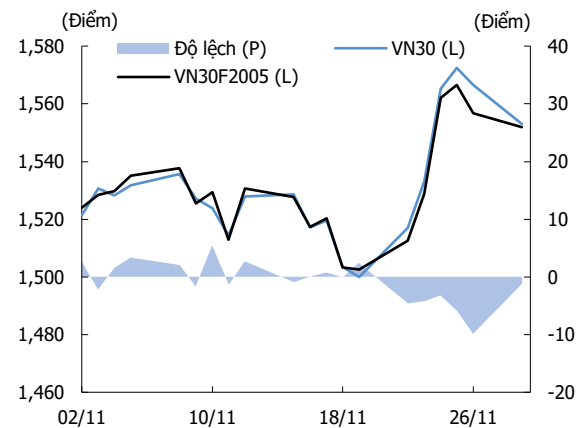
Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

Published on TradingView.com, November 30, 2021 08:13:40 +07
 VN30F2112, 60 O: 1548.80 H: 1551.90 L: 1546.50 C: 1551.90



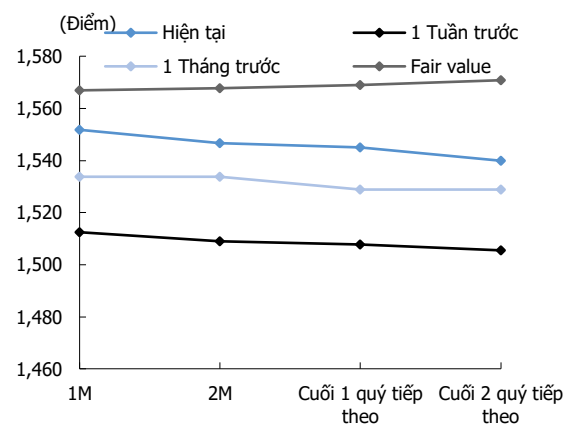
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



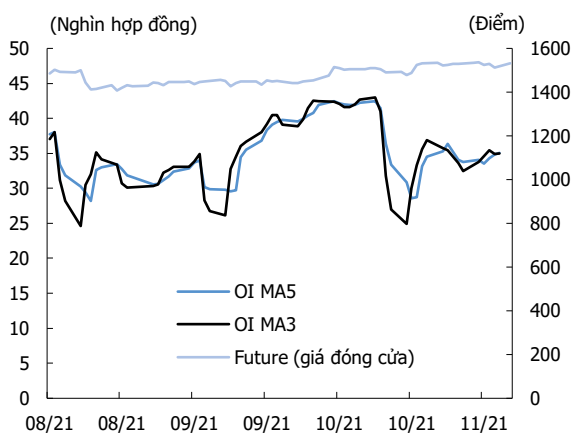
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



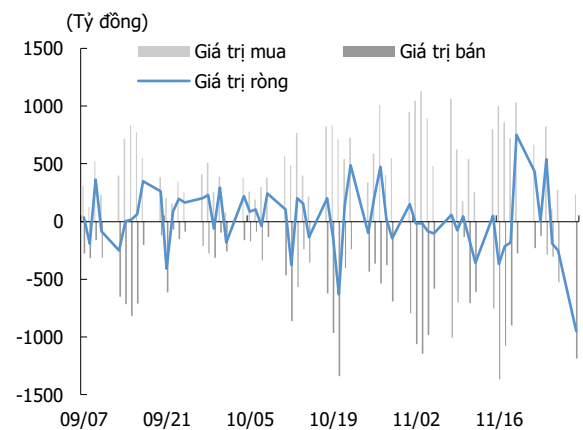
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	92,272	5.49	34,150	(1.3)	9.5	2.17	5,457	30.0	38,200	19,600
BID	BIDV	Tài chính	178,980	0.50	44,500	(2.1)	18.2	2.16	1,872	16.7	50,600	36,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	46,024	0.32	62,000	(0.3)	25.1	2.16	1,540	26.4	71,200	47,000
CTG	VietinBank	Tài chính	164,597	1.73	34,250	(0.1)	9.9	1.73	11,229	25.1	42,535	22,314
FPT	FPT Corp	CNTT	89,023	5.30	98,100	(0.8)	22.1	5.24	2,109	49.0	101,800	47,652
GAS	PV Gas	Dịch vụ tiện ích	190,247	0.67	99,400	(2.5)	23.2	3.87	1,606	2.8	128,400	72,500
GVR	Tập đoàn CN Cao su VN	Nguyên vật liệu	147,200	0.41	36,800	(0.4)	29.6	2.99	4,518	0.6	43,300	18,100
HDB	HDBank	Tài chính	62,755	3.07	31,500	0.5	11.2	2.27	3,935	17.6	33,950	16,160
HPG	Hòa Phát	Nguyên vật liệu	216,489	8.17	48,400	(1.3)	6.8	2.57	27,520	24.6	58,400	25,593
KDH	Nhà Khang Điền	Bất động sản	29,382	1.34	45,700	(1.4)	24.6	3.01	2,884	31.3	51,100	23,864
MBB	MBBank	Tài chính	112,594	4.33	29,800	(1.7)	10.1	2.01	12,585	23.2	32,926	14,716
MSN	Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	180,032	5.04	152,500	(3.2)	75.1	8.37	1,272	32.4	159,700	80,000
MWG	Thế giới di động	TD không thiết yếu	98,025	4.46	137,500	(2.8)	22.4	5.22	1,420	49.0	145,500	75,200
NVL	Đầu tư Địa ốc No Va (Novaland)	Bất động sản	162,391	3.98	110,200	(0.5)	46.4	4.75	2,641	8.1	123,600	43,724
PDR	BDS Phát Đạt	Bất động sản	46,321	1.28	94,000	(1.9)	29.0	7.40	4,019	3.2	99,700	32,636
PLX	Petrolimex	Năng lượng	69,756	0.49	54,900	(3.3)	20.7	2.84	1,908	17.2	62,400	45,500
PNJ	Vàng Phú Nhuận	TD không thiết yếu	22,305	1.25	98,100	(3.3)	8.1	4.01	672	48.0	112,000	73,000
POW	Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	31,498	0.44	13,450	(0.7)	10.9	1.04	17,011	3.1	15,200	9,900
SAB	SABECO	TD thiết yếu	100,104	0.77	156,100	(2.6)	26.5	4.72	147	62.8	211,000	139,800
SSI	Chứng khoán SSI	Tài chính	54,324	2.47	55,300	3.4	25.5	4.02	15,190	39.1	55,500	12,419
STB	Sacombank	Tài chính	56,368	3.75	29,900	(3.1)	16.0	1.69	15,484	17.2	33,900	14,400
TCB	Techcombank	Tài chính	183,621	8.35	52,300	(3.1)	10.5	2.10	14,099	22.5	58,600	23,650
TPB	Ngân hàng Tiên Phong	Tài chính	55,303	2.32	47,200	(0.6)	10.6	2.23	5,375	29.6	49,850	21,500
VCB	Vietcombank	Tài chính	374,968	2.89	101,100	(3.7)	17.7	3.43	972	23.6	117,200	85,500
VHM	Vinhomes	Bất động sản	369,250	6.33	84,800	1.8	10.2	4.21	8,215	23.1	93,769	62,692
VIC	VinGroup	Bất động sản	400,689	8.02	105,300	6.9	84.4	3.94	2,549	13.6	129,689	82,222
VJC	Vietjet Air	Công nghiệp	67,701	2.37	125,000	(3.5)	30.1	3.99	901	16.8	138,500	105,800
VNM	VINAMILK	TD thiết yếu	182,871	5.12	87,500	(0.9)	19.4	5.88	3,429	54.4	117,200	84,000
VPB	VPBank	Tài chính	170,706	7.77	38,400	(2.0)	13.8	2.74	12,274	15.2	40,722	14,639
VRE	Vincom Retail	Bất động sản	68,510	1.57	30,150	(0.8)	31.6	2.25	6,340	29.6	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.