

Vùng nhiễu

Tin doanh nghiệp

HPG: HPG công bố BCTC hợp nhất quý I với doanh thu đạt 19,232 tỷ đồng, tăng 29% n/n. Cụ thể, mảng sản xuất và kinh doanh thép ghi nhận doanh thu 15,591 tỷ đồng, tăng 31% n/n; đáng chú ý, mảng nông nghiệp tăng 59% n/n, ghi nhận ở mức 2,779 tỷ đồng. (ndh.vn)

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 0.74%, đóng cửa tại 720 điểm với 6 mã không giảm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VPB (+2.4%) và VNM (0%) ảnh hưởng tích cực lên chỉ số trong khi TCB (-0.3%), VIC (-1.1%) và HPG (-0.7%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số VN30. Về giao dịch khối ngoại, áp lực bán tăng mạnh với giá trị bán ròng ghi nhận ở mức 360 tỷ đồng. Cụ thể, VCB, VPB, VRE, VNM và STB bị nhóm này bán mạnh nhất trong khi VHM, VIC, SAB, CTD và HPG thu hút phần lớn lực cầu ngoài trong phiên vừa qua.

Đồ thị VN30 Future: Vùng nhiễu

Mặc dù VN30F2005 duy trì dao động trong kênh giá tăng ngắn hạn, nhưng xu hướng tăng vẫn chưa được xác nhận. Cụ thể, MA20 cắt xuống MA50, tín hiệu cho giai đoạn tăng hiện tại chỉ là tạm thời. Ngoài ra, Bollinger bands đã co lại, chứng minh cho cung cầu đang ở giai đoạn cân bằng. Bên cạnh đó, trên đồ thị ngày, các đường MA ngắn hạn có xu hướng không đồng bộ đi kèm tín hiệu cắt xuống từ Stochastic, sự tiếp tục của xu hướng tăng vẫn chưa được xác nhận. Trong trường hợp này, traders nên mở vị thế khi breakout/breakdown xuất hiện tại vùng 725 điểm/660 điểm.

Chiến lược đầu tư:

Mua VN30F2005 tại vùng 725 điểm khi ngưỡng này bị phá vỡ, mục tiêu tại 780 điểm và dừng lỗ tại 715 điểm. Với vị thế bán, bán hợp đồng này tại 660 điểm khi ngưỡng này bị phá vỡ, mục tiêu tại 630 điểm và dừng lỗ tại 670 điểm.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL mở	Fair Value	Ngày thanh toán
VN30 Index	725.1	1.1%				
VN30F2005	692.5	-0.7%	209,723	32,425	726	21/05/20
VN30F2006	683.6	-0.5%	867	1,247	727	18/06/20
VN30F2009	683.0	-0.4%	127	346	729	17/09/20
VN30F2012	680.4	-0.8%	68	110	732	17/12/20

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

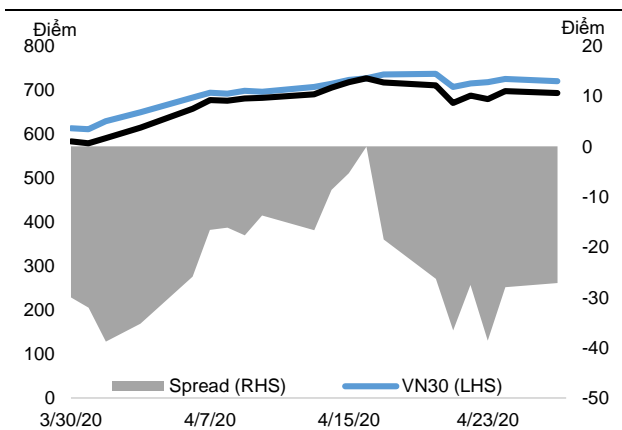
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



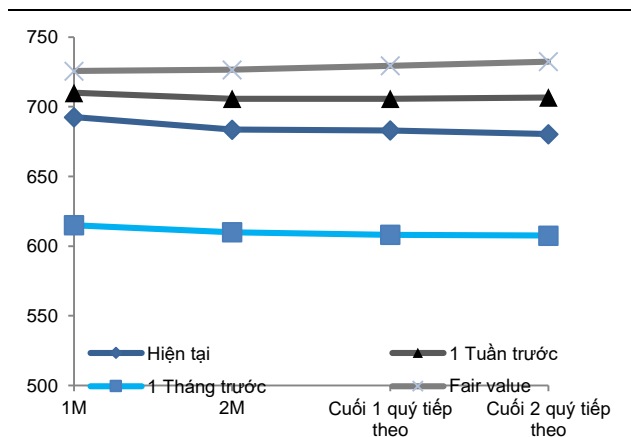
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



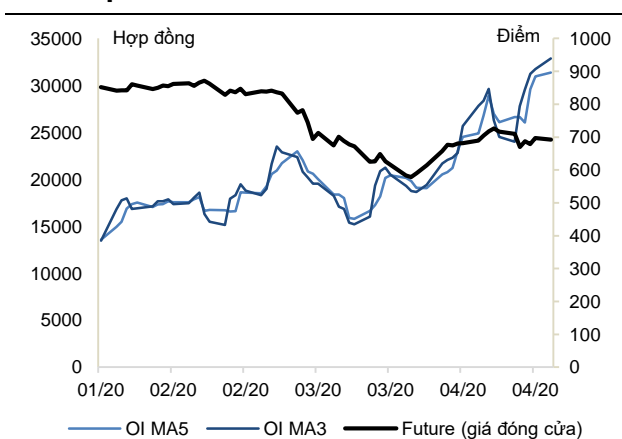
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



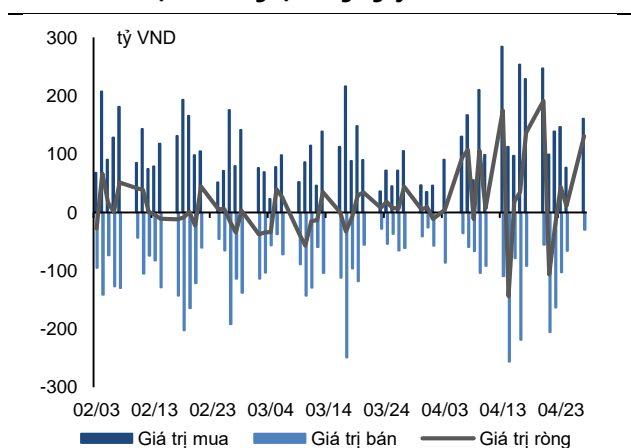
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 6. Open interest



Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 7. 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 hoá	Tỷ trọng	Giá hiện tại	% tại ngày	PER	PBR	KLGD 3 tháng	SH nước ngoài	Cao 52 tuần	Thấp 52 tuần
BID	NHTMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Tài chính	141,173	1.1%	35,100	-2.5%	14.8	1.9	1,217	18%	55,800	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	34,481	0.6%	46,450	-1.2%	28.5	1.8	469	29%	88,600	32,300
CTD	CTCP Xây dựng Coteccons	Công nghiệp	4,883	0.4%	64,000	5.6%	8.0	0.6	234	46%	121,500	44,000
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	70,186	1.2%	18,850	-1.8%	7.5	0.9	7,673	30%	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	18,564	3.0%	15,100	-1.3%	21.4	1.2	293	30%	19,100	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	34,561	5.2%	50,700	-0.6%	10.9	2.5	2,036	49%	61,300	40,100
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	122,876	1.2%	64,200	-1.4%	11.0	2.4	617	3%	114,500	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	19,801	2.6%	20,500	-0.5%	5.6	1.0	1,741	22%	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	60,606	6.9%	21,950	-0.7%	7.9	1.3	8,206	37%	26,462	15,250
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	37,859	4.3%	15,700	-2.2%	4.6	0.9	7,426	23%	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	68,383	5.2%	58,500	-1.7%	12.3	1.6	1,964	36%	91,600	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	37,222	4.6%	82,200	-1.0%	9.5	3.0	1,358	49%	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	51,192	3.4%	52,800	-0.4%	14.9	2.3	583	6%	65,100	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	47,871	0.8%	40,200	-2.8%	11.5	2.1	729	13%	67,500	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	13,061	2.0%	58,000	-2.5%	11.1	2.6	806	49%	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	23,185	0.9%	9,900	3.7%	9.6	0.9	3,956	11%	16,400	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	9,457	1.0%	30,500	-0.3%	5.8	0.9	736	49%	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	2,202	0.2%	3,880	4.6%	12.4	0.4	10,503	2%	34,800	3,040
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	115,431	2.4%	180,000	0.0%	24.1	6.1	81	63%	291,000	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,038	0.7%	13,700	-2.5%	27.0	1.1	2,190	6%	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	7,872	0.9%	13,100	-1.1%	8.5	0.8	3,203	51%	22,672	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	16,215	3.1%	8,990	-1.2%	6.8	0.6	11,122	10%	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	59,677	7.3%	17,050	-0.3%	5.9	1.0	2,768	22%	25,500	14,000
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	247,753	3.7%	66,800	-3.0%	13.8	2.9	1,268	24%	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	212,174	4.6%	64,500	-0.8%	9.9	3.8	871	15%	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	311,184	8.0%	92,000	-1.1%	39.8	4.0	914	14%	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	59,456	5.6%	113,500	-1.5%	14.4	3.9	369	19%	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	179,014	10.7%	102,800	0.0%	18.8	6.5	1,512	59%	137,600	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	51,193	6.8%	21,000	2.4%	5.6	1.1	4,434	23%	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	53,399	1.8%	23,500	-2.1%	19.2	2.0	2,435	32%	37,950	16,900

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 © 2020 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.