

Biên độ dao động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 giảm 1.5%, đóng cửa tại 803 điểm với chỉ 1 mã tăng. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, chỉ HPG (+2.8%) đóng góp vào đà tăng chỉ số trong khi VNM (-0.5%), VIC (-1.6%), VPB (-2.2%) và TCB (-4.3%) tạo áp lực giảm điểm lên chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, lực mua tăng mạnh với giá trị mua ròng ghi nhận ở mức 100 tỷ đồng. Cụ thể, nhóm này tập trung mua VNM, VCB, VHM, VRE và VPB trong khi HPG, VJC, MBB, STB và SSI bị bán mạnh nhất trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Biên độ dao động

VN30F2006 bước vào giai đoạn điều chỉnh ngắn hạn và khả năng cao sẽ duy trì dao động trong vùng 740 điểm đến 790 điểm. Cụ thể, MA20 trùng lấp MA5 (đồ thị ngày) tại vùng 740 điểm. Bên cạnh đó, mẫu nến Doji tại vùng 790 điểm sẽ là ngưỡng kháng cự quan trọng và xác nhận sự tiếp tục của xu hướng tăng khi bị phá vỡ. Đáng chú ý, Stochastic đã cắt xuống trên đồ thị giờ, tín hiệu cho sự suy yếu trong ngắn hạn của đà tăng. Trong trường hợp này, traders nên áp dụng chiến lược trading trong biên độ hẹp.

Chiến lược đầu tư:

Mua VN30F2006 tại vùng 740 điểm, mục tiêu tại 790 điểm và dừng lỗ lập tức tại 730 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	Thời gian còn lại
VN30 Index	803.1	-1.5					
VN30F2006	768.9	-2.2	183,398	15,602	816	18/06/20	27
VN30F2007	760.5	-6.7	1,183	371	734	16/07/20	55
VN30F2009	757.0	-1.7	246	555	737	17/09/20	118
VN30F2012	753.0	-2.7	296	169	740	17/12/20	209

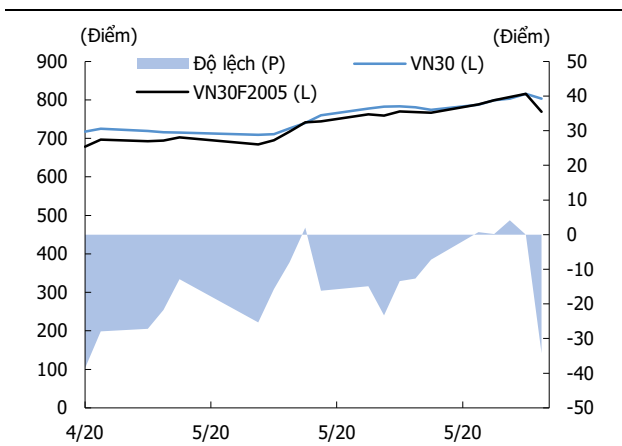
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đặng Lê

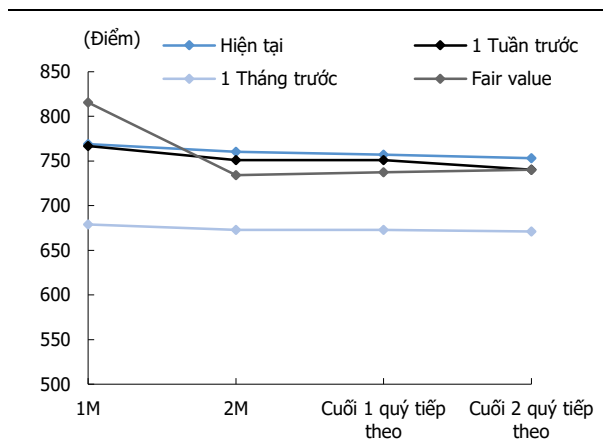
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

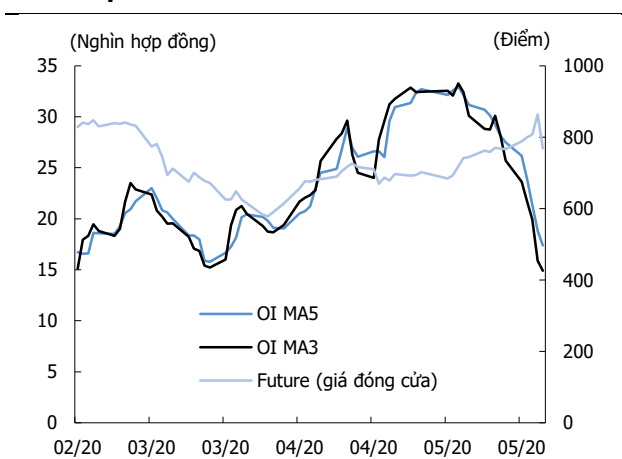
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

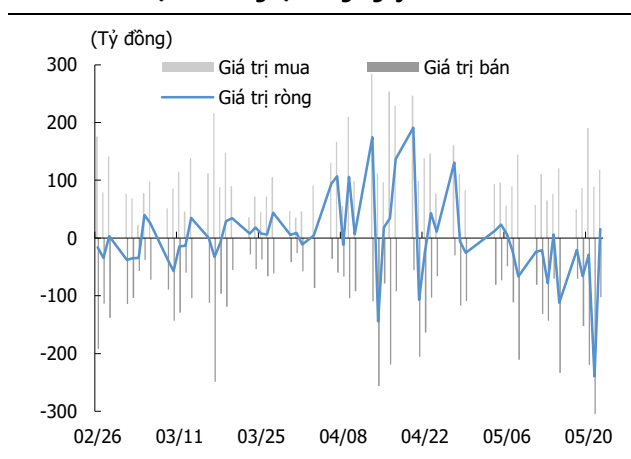
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai

Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 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
BID	NHTMCP Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Tài chính	158,065	1.0	39,300	(1.0)	18.4	2.1	1,358	18	55,800	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	36,485	0.5	49,150	(1.9)	42.1	1.9	631	28	88,600	32,300
CTD	CTCP Xây dựng Coteccons	Công nghiệp	5,196	0.4	68,100	(2.0)	8.5	0.6	259	47	116,000	44,000
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	84,894	2.8	22,800	(0.7)	9.1	1.1	7,091	30	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	20,777	2.9	16,900	(2.9)	21.8	1.3	387	30	19,100	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	37,981	5.0	48,450	(1.7)	11.6	2.6	2,515	49	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	141,441	1.2	73,900	(1.5)	12.7	2.8	782	3	113,500	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	23,086	2.6	23,900	(4.6)	6.5	1.2	1,613	21	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	75,239	7.4	27,250	2.8	9.9	1.5	8,681	37	27,450	15,250
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	41,597	4.1	17,250	(2.0)	5.1	1.0	7,068	23	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	72,475	4.7	62,000	(2.8)	15.7	1.7	2,015	39	91,600	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	38,489	4.1	85,000	(2.3)	9.7	2.9	1,500	49	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	51,677	3.0	53,300	(0.4)	14.9	2.3	760	6	65,100	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	55,254	0.8	46,400	(1.3)	53.4	2.9	941	13	67,500	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	14,232	1.9	63,200	(1.3)	12.0	2.9	894	49	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	23,653	0.8	10,100	(1.0)	9.8	0.9	4,937	11	16,400	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	9,674	0.8	31,200	(1.9)	6.3	1.0	668	49	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,981	0.2	3,490	(3.6)	12.9	0.3	11,976	2	31,900	3,040
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	111,583	2.0	174,000	(1.1)	25.9	6.5	90	63	291,000	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,742	0.6	14,900	(1.3)	105.9	1.2	2,359	6	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	8,593	0.8	14,300	(0.3)	11.7	0.9	3,526	50	22,629	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	18,397	3.0	10,200	(2.9)	7.7	0.7	11,373	9	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	73,678	7.8	21,050	(4.3)	7.0	1.1	2,705	22	25,500	14,000
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	300,419	5.4	81,000	(0.2)	16.7	3.5	1,470	24	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	251,648	4.9	76,500	(1.9)	9.8	4.0	1,394	14	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	326,066	7.5	96,400	(1.6)	46.0	4.0	934	14	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	59,718	4.9	114,000	(0.9)	16.0	4.0	374	19	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	199,214	10.5	114,400	(0.5)	21.0	6.6	1,640	59	135,500	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	58,872	6.7	24,150	(2.2)	6.4	1.3	4,835	23	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	58,626	1.8	25,800	(1.9)	21.0	2.2	3,014	31	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.