

Chiến lược breakout

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.3%, đóng cửa tại 806.2 điểm với 18 mã không tăng. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VPB (+1.1%), HPG (+0.7%) và VNM (+0.2%) đóng góp vào đà tăng chỉ số trong khi VIC (0%) và TCB (-1.0%) tạo áp lực giảm điểm lên VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua tiếp tục chi phối với giá trị mua ròng ở mức 66 tỷ đồng. Cụ thể, VCB, VNM, VRE, CTG và HPG được mua mạnh nhất trong khi VIC, VJC, BVH, MSN và PLX bị nhóm này bán mạnh nhất trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Đi theo xu hướng tăng

VN30F2006 dao động tích lũy trong phiên giao dịch trước trong vùng 770 điểm đến 810 điểm. Cụ thể, hợp đồng này đóng cửa dưới MA5 (đồ thị ngày) và MA20 (đồ thị giờ) và tín hiệu đối lập từ Stochastic trên cả hai khung thời gian, đà tăng đã biến mất. Bên cạnh đó, VN30F2006 đã phá ngưỡng MA20 trên đồ thị giờ và MA20 chuyển sang đi ngang, tín hiệu cho giai đoạn điều chỉnh ngắn hạn. Tuy nhiên, MA20 cắt MA50 và di chuyển hướng lên, xu hướng tăng trung hạn vẫn duy trì. Đáng chú ý, Bollinger bands đã co lại, tín hiệu cho giai đoạn cân bằng giữa cung và cầu. Trong trường hợp này, traders chỉ nên mở vị thế mua khi ngưỡng 810 điểm bị phá vỡ.

Chiến lược đầu tư:

Mua VN30F2006 tại vùng 810 điểm khi ngưỡng này bị phá vỡ, mục tiêu tại 835 điểm và dừng lỗ lập tức tại 800 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	806.2	0.3					
VN30F2006	785.0	-0.6	185,260	19,226	723	18/06/20	20
VN30F2007	777.0	0.1	671	221	723	16/07/20	48
VN30F2009	763.2	0.2	316	579	725	17/09/20	111
VN30F2012	762.9	0.0	77	160	728	17/12/20	202

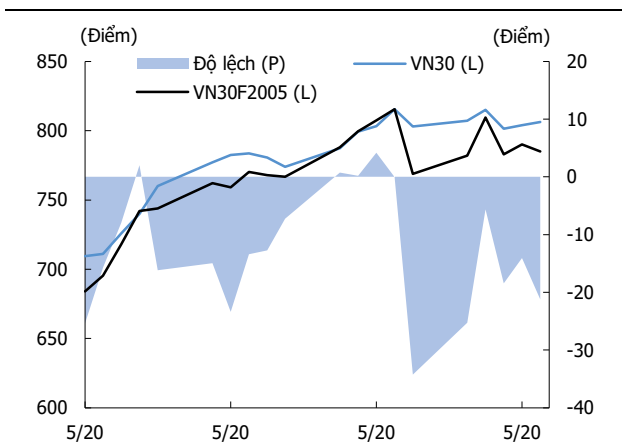
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đặng Lê

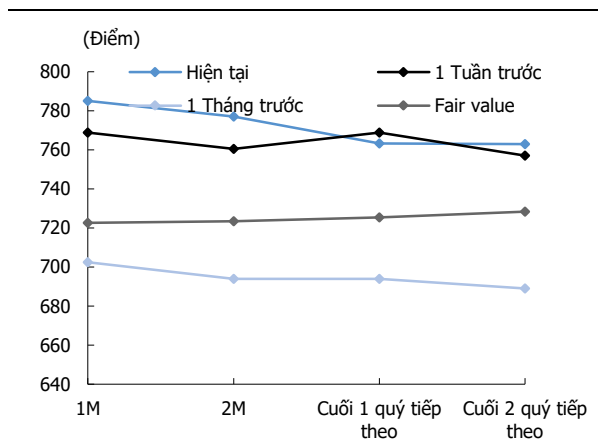
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

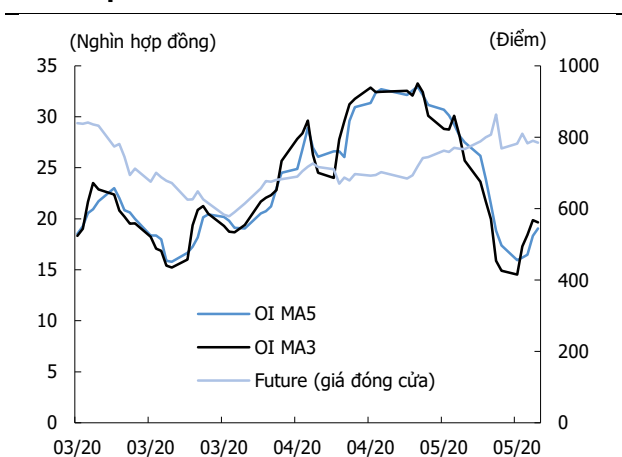
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

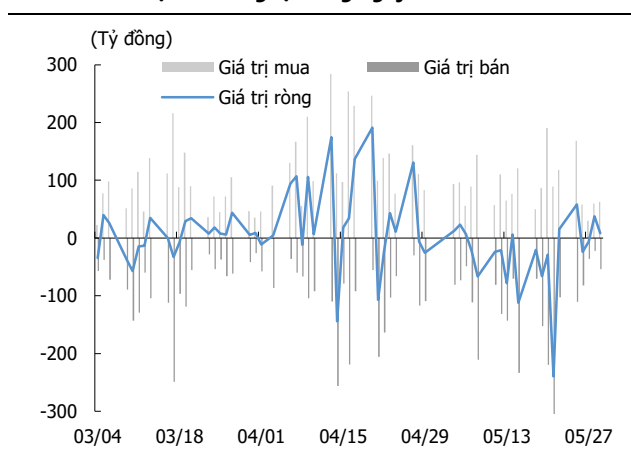
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	161,283	1.0	40,100	(1.5)	18.7	2.1	1,410	18	55,800	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	37,079	0.5	49,950	(0.9)	38.2	1.9	713	28	88,600	32,300
CTD	CTCP Xây dựng Coteccons	Công nghiệp	5,798	0.4	76,000	(1.0)	9.5	0.7	285	47	115,000	44,000
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	83,777	2.7	22,500	(0.2)	9.0	1.1	6,916	30	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	21,269	2.9	17,300	2.4	22.3	1.3	416	30	18,950	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	37,588	4.9	47,950	(0.1)	11.5	2.6	2,445	49	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	142,398	1.2	74,400	0.7	12.8	2.8	816	3	112,500	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	23,375	2.7	24,200	2.1	6.6	1.2	1,569	21	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	75,653	7.4	27,400	0.7	9.9	1.5	9,368	37	28,600	15,250
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	41,477	4.0	17,200	(0.6)	5.1	1.0	6,962	23	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	73,293	4.8	62,700	(0.2)	15.8	1.7	2,006	39	87,800	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	38,308	4.0	84,600	(0.1)	9.6	2.9	1,495	49	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	52,064	3.0	53,700	(1.1)	15.0	2.3	820	6	65,100	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	54,956	0.8	46,150	(1.4)	53.1	2.9	972	13	67,100	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	14,209	1.8	63,100	0.6	12.0	2.9	911	49	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	24,004	0.8	10,250	(1.4)	10.0	0.9	5,231	11	16,400	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	9,689	0.8	31,250	(0.6)	6.3	1.0	674	49	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,987	0.2	3,500	2.6	13.0	0.3	12,212	2	31,000	3,040
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	113,122	2.0	176,400	0.7	26.3	6.6	92	63	291,000	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,742	0.6	14,900	0.0	87.3	1.2	2,339	6	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	8,894	0.9	14,800	(0.3)	12.1	1.0	3,915	51	22,328	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	18,578	3.0	10,300	0.0	7.8	0.7	11,684	9	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	72,453	7.7	20,700	(1.0)	6.9	1.1	2,600	22	25,500	14,000
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	315,996	5.7	85,200	0.8	17.6	3.7	1,460	24	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	251,977	4.8	76,600	2.1	9.8	4.0	1,632	14	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	328,096	7.6	97,000	0.0	46.3	4.1	904	14	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	59,194	4.8	113,000	(0.3)	15.9	4.0	383	19	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	200,258	10.6	115,000	0.2	21.1	6.7	1,639	59	135,500	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	56,921	6.5	23,350	1.1	6.2	1.3	4,892	23	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	62,489	1.9	27,500	2.2	22.4	2.3	3,367	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.