

Mẫu hình chữ nhật ngắn hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.1%, đóng cửa tại 797 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, HPG (+2.1%) đóng góp vào đà tăng chỉ số trong khi VNM (-0.3%), TCB (-0.5%), VPB (-0.2%) và VIC (-1.0%) tạo áp lực giảm điểm lên VN30. Về hoạt động khối ngoại, áp lực bán chi phối trên VN30 với giá trị bán ròng ở mức 105 tỷ đồng. Cụ thể, VIC, MSN, VCB, VNM và BID bị bán mạnh nhất trong khi VHM, PLX, HPG, VRE và NVL thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng giảm ngắn hạn

VN30F2007 dao động trong biên độ có giới hạn trên và dưới lần lượt là vùng 835 điểm và 760 điểm. Đáng chú ý, hệ thống tín hiệu hai đường MA (MA20 và MA50) đã xác nhận cho xu hướng giảm. Ngoài ra, trên đồ thị ngày, Bollinger bands hướng xuống, tín hiệu cho giai đoạn điều chỉnh và dự địa tăng không còn. Bên cạnh đó, Bollinger bands trên đồ thị giờ đang thắt chặt, giai đoạn tích lũy trong phiên có thể xuất hiện khi cung cầu ở trạng thái cân bằng. Mặt khác, mẫu hình chữ nhật ngắn hạn được hình thành với cạnh trên và dưới tại vùng 795 điểm và 780 điểm. Trong trường hợp này, traders nên mở vị thế bán khi cạnh dưới mẫu hình chữ nhật bị phá vỡ.

Chiến lược đầu tư:

Bán VN30F2007 tại 778 điểm khi cạnh dưới mẫu hình chữ nhật bị phá vỡ, mục tiêu tại 760 điểm và dừng lỗ lập tức tại 785 điểm.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

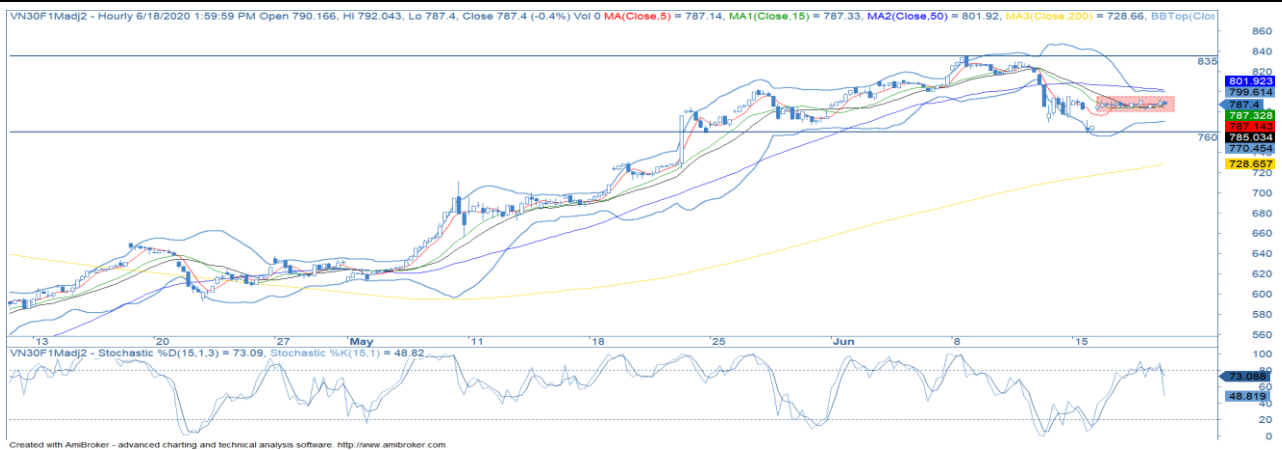
	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	797.1	0.1					
VN30F2006	797.1	-0.4	100,844	-	797	18/06/20	0
VN30F2007	787.4	-0.1	31,550	11,377	798	16/07/20	28
VN30F2009	777.1	-0.5	119	744	800	17/09/20	91
VN30F2012	775.0	0.0	88	276	803	17/12/20	182

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

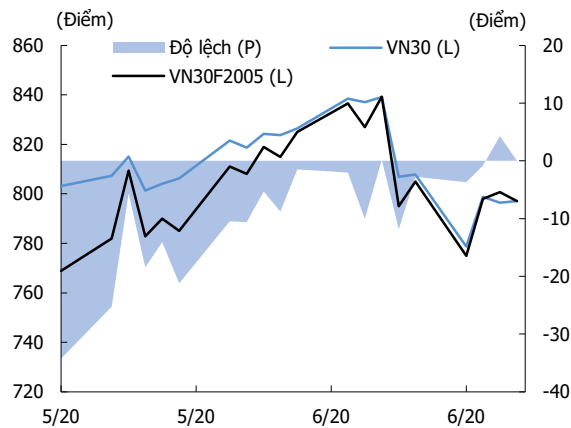
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



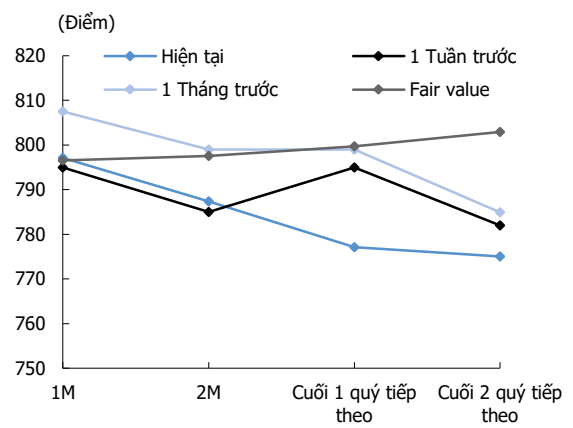
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



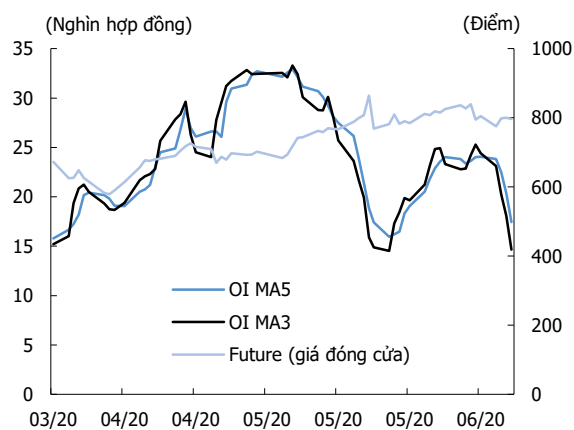
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



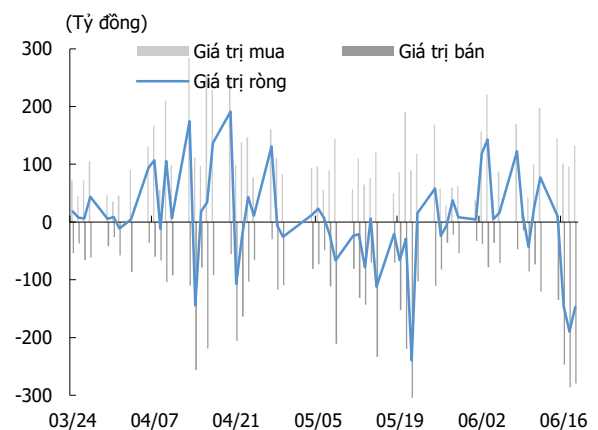
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 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	162,892	1.1	40,500	0.5	18.9	2.1	1,465	18	55,800	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	35,631	0.5	48,000	0.0	36.7	1.8	884	28	88,600	32,300
CTD	CTCP Xây dựng Coteccons	Công nghiệp	4,776	0.4	62,600	(0.2)	7.8	0.6	341	46	115,000	44,000
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	85,266	2.8	22,900	(0.4)	9.1	1.1	6,643	30	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	22,253	3.1	18,100	0.0	23.4	1.4	394	30	18,950	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	36,530	4.8	46,600	0.5	11.2	2.5	2,276	49	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	138,187	1.1	72,200	(1.0)	12.4	2.7	837	3	112,500	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	25,645	3.0	26,550	(1.1)	7.2	1.4	1,475	21	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	73,997	7.3	26,800	2.1	9.7	1.5	10,546	36	28,600	15,250
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	41,718	4.1	17,300	0.0	5.1	1.0	7,181	23	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	66,630	4.4	57,000	(0.9)	14.4	1.6	1,861	39	85,600	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	37,946	4.1	83,800	0.0	9.5	2.8	1,523	49	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	56,524	3.3	58,300	2.1	16.3	2.5	920	6	65,100	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	55,611	0.8	46,700	2.1	53.7	3.0	1,089	13	66,500	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	13,106	1.7	58,200	(0.2)	11.1	2.6	948	49	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	24,355	0.8	10,400	(1.4)	10.1	0.9	5,760	12	16,050	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	9,581	0.8	30,900	0.8	6.2	0.9	634	49	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,748	0.1	3,080	(2.2)	11.4	0.3	20,242	2	30,400	2,870
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	106,645	1.9	166,300	0.1	24.8	6.2	89	63	291,000	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,684	0.6	14,800	0.0	86.7	1.2	2,330	6	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	9,014	0.9	15,000	0.0	12.3	1.0	4,441	50	22,328	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	20,562	3.4	11,400	(1.7)	8.6	0.7	12,584	9	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	70,703	7.6	20,200	(0.5)	6.8	1.1	2,418	22	25,500	14,000
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	315,255	5.7	85,000	1.0	17.5	3.7	1,379	24	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	251,648	4.9	76,500	0.7	9.8	4.0	2,111	20	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	307,801	7.2	91,000	(1.0)	43.4	3.8	830	14	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	58,146	4.8	111,000	1.1	15.6	3.9	414	18	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	200,607	10.7	115,200	(0.3)	21.1	6.7	1,598	59	135,500	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	54,362	6.3	22,300	(0.2)	5.9	1.2	5,193	23	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	62,602	1.9	27,550	0.2	22.5	2.3	3,580	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.