

Mẫu hình chữ nhật

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 1.2%, đóng cửa tại 819.8 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VIC (+2.8%), HPG (+2.0%), TCB (+1.9%), VNM (+1.3%), và VPB (0.4%) đều đóng góp tích cực cho đà tăng của chỉ số. Về hoạt động khối ngoại, áp lực bán tiếp tục chi phối với giá trị bán ròng ở mức 20 tỷ đồng. Cụ thể, VCB, SAB, MSN, HPG, và VHM chịu áp lực bán mạnh nhất trong khi VNM, VRE, CTG, POW, và MBB thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Xu hướng tăng

VN30F2008 tích lũy trong phiên giao dịch trước, xác nhận mẫu hình chữ nhật với cạnh trên và dưới lần lượt là vùng 805 điểm và 783 điểm. Bên cạnh đó, hệ thống 2 đường MA (MA20 và MA50) đã xác nhận cho sự trở lại của xu hướng tăng ngắn hạn. Đáng chú ý, mẫu hình chữ nhật có xác suất breakout cao hơn so với breakdown. Ngoài ra, hợp đồng này duy trì dao động tích lũy quanh ngưỡng 805 điểm, đây là cơ hội mở vị thế mua với rủi ro thấp nhất.

Chiến lược đầu tư:

Mua VN30F2008 tại 805 điểm, mục tiêu tại 825 điểm và dừng lỗ lập tức tại 800 điểm để tránh hiện tượng bull trap.

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	819.8	1.2					
VN30F2007	816.0	(0.1)	96,189	-	820	16/07/20	0
VN30F2008	806.0	(0.5)	37,185	13,782	774	20/08/20	35
VN30F2009	801.2	(0.8)	124	544	775	17/09/20	63
VN30F2012	800.0	(0.8)	65	262	734	17/12/20	154

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

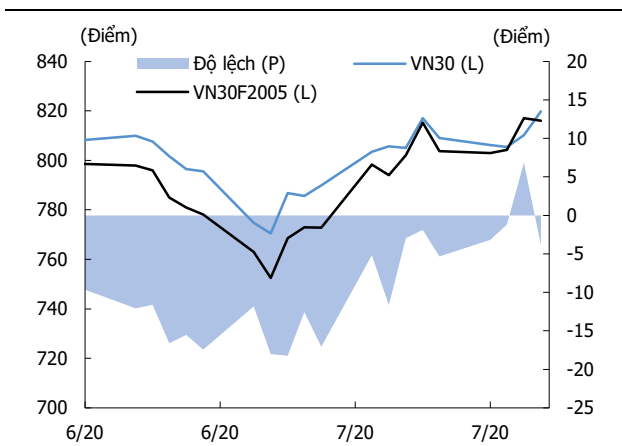
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



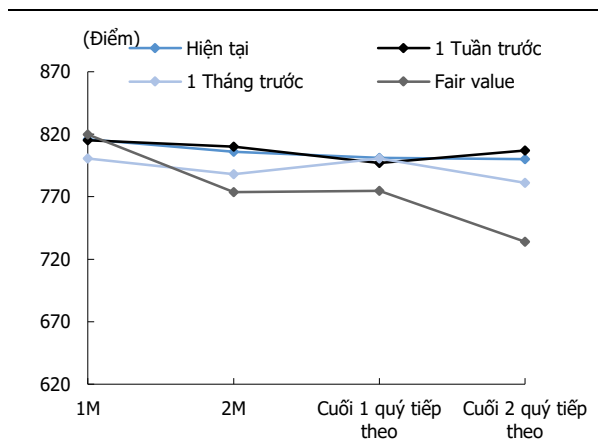
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



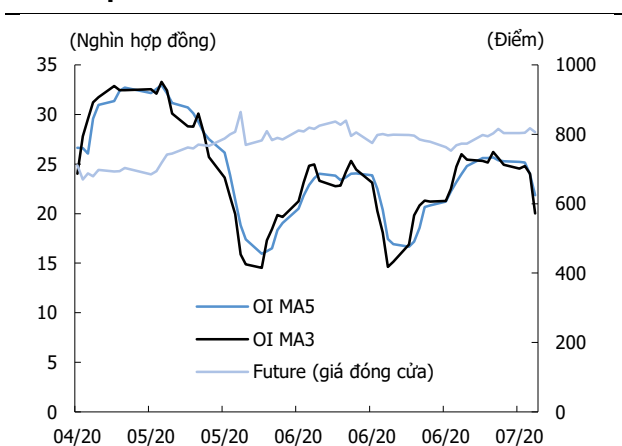
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



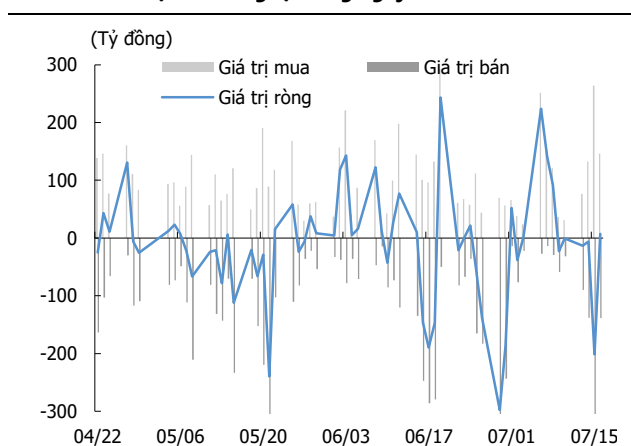
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	166,310	1.1	41,350	0.0	19.3	2.2	1,295	18	55,800	29,500
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	35,631	0.5	48,000	0.3	36.7	1.8	793	28	88,600	32,300
CTD	CTCP Xây dựng Coteccons	Công nghiệp	6,370	0.5	83,500	0.0	10.4	0.7	561	46	115,000	44,000
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	89,734	2.9	24,100	0.0	9.6	1.1	5,784	30	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	21,638	2.9	17,600	1.7	22.7	1.3	302	30	18,950	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	38,098	4.9	48,600	0.0	11.6	2.6	1,911	49	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	138,187	1.1	72,200	0.1	12.4	2.7	707	3	112,500	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	26,273	2.9	27,200	1.3	7.4	1.4	1,218	21	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	78,967	7.6	28,600	2.0	10.3	1.6	11,409	36	28,900	15,250
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	42,200	4.0	17,500	1.2	5.1	1.0	5,993	23	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	66,630	4.3	57,000	2.3	14.4	1.6	1,385	39	81,300	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	38,399	4.0	84,800	0.2	9.6	2.9	1,162	49	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	60,208	3.4	62,100	(0.8)	17.3	2.7	1,083	6	65,700	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	56,492	0.8	46,850	0.9	53.9	3.0	1,176	15	66,500	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	13,620	1.7	60,500	0.5	11.5	2.7	786	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	5,228	11	14,800	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	10,263	0.8	33,100	0.2	6.7	1.0	544	49	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,697	0.1	2,990	(0.3)	11.1	0.3	17,815	2	28,650	2,870
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	123,767	2.2	193,000	0.8	28.7	7.2	107	63	287,000	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,860	0.6	15,100	2.7	88.5	1.2	2,664	6	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	9,976	1.0	16,600	0.3	13.6	1.1	4,812	49	22,328	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	20,922	3.3	11,600	0.4	8.7	0.8	12,555	9	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	73,503	7.6	21,000	1.9	7.0	1.1	2,092	22	25,500	14,000
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	309,691	5.4	83,500	0.0	17.2	3.6	1,122	24	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	268,095	5.1	81,500	0.5	10.4	4.3	2,311	20	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	314,566	7.1	93,000	2.8	44.4	3.9	569	14	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	58,670	4.7	112,000	3.9	15.8	3.9	413	18	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	204,612	10.6	117,500	1.3	21.5	6.8	1,311	59	135,500	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	55,093	6.2	22,600	0.4	6.0	1.2	4,640	23	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	62,034	1.9	27,300	2.2	22.3	2.3	3,186	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.