true friend KIS Viet Nam Securities Corporation

Bản tin phái sinh

24/08/2020

Phá vỡ vùng dao động

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 1%, đóng cửa tại 794 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, VPB (+2.6%), TCB (+1.8%), HPG (+1.0%), VNM (+0.3%), và VIC (+0.1%) đều đóng góp vào đà tăng của chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, áp lực bán tăng mạnh, giá trị bán ròng ở mức 290 tỷ đồng. Cụ thể, VCB, VNM, VHM, HPG, và VIC là bộ 5 mã chịu áp lực bán nhiều nhất VN30 trong khi STB, TCH, và REE thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Phá vỡ vùng dao động

VN30F2008 phá vỡ vùng dao động hẹp, và tăng khả năng kiểm định lại vùng 800-805 điểm. Giai đoạn phục hồi vẫn chưa kết thúc, xác nhận bởi tín hiệu 2 đường MA (MA50 và MA200). Tuy nhiên, xu hướng phục hồi trong ngắn hạn sẽ diễn ra chậm do MA20 và MA50 đang hội tụ. Đáng chú ý, ngưỡng 780 điểm là ngưỡng hỗ trợ quan trọng. Trong trường hợp này, traders chỉ nên mở vị thế mua do xu hướng tăng được cho là bền vững.

Chiến lược đầu tư:

785-790 điểm là vùng giá tốt cho traders trở lại vị thế mua (VN30F2009), mục tiêu tại 800-805 điểm và dừng lỗ lập tức tại 780 điểm.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai (điểm, %, hợp đồng)

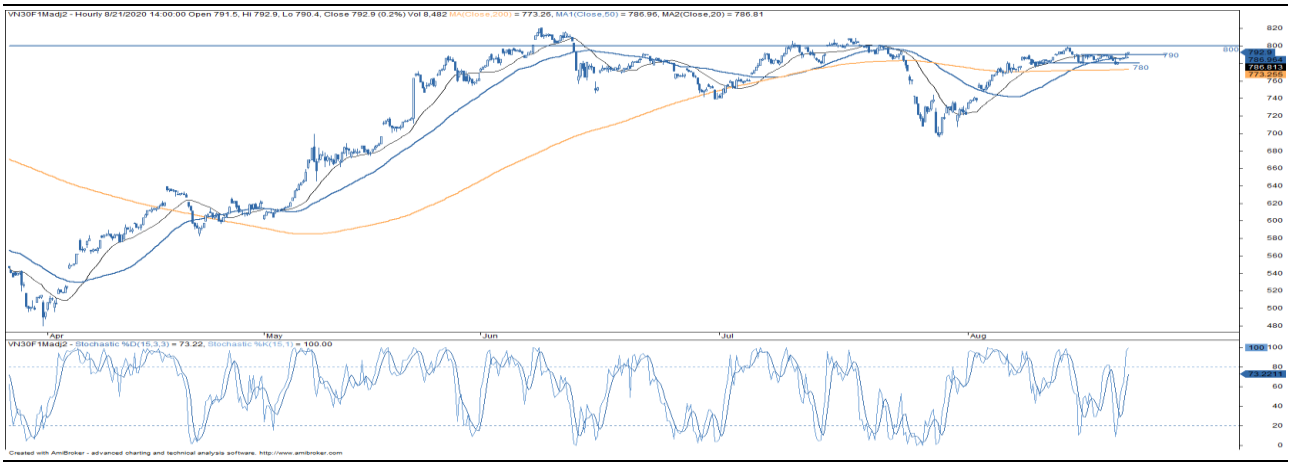
	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	793.6	1.0					
VN30F2009	792.9	1.0	145,073	26,634	786	17/09/20	27
VN30F2010	788.5	1.5	472	116	684	15/10/20	55
VN30F2012	783.9	0.5	76	378	644	17/12/20	118
VN30F2103	784.0	1.2	39	72	646	18/03/21	209

Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê
dang.lh@kisvn.vn

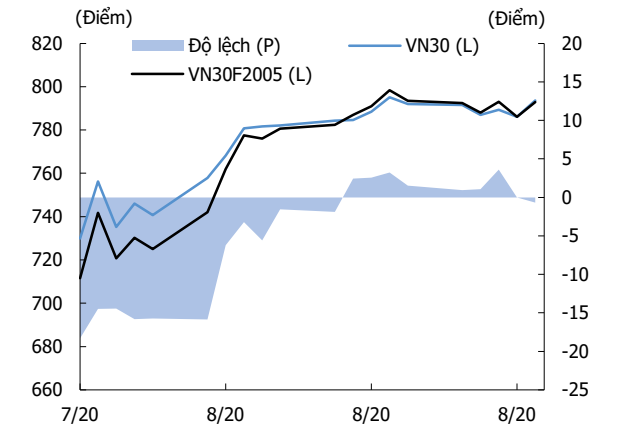
VUI LÒNG THAM KHẢO MIỄN TRỪ TRÁCH NHIỆM Ở CUỐI BÁO CÁO

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30



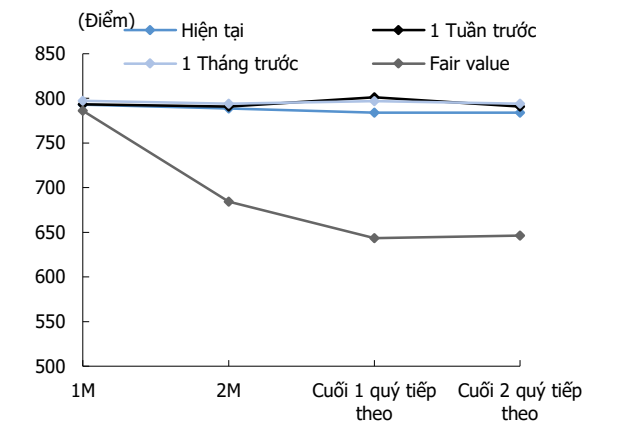
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread



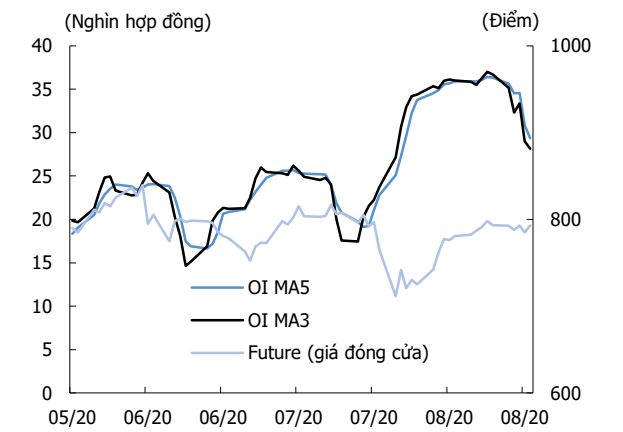
Nguồn: Bloomberg, KIS

Hình 3. Đường cong giá hợp đồng tương lai



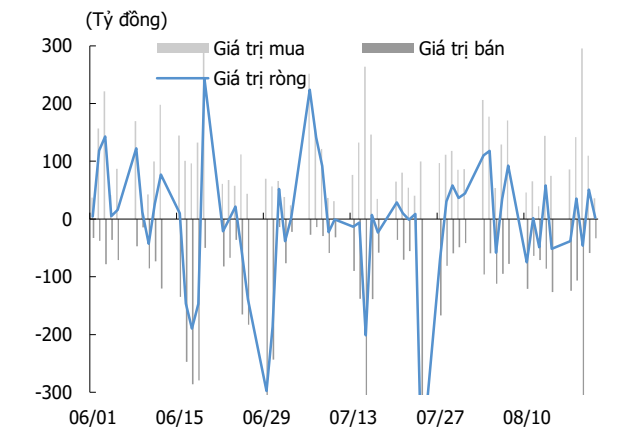
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	156,658	1.02	38,950	1.8	18.3	2.05	1,059	17.7	55,800	29,500
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	90,479	2.95	24,300	4.3	8.1	1.12	4,759	30.0	28,450	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	20,839	2.89	16,950	0.0	29.9	1.29	219	29.9	18,950	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	37,157	4.85	47,400	0.7	11.1	2.48	1,484	49.0	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	137,804	1.12	72,000	1.4	13.9	2.63	592	3.3	109,000	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	26,273	3.00	27,200	1.3	6.4	1.26	1,000	20.8	30,100	16,100
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	80,678	7.90	24,350	1.0	9.3	1.54	14,487	42.9	24,750	12,708
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	13,137	1.29	23,850	2.4	12.3	1.74	614	43.6	26,095	16,667
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	41,718	4.09	17,300	1.5	4.9	0.95	4,924	23.0	23,900	13,150
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	61,788	3.51	52,600	1.2	16.2	2.66	1,341	38.6	81,000	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	37,131	3.94	82,000	0.4	9.8	2.60	907	49.0	129,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	61,122	3.49	63,000	0.2	15.9	2.67	1,234	5.9	65,700	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	56,131	0.82	46,550	0.4	105.6	2.88	837	14.7	63,200	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	12,674	1.66	56,300	1.3	12.2	2.70	601	49.0	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	23,536	0.77	10,050	0.5	10.9	0.84	3,986	11.3	13,950	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	11,038	0.90	35,600	0.8	7.4	1.05	478	49.0	40,150	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,271	0.21	2,240	0.9	8.1	0.22	17,284	2.6	28,650	2,050
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	115,174	2.07	179,600	0.0	28.4	6.24	125	63.2	279,400	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	8,273	0.54	14,100	1.4	25.1	1.14	3,040	5.6	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	8,834	0.87	14,700	2.4	8.6	0.91	5,180	48.8	20,431	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	19,930	3.09	11,050	3.8	8.2	0.73	12,083	9.2	12,700	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	71,228	7.56	20,350	1.8	6.6	1.06	1,793	22.5	25,500	14,000
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,136	0.64	20,200	1.0	8.9	1.47	3,040	4.3	45,550	16,250
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	307,466	5.52	82,900	(0.1)	16.9	3.44	806	23.7	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	261,516	5.05	79,500	(0.6)	11.7	3.81	2,135	20.7	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	291,227	7.87	86,100	0.1	38.2	3.62	433	13.8	126,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	52,174	4.26	99,600	0.0	28.7	3.48	372	17.8	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	201,303	10.14	115,600	0.3	20.9	6.68	1,108	58.7	135,500	83,700
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	53,387	6.10	21,900	2.6	5.3	1.12	3,720	23.4	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	60,216	1.86	26,500	0.6	25.1	2.17	2,754	30.7	36,300	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 hiên 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.