

Ngày đáo hạn

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 1.6%, đóng cửa tại 892.2 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, TCB (+6.8%), VPB (+2.6%), HPG (+1.3%), VIC (+1.0%), và VNM (+0.3%) đóng góp đáng kể cho đà tăng của chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động bán chi phối với giá trị bán ròng ở mức 433 tỷ đồng. Cụ thể, MSN, TCB, và CTG chịu áp lực bán mạnh nhất trong khi VHM, HPG, và VIC thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Ngày đáo hạn

VN30F2010 tăng mạnh trong phiên giao dịch trước và tăng khả năng kiểm định vùng 900 điểm. MA50 và MA200 di chuyển hướng lên và phân tách nhau ở mức độ ổn định, xu hướng tăng bền vững. Tuy nhiên, hợp đồng này đã phá vỡ band trên (Bollinger bands) (Đồ thị ngày và giờ) và MA5 di chuyển xa các đường MA chủ đạo, hoạt động trading đang ở mức cao và điều chỉnh mạnh trong phiên sẽ xuất hiện. Vị thế mua mới sẽ có tỉ lệ risk/reward không phù hợp.

Chiến lược đầu tư:

Trong trường hợp này, traders nên đứng ngoài quan sát và chờ điểm mua tốt nhất từ hợp đồng VN30F2011.

Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

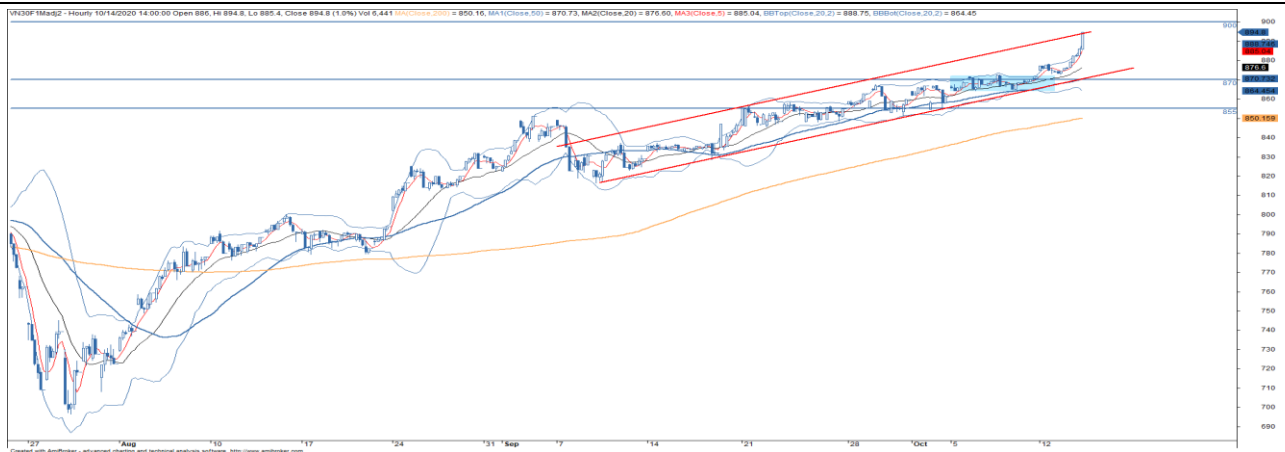
(điểm, %, hợp đồng)

	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	892.2	1.6					
VN30F2010	894.8	2.1	93,254	29,282	711	15/10/20	3
VN30F2011	888.5	1.5	9,146	7,600	611	19/11/20	38
VN30F2012	887.7	1.7	213	918	596	17/12/20	66
VN30F2103	882.8	1.6	61	315	596	18/03/21	157

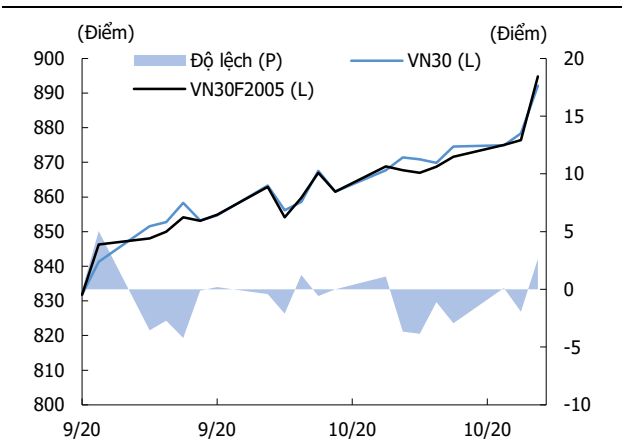
Nguồn: Bloomberg, KIS

Đăng Lê

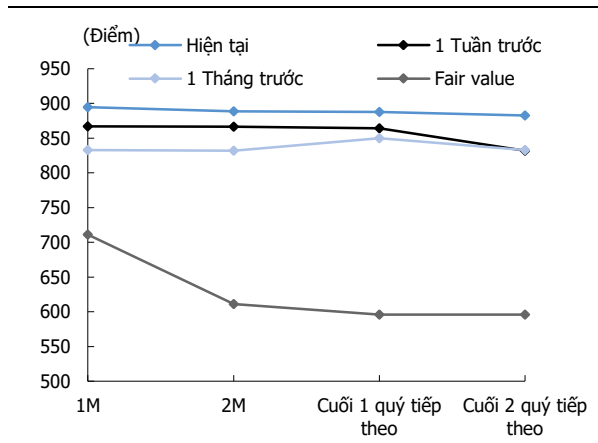
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

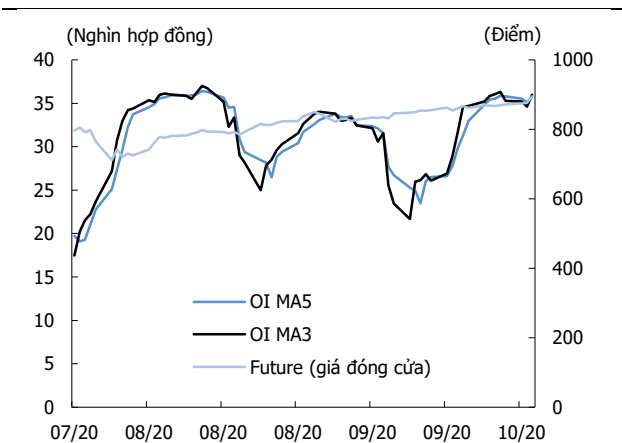
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

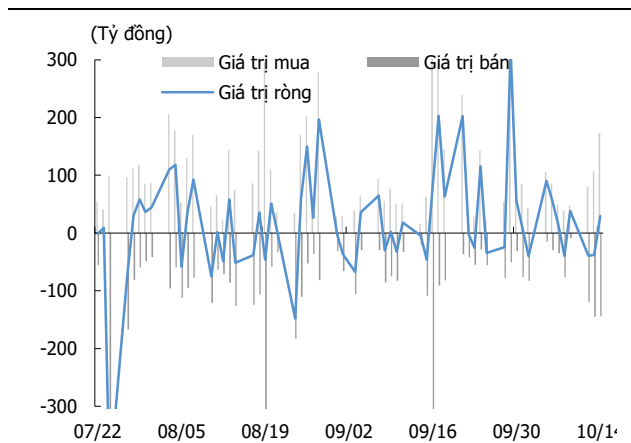
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	172,545	1.00	42,900	4.0	20.1	2.26	1,192	17.4	55,800	29,500
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	111,702	3.24	30,000	(1.8)	10.0	1.39	5,324	29.9	31,000	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	21,392	2.64	17,400	0.0	30.7	1.32	275	29.9	18,950	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	39,979	4.64	51,000	0.6	11.9	2.67	1,694	49.0	53,304	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	143,929	1.04	75,200	0.3	14.5	2.75	668	3.1	109,000	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	30,451	3.09	24,250	1.0	7.4	1.46	1,490	20.3	25,100	12,385
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	93,932	8.18	28,350	1.3	10.8	1.79	13,680	34.0	28,750	12,708
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	13,411	1.17	24,000	0.6	12.3	1.75	572	41.6	26,095	16,667
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	48,946	4.26	17,650	0.9	5.8	1.12	6,096	23.0	20,783	11,435
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	93,975	4.77	80,000	7.0	24.6	4.04	1,623	38.1	80,000	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	49,342	4.66	109,000	2.6	13.1	3.46	913	49.0	129,100	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	61,105	3.06	62,000	0.0	15.7	2.63	1,338	5.7	65,700	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	60,331	0.78	49,500	0.3	57.1	2.99	808	16.1	60,700	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	14,160	1.64	62,900	0.6	13.6	3.01	616	49.0	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	23,887	0.69	10,200	(0.5)	10.9	0.85	4,170	10.5	13,950	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	12,743	0.92	41,100	(1.3)	8.6	1.21	471	49.0	42,600	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,288	0.19	2,270	(1.7)	8.1	0.22	8,113	2.1	25,750	2,050
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	121,843	1.95	190,000	3.3	30.0	6.61	133	63.2	262,500	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	9,329	0.54	15,900	(2.8)	25.7	1.28	3,701	5.2	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	10,877	0.95	18,100	3.1	10.5	1.12	5,494	50.2	19,224	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	24,349	3.36	13,500	0.4	10.0	0.89	12,740	9.2	14,400	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	79,978	7.55	22,850	6.8	7.4	1.19	3,332	22.5	25,500	14,000
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,454	0.60	21,100	0.7	9.3	1.54	5,572	4.3	45,550	16,250
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	327,123	5.22	88,200	2.0	17.9	3.66	1,003	23.6	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	258,227	4.43	78,500	0.5	11.7	3.78	1,823	22.0	102,300	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	321,331	7.73	95,000	1.0	40.7	3.81	478	13.8	122,500	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	54,794	3.98	104,600	(0.4)	30.1	3.66	382	17.5	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	224,429	10.05	107,400	0.3	23.3	7.45	1,606	58.0	112,917	69,750
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	58,506	5.95	24,000	2.6	5.8	1.23	4,242	23.4	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	62,148	1.71	27,350	0.6	25.9	2.24	2,602	30.7	35,850	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.