

Độ nhiễu

Thông tin chỉ số VN30

Chỉ số VN30 tăng 0.4%, đóng cửa tại 980 điểm. Với bộ 5 mã chiếm tỉ trọng cao nhất VN30, chỉ TCB (+2.4%) đóng góp đáng kể vào đà tăng của chỉ số trong khi VIC (0%), VNM (-0.6%), VPB (-0.7%), và HPG (-0.8%) có diễn biến kém tích cực hơn chỉ số VN30. Về hoạt động khối ngoại, hoạt động mua chiếm ưu thế với giá trị mua ròng ở mức 550 tỷ đồng. Cụ thể, CTG, VCB, và TCH chịu áp lực bán cao nhất trong khi VHM, VJC, và HPG thu hút phần lớn lực cầu ngoại trên VN30.

Đồ thị VN30 Future: Phản ứng tích cực tại vùng 960 điểm

VN30F2012 phản ứng tích cực với vùng 960 điểm, phá vỡ ngưỡng kháng cự 970-975 điểm và tăng khả năng kiểm định lại vùng 990-1,000 điểm. Cụ thể, vùng 990-1,000 điểm sẽ là vùng kháng cự trong ngắn hạn. Vùng hỗ trợ ngắn hạn và trong phiên lần lượt là vùng 900-920 điểm và 960 điểm. Đáng chú ý, MA20 duy trì hướng lên và Bollinger bands đã mở rộng, điều này hàm ý cho sự cải thiện của đà tăng.

Chiến lược đầu tư:

Mua VN30F2012 tại vùng 975 điểm, mục tiêu tại 990-1,000 điểm và dừng lỗ khi ngưỡng 960 điểm bị phá vỡ.

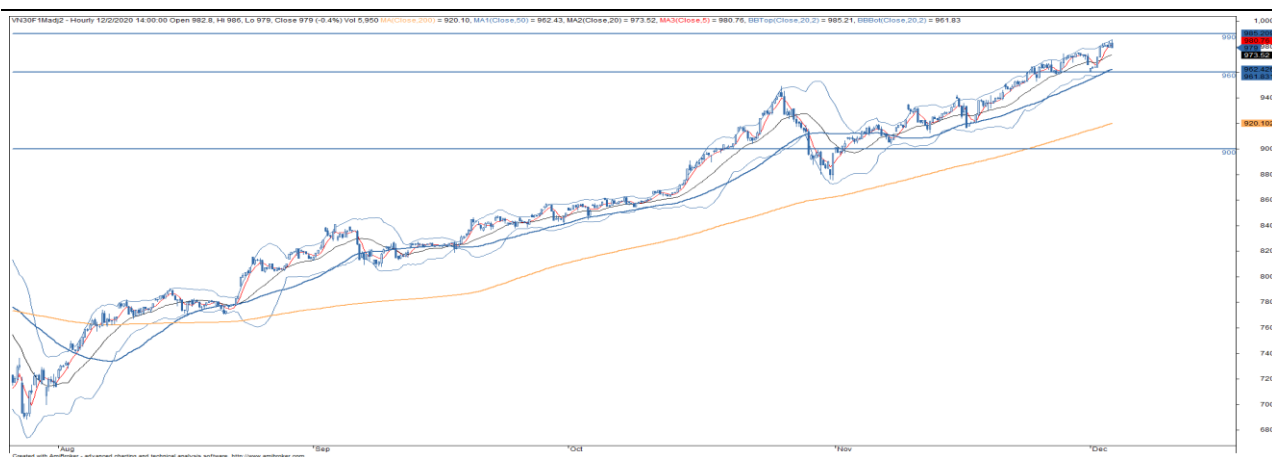
Bảng 1. Thống kê hợp đồng tương lai

(điểm, %, hợp đồng)

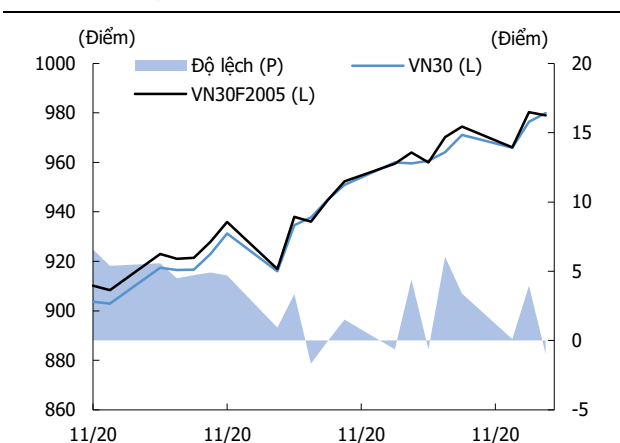
	Giá đóng cửa	+/- %	KL giao dịch	KL Mở	Fair Value	Ngày thanh toán	Thời gian còn lại
VN30 Index	980.0	0.4					
VN30F2012	979.0	(0.1)	99,864	33,985	941	17/12/20	17
VN30F2101	978.0	0.1	264	376	927	21/01/21	52
VN30F2103	977.5	0.1	86	322	927	18/03/21	108
VN30F2106	976.5	0.3	41	119	928	17/06/21	199

Nguồn: Bloomberg, KIS

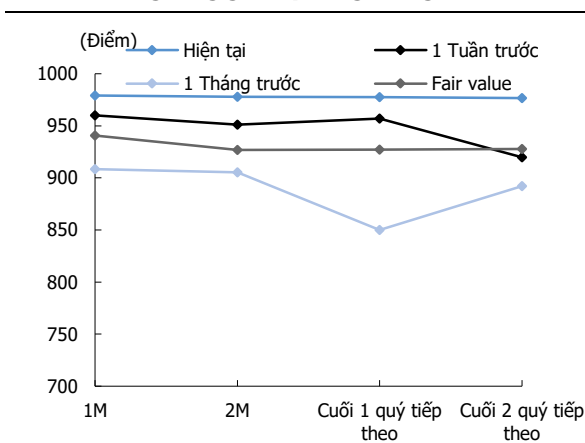
Đăng Lê
dang.lh@kisvn.vn

Hình 1. Đồ thị nến theo giờ - VN30

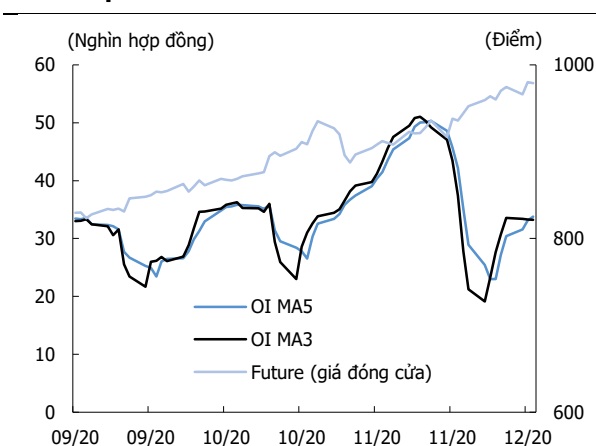
Nguồn: Bloomberg, KIS. Giá được điều chỉnh theo phương pháp Proportional Adjustment

Hình 2. Basis spread

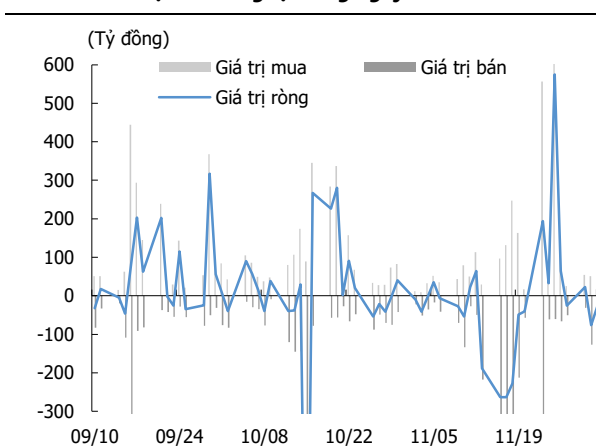
Nguồn: Bloomberg, KIS

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	166,914	0.87	41,500	(0.5)	19.5	2.13	1,855	17.3	55,800	29,500
CTG	NHTMCP Công thương Việt Nam	Tài chính	125,665	3.27	33,750	(0.4)	11.4	1.52	7,710	29.0	34,500	16,600
EIB	NHTMCP Xuất nhập khẩu Việt Nam	Tài chính	21,146	2.34	17,200	0.3	24.7	1.27	327	30.0	18,400	14,000
FPT	CTCP FPT	CNTT	43,585	4.53	55,600	0.7	13.1	2.89	2,084	49.0	56,700	34,870
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - CTCP	Dịch vụ tiện ích	160,772	1.04	84,000	0.6	17.7	3.44	974	3.0	101,400	53,900
HDB	NHTMCP Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	35,143	3.20	22,050	(1.1)	8.2	1.60	3,392	16.9	22,950	9,758
HPG	CTCP Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	116,959	8.36	35,300	(0.8)	10.9	2.13	17,859	33.0	38,500	12,708
KDH	CTCP Đầu tư và Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	15,004	1.27	26,850	1.1	13.0	1.94	1,093	39.0	27,600	16,667
MBB	NHTMCP Quân đội	Tài chính	59,207	4.62	21,350	2.4	7.1	1.28	8,341	22.9	21,400	11,435
MSN	CTCP Tập đoàn Masan	TD thiết yếu	97,734	4.44	83,200	0.2	40.3	4.75	2,380	33.6	98,000	46,400
MWG	CTCP Đầu tư Thế Giới Di Động	TD không thiết yếu	51,597	4.36	114,000	(1.7)	13.4	3.39	993	49.0	120,500	56,300
NVL	CTCP Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	59,659	2.71	60,500	(0.2)	10.4	2.36	1,397	5.4	65,700	49,100
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	62,038	0.89	50,900	0.6	74.6	3.04	652	15.7	58,100	35,100
PNJ	CTCP Vàng bạc Đá quý Phú Nhuận	TD không thiết yếu	17,335	1.80	77,000	(1.3)	16.8	3.54	949	49.0	92,500	45,000
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam	Dịch vụ tiện ích	25,292	0.66	10,800	6.9	15.9	0.90	5,566	9.1	13,150	6,850
REE	CTCP Cơ điện Lạnh	Công nghiệp	14,975	0.88	48,300	(0.3)	10.5	1.38	451	49.0	49,500	26,100
ROS	CTCP Xây dựng FLC FAROS	Công nghiệp	1,226	0.16	2,160	0.0	8.1	0.21	6,167	1.6	25,000	2,050
SAB	Tổng CTCP Bía - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	TD thiết yếu	126,204	1.80	196,800	1.7	31.2	6.37	109	63.1	237,500	111,500
SBT	CTCP Thành Thành Công - Biên Hòa	TD thiết yếu	11,148	0.58	19,000	2.7	27.1	1.58	3,811	6.2	22,700	11,600
SSI	CTCP Chứng khoán SSI	Tài chính	11,838	0.92	19,700	1.5	10.7	1.25	5,941	48.4	19,850	9,569
STB	NHTMCP Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	27,776	3.43	15,400	(0.3)	11.7	0.98	16,400	9.1	15,800	7,120
TCB	NHTMCP Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	87,854	7.99	25,100	2.4	7.7	1.25	14,701	22.5	25,300	14,000
TCH	CTCP Đầu tư Dịch vụ Tài chính Hoàng Huy	Công nghiệp	7,083	0.51	20,050	(2.4)	7.0	1.41	8,261	4.9	45,550	16,250
VCB	NHTMCP Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	346,780	4.96	93,500	1.6	20.2	3.71	1,064	23.7	95,000	56,600
VHM	CTCP Vinhomes	Bất động sản	280,267	4.74	85,200	2.3	12.4	3.74	2,416	21.9	93,500	52,000
VIC	Tập đoàn Vingroup - CTCP	Bất động sản	355,155	8.41	105,000	0.0	39.5	4.13	693	13.9	116,300	68,000
VJC	CTCP Hàng không Vietjet	Công nghiệp	62,599	4.07	119,500	1.3	30.1	4.48	505	18.3	148,800	93,200
VNM	CTCP Sữa Việt Nam	TD thiết yếu	227,771	9.33	109,000	(0.6)	22.8	7.76	1,897	58.1	112,600	69,750
VPB	NHTMCP Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	67,526	6.14	27,700	(0.7)	6.7	1.36	6,496	23.0	29,300	16,000
VRE	CTCP Vincom Retail	Bất động sản	64,761	1.75	28,500	0.9	28.5	2.29	4,125	30.9	35,350	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.