



Công ty Cổ phần Chứng khoán
Ngân hàng Đầu tư và Phát triển Việt Nam

Báo cáo PTKT mở rộng 15/10/2015

Thị trường chung

Mục lục

- Thị trường chung 2
- Phân tích kỹ thuật CTG 4
- Phân tích kỹ thuật IDI 5
- Phân tích kỹ thuật NTL 6

Nhóm thực hiện

Bùi Nguyễn Khoa
Chuyên gia Chiến lược
khoabn@bsc.com.vn

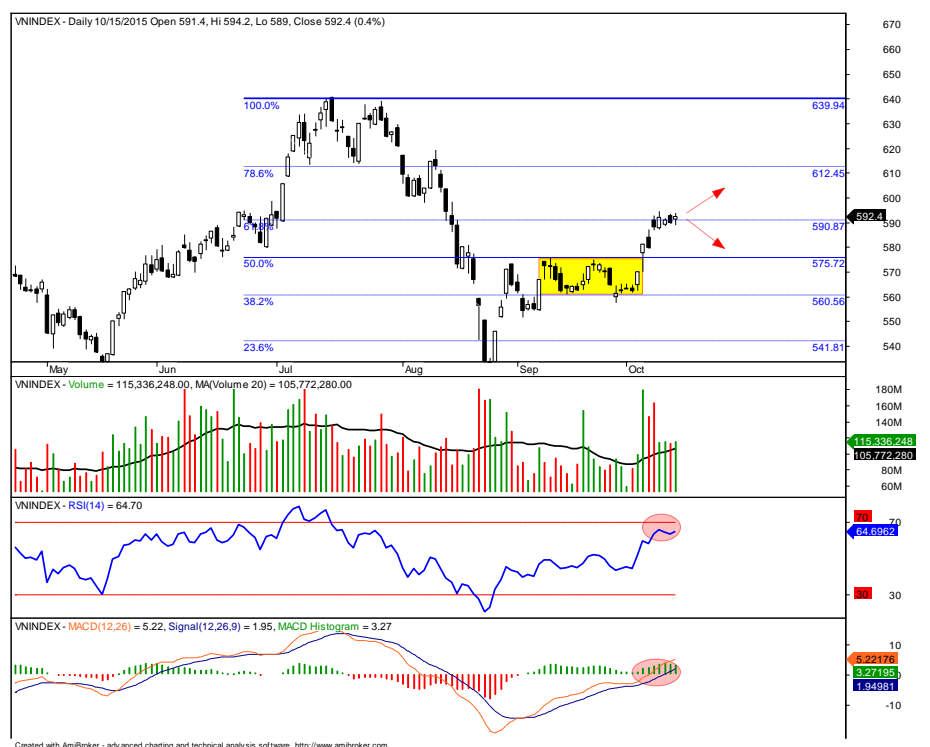
Đỗ Nam Tùng
Chuyên viên phân tích
tungdn@bsc.com.vn

Nguyễn Quốc Trường
Chuyên viên phân tích
truongnq@bsc.com.vn

Thông số kỹ thuật

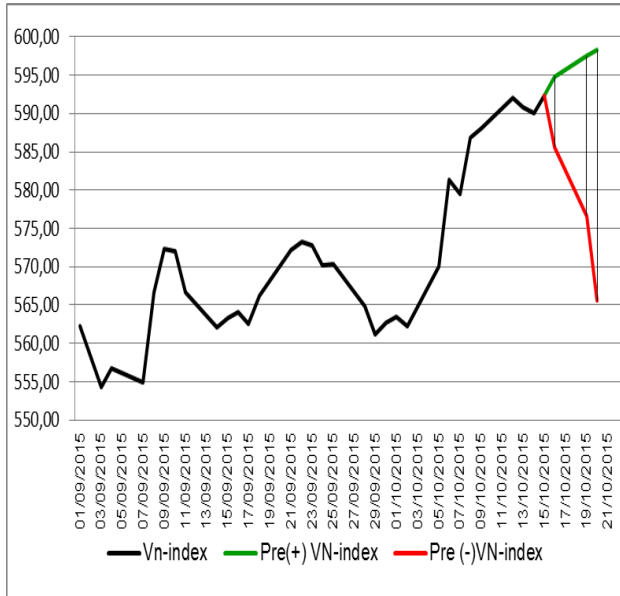
Xu hướng hiện tại	Tích lũy
Dự báo ngày mai	Giảm
MACD	Khả quan
RSI	Tích cực
Parabolic SaR	Khả quan
Ngưỡng hỗ trợ S1/S2	575/560
Ngưỡng kháng cự R1/R2	595/612

Đồ thị 1 Đồ thị kỹ thuật VN-Index



Báo cáo này chỉ là nguồn thông tin tham khảo. Vui lòng đọc kỹ phần Khuyến cáo sử dụng ở trang cuối.

Nguồn: Amibroker, BSC

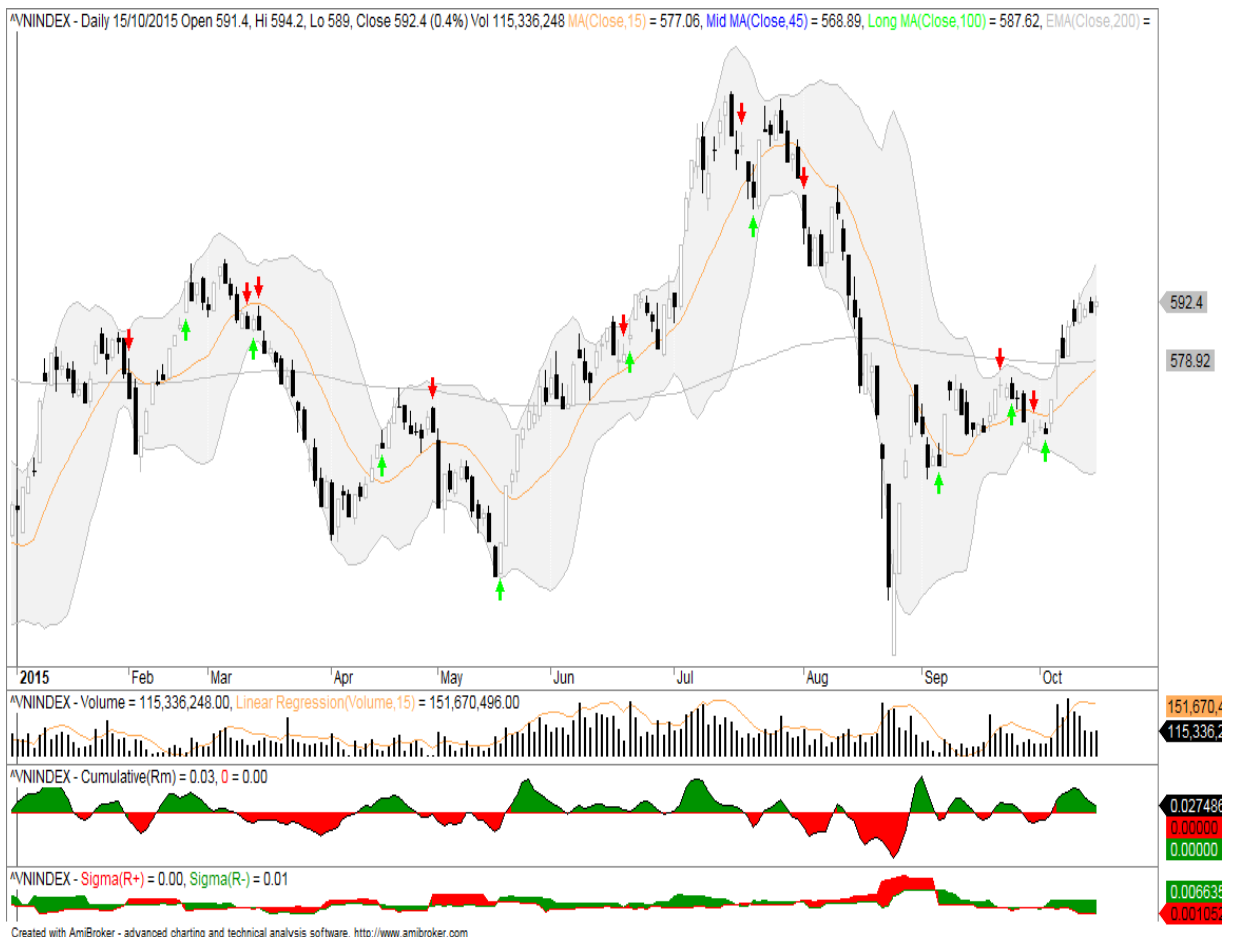


Vùng Dự báo của VN-Index trong 3 phiên tới

Term	Date	Pre(+)-VN-index	Pre(-)-VN-index
T+1	16/10/2015	594,79	585,68
T+2	19/10/2015	597,48	576,68
T+3	20/10/2015	598,28	565,58

Khả năng tăng/ giảm điểm và Tỷ lệ giải ngân

Số phiên tăng liên tiếp	1
Số phiên giảm liên tiếp	0
Xác suất giảm phiên tiếp theo	47,40%
Xác suất tăng phiên tiếp theo	52,60%
Tỷ lệ tiền mất / DM	71,31%
Tỷ lệ chứng khoán / DM	28,69%
Lợi suất tích lũy VN-index	2,75%
Biến động thị trường	An Toàn
Tổn thất thị trường dự kiến	581,52 điểm



Một số cổ phiếu “nóng” dưới lăng kính kỹ thuật

CTG – NH TMCP Công thương Việt Nam

Điểm nhấn kỹ thuật:

- Xu hướng hiện tại: Tăng
- Chỉ báo xu hướng MACD: Tích cực
- Chỉ báo RSI: Khả quan

Nhận định: CTG tiếp tục nằm trong xu hướng Tăng khi liên tục tạo các đáy sau thấp hơn đáy trước, và nền tảng giá đang nằm trên đường trendline màu đỏ. Đồng thời, CTG có một phiên tăng đột biến về giá và khối lượng, vượt qua ngưỡng kháng cự 20.3, tương ứng ngưỡng 50% Fibonacci Retracement 17.2 – 23.4.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư có thể tiếp tục mua thêm cổ phiếu CTG. Ngưỡng kháng cự tiếp theo là 22.1 và 23.4.

Đồ thị 2

Đồ thị kỹ thuật CTG



Nguồn: Amibroker, BSC

IDI – Đầu tư và Phát triển Đa Quốc Gia I.D.I

Điểm nhấn kỹ thuật:

- Xu hướng hiện tại: Tăng
- Chỉ báo xu hướng MACD: Tích cực
- Chỉ báo RSI: Tích cực

Nhận định: IDI đang bước vào xu hướng Tăng mạnh khi MACD đã vượt xa ngưỡng 0, đồng thời chỉ báo xung lượng RSI đã đi vào vùng quá mua. Ngưỡng kháng cự 8.3 đã bị phá vỡ, và đây là ngưỡng kháng cự rất mạnh của IDI kể từ tháng 4/2015.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư có sẵn IDI trong danh mục nên quan sát kỹ và canh bán IDI khi cổ phiếu này tạo đỉnh ngắn hạn và chỉ báo RSI rơi khỏi vùng quá mua 70.

Đồ thị 3

Đồ thị kỹ thuật IDI



Nguồn: Amibroker, BSC

NTL – CTCP Phát triển Đô thị Từ Liêm

Điểm nhấn kỹ thuật:

- Xu hướng hiện tại: Tăng
- Chỉ báo xu hướng MACD: Tích cực
- Chỉ báo RSI: Tích cực

Nhận định: NTL đang đối mặt với ngưỡng kháng cự mạnh 15.5, đây là đỉnh cũ của NTL trong tháng 7 và 8 vừa qua. Chỉ báo xung lượng RSI đang ở mức cao cho thấy NTL có thể sẽ điều chỉnh khá khi tiệm cận gần ngưỡng kháng cự trên.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư chưa vội vàng mua thêm NTL, nên đứng ngoài quan sát thêm.

Đồ thị 4

Đồ thị kỹ thuật NTL



Nguồn: Amibroker, BSC

Phụ lục

Trình bày thuật ngữ

Pre(+)VN-index Dự báo mức giá trên của VN-index

Pre(-)VN-index Dự báo mức giá dưới của VN-index

T+1 - 1 phiên tiếp theo

T+2 - 2 phiên tiếp theo

T+3 - 3 phiên tiếp theo

T+4 - 4 phiên tiếp theo

T+5 - 5 phiên tiếp theo

Công thức Kelly

Tỷ lệ tiền mặt / DM = $\frac{bp-(1-p)}{b} = 100\%$ - Tỷ lệ chứng khoán/ DM

Trong đó : p – xác suất phiên tăng điểm, b – lợi suất nếu thắng

Lợi suất tích lũy VN-index = $\Sigma(VN-index\ t - VN-index\ t-1 / VN-index\ t-1)$

Lợi suất tích lũy tham chiếu trên chỉ báo **Cumulative(Rm)**

Biến động thị trường An toàn(**Vùng xanh**) khi $\Sigma(R+) - \Sigma(R-) < 0$

Biến động thị trường Rủi ro(**Vùng đỏ**) khi $\Sigma(R+) - \Sigma(R-) > 0$

Mũi tên **xanh** cho biết thị trường đang đi vào vùng **an toàn**

Mũi tên **đỏ** cho biết thị trường đang đi vào vùng **rủi ro**

Tổn thất thị trường dự kiến là giá trị **VaR** độ tin cậy 95% theo phiên

Khuyến cáo sử dụng

Bản báo cáo này của Công ty Cổ phần Chứng khoán Ngân hàng Đầu tư và phát triển Việt Nam (BSC), chỉ cung cấp những thông tin về thị trường và về diễn biến của các cổ phiếu trên góc nhìn phân tích kỹ thuật. Báo cáo này không được xây dựng để cung cấp theo yêu cầu của bất kỳ tổ chức hay cá nhân riêng lẻ nào hoặc các quyết định mua bán, nắm giữ chứng khoán. Nhà đầu tư chỉ nên sử dụng các thông tin, phân tích, bình luận của Bản báo cáo như là nguồn tham khảo trước khi đưa ra những quyết định đầu tư cho riêng mình. Mọi thông tin, nhận định và dự báo và quan điểm trong báo cáo này được dựa trên những nguồn dữ liệu đáng tin cậy. Tuy nhiên Công ty Cổ phần Chứng khoán Ngân hàng đầu tư và phát triển Việt Nam (BSC) không đảm bảo rằng các nguồn thông tin này là hoàn toàn chính xác và không chịu bất kỳ một trách nhiệm nào đối với tính chính xác của những thông tin được đề cập đến trong báo cáo này, cũng như không chịu trách nhiệm về những thiệt hại đối với việc sử dụng toàn bộ hay một phần nội dung của bản báo cáo này. Mọi quan điểm cũng như nhận định được đề cập trong báo cáo này dựa trên sự cân nhắc cẩn trọng, công minh và hợp lý nhất trong hiện tại. Tuy nhiên những quan điểm, nhận định này có thể thay đổi mà không cần báo trước. Bản báo cáo này có bản quyền và là tài sản của Công ty Cổ phần Chứng khoán Ngân hàng Đầu tư và Phát triển Việt Nam (BSC). Mọi hành vi sao chép, sửa đổi, in ấn mà không có sự đồng ý của BSC đều trái luật. Bất kỳ nội dung nào của tài liệu này cũng không được (i) sao chụp hay nhân bản ở bất kỳ hình thức hay phương thức nào hoặc (ii) được cung cấp nếu không được sự chấp thuận của Công ty Cổ phần Chứng khoán BIDV.

BSC Trụ sở chính

Tầng 10, 11 – Tháp BIDV
35 Hàng Vôi – Hoàn Kiếm – Hà Nội
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

Chi nhánh Hồ Chí Minh

Tầng 9 – 146 Nguyễn Công Trứ
Quận 1, Tp. Hồ Chí Minh
Tel: +84 8 3821 8885
Fax: +84 8 3821 8510

<http://www.bsc.com.vn>
Bloomberg: BSCV <GO>