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

Báo cáo PTKT mở rộng

29/10/2015

Thị trường chung

Mục lục

Thị trường chung	2
Phân tích kỹ thuật HBC	4
Phân tích kỹ thuật ITD	5
Phân tích kỹ thuật HNM	6

Nhóm thực hiện

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

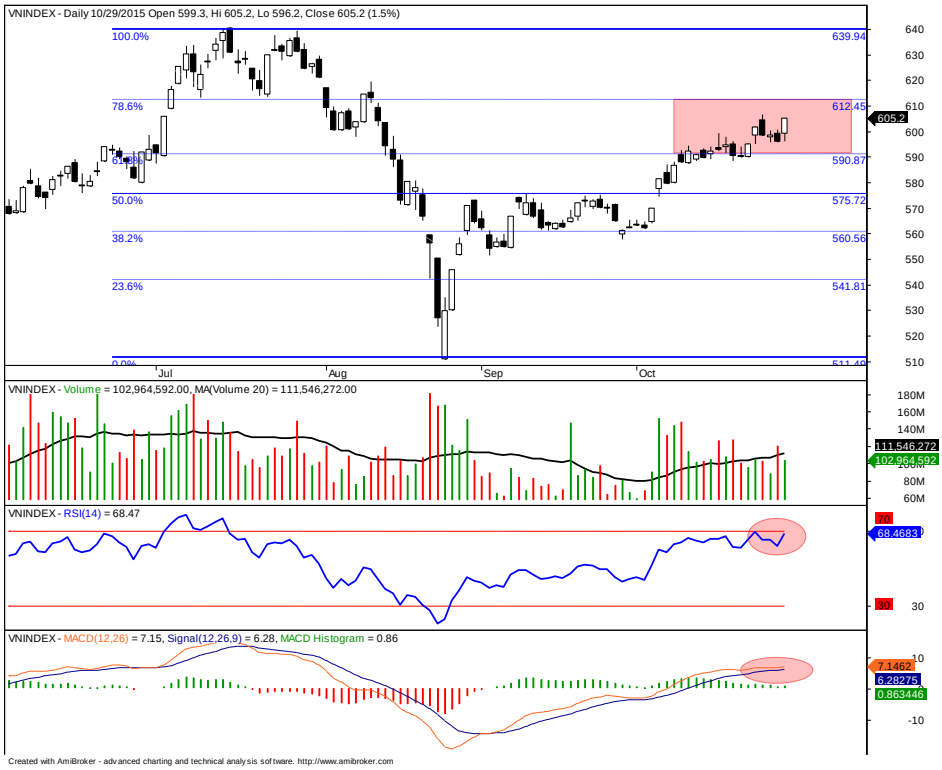
Đỗ Nam Tùng
Chuyên viên phân tích
tungdn@bsc.com.vn

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

Thông số kỹ thuật

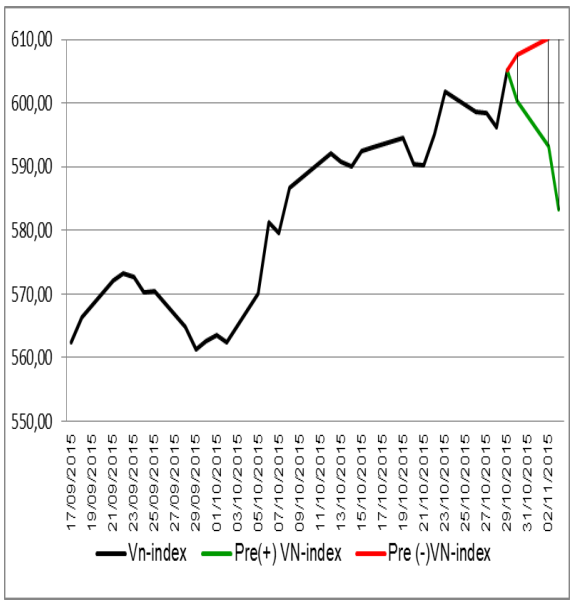
Xu hướng hiện tại	Tích lũy
Dự báo ngày mai	Tăng
MACD	Khả quan
RSI	Tích cực
Parabolic SaR	Khả quan
Ngưỡng hỗ trợ S1/S2	600
Ngưỡng kháng cự R1/R2	612

Đồ thị 1
Đồ thị kỹ thuật VN-Index



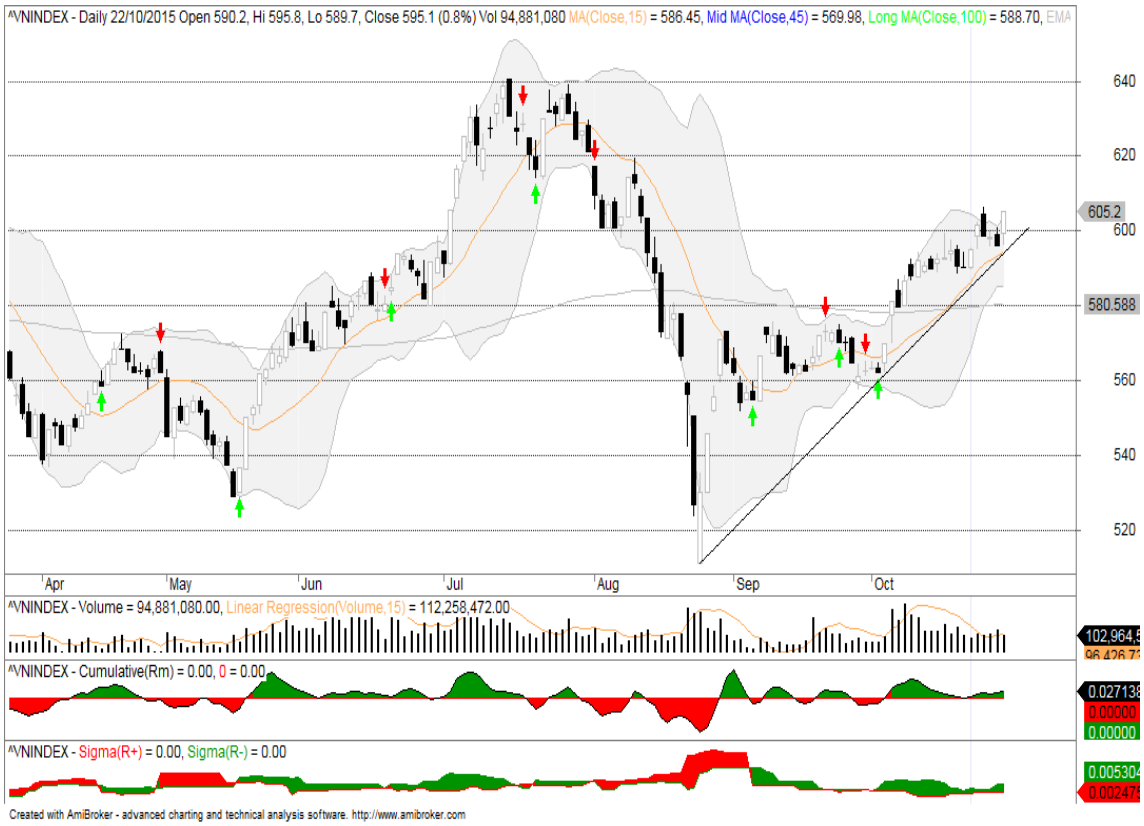
Nguồn: Amibroker, BSC

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



Vùng Dự báo của VN-Index trong 3 phiên tới			
Term	**Date**	**Pre(+)VN-index**	**Pre(-)VN-index**
T+1	*30/10/2015*	600,25	607,57
T+2	*02/11/2015*	593,28	610,15
T+3	*03/11/2015*	583,31	612,08

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	44,73%
Xác suất tăng phiên tiếp theo	55,27%
Tỷ lệ tiền mặt / DM	81,77%
Tỷ lệ chứng khoán / DM	18,23%
Lợi suất tích tũy VN-index	2,71%
Biến động thị trường	An Toàn
Tổn thất thị trường dự kiến	585,38 điểm



Một số cổ phiếu "nóng" dưới lăng kính kỹ thuật

HBC – CTCP Xây dựng và Kinh doanh Địa ốc Hoà Bình

Điểm nhấn kỹ thuật:

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

Nhận định: HBC đã vượt qua kháng cự 18,5 với khối lượng lớn, cho thấy cú bứt phá này đáng tin cậy. Chỉ báo RSI đã đi vào vùng quá mua, cho thấy HBC sẽ có nhiều rung lắc mạnh hơn trong các phiên tới.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư tạm thời quan sát thêm HBC và chờ mua tại các phiên điều chỉnh.

Đồ thị 2
Đồ thị kỹ thuật HBC

Nguồn: Amibroker, BSC

ITD – CTCP Công nghệ Tiên Phong

Điểm nhấn kỹ thuật:

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

Nhận định: ITD đang gặp ngưỡng kháng cự mạnh 18. Phiên hôm qua, mặc dù khối lượng giao dịch khá lớn nhưng ITD vẫn đóng cửa dưới giá 18 và tạo một nến có bóng trên dài, cho thấy lực cung đang khá mạnh.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư có sẵn ITD nên chốt lại một phần gần vùng kháng cự 18.

Đồ thị 3
Đồ thị kỹ thuật ITD

Nguồn: Amibroker, BSC

HNM – CTCP Sữa Hà Nội

Điểm nhấn kỹ thuật:

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

Nhận định: HNM nhiều khả năng đã tạo xong đáy tại vùng 9.3 sau khi tích lũy 6 tuần tại vùng giá này. Đồng thời, phiên bứt phá mạnh ngày 21/10 tiếp tục giúp HNM duy trì xu hướng Tăng.

Khuyến nghị: Nhà đầu tư có thể canh mua HNM khi cổ phiếu này lùi dần về ngưỡng hỗ trợ 9,3.

Đồ thị 4
Đồ thị kỹ thuật HNM

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 tũy VN-index = ***Σ(VN-index t - VN-index t-1 /VN-index t-1)***
Lợi suất tích tũy 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>