

Dao động mạnh hơn

Diễn biến hợp đồng					
Đơn vị	Đóng cửa	+/-	KLGD	Ngày đảo hạn	Ngày còn lại
	Điểm	Điểm	HĐ	Ngày	Ngày
VN30F2502	1338.9	3.6	202,864	20/02	4
VN30F2503	1343.8	3.8	6888	20/03	32
VN30F2506	1344.7	-0.2	79	19/06	123
VN30F2509	1350.6	4.8	41	18/09	214

Nguồn: Bloomberg – YSVN

Thay đổi khối lượng và OI				
Đơn vị	KLGD	+/-	OI	+/-
	HĐ	%		%
VN30F2502	202,864	68.2%	34,136	
VN30F2503	6,888	188.4%	5,006	
VN30F2506	79	83.7%	747	
VN30F2509	41	-24.1%	277	

Nguồn: Bloomberg – YSVN

Thay đổi Basis spread			
Đơn vị	Basis spread	Hôm trước	+/-
	điểm	điểm	điểm
VN30F2502	1.5	1.3	0.2
VN30F2503	6.4	1.3	5.1
VN30F2506	7.3	10.9	-3.6
VN30F2509	13.2	11.8	1.4

Nguồn: Bloomberg – YSVN

Phạm Tấn Phát

Chuyên viên phân tích cao cấp

Email: phat.pham@yuanta.com.vn

Phone: (084) 28 3622 6868 ext 3880

DIỄN BIẾN CÁC HỢTTL

- Thị trường phái sinh dao động mạnh và có xu hướng mở rộng biên độ cho thấy mức biến động có xu hướng gia tăng. VN30F1M đóng cửa phiên tăng gần 4 điểm, basis spread của HĐ tiếp tục duy trì mức dương đạt 1.5 điểm.
- Khối lượng trên HĐ VN30F2502 tăng 68%, OI của HĐ tiếp tục giảm còn hơn 34k.

NHẬN ĐỊNH HỢTTL VN30F1M

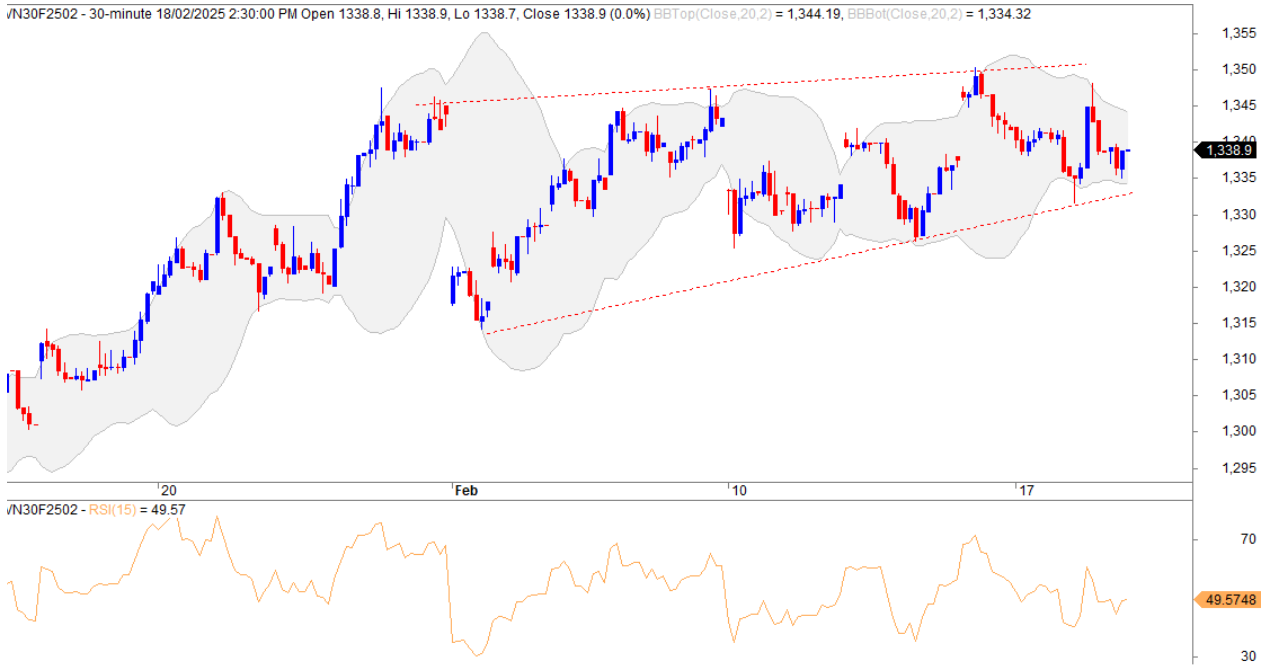
- VN30F2502 biến động nhanh hơn trong phiên hôm nay và đồ thị giá đang biến động theo mẫu hình Rising Wedge. Chỉ báo RSI đang có phân kỳ giảm cho thấy quán tính tăng yếu dần. Như vậy, VN30F2502 đang trong nhịp điều chỉnh từ 1348 điểm và nếu phá vỡ 1331 điểm thì sẽ xác nhận nhịp giảm về 1320 điểm. Đồng thời, xu hướng ở khung 1H duy trì mức GIẢM.
- Xu hướng ngắn hạn trên khung Daily của VN30F2502 duy trì mức TĂNG.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược trong phiên	NĐT xem xét chiến lược Short ở nhịp hồi phục lên 1339-1342 điểm, dừng lỗ 1344 điểm.
Chiến lược theo xu hướng ngắn hạn (Daily)	NĐT giữ vị thế quan sát chờ điểm vào cụ thể.



ĐỒ THỊ HỢP ĐỒNG VN30F1M

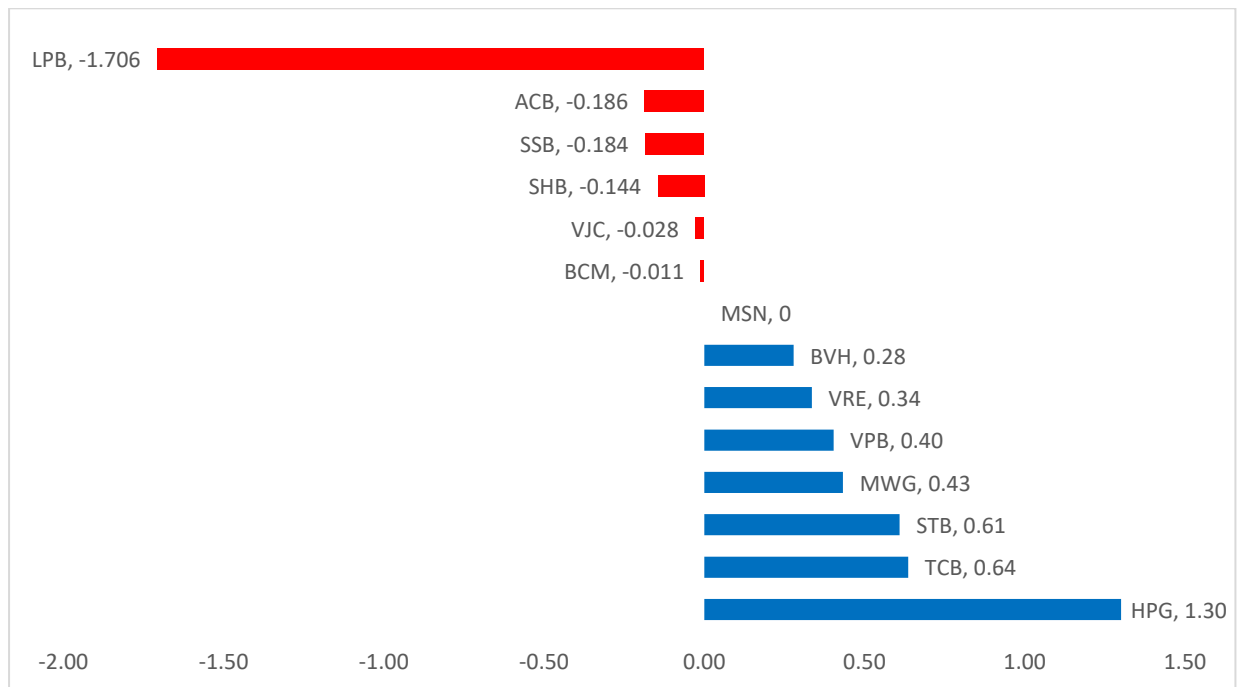


	VN30F2502-Daily	VN30F2502-1H
Xu hướng	TĂNG	GIẢM
Hỗ trợ 1	1318	1331
Hỗ trợ 2	1302	1322
Kháng cự 1	1352	1344
Kháng cự 2	1365	1348

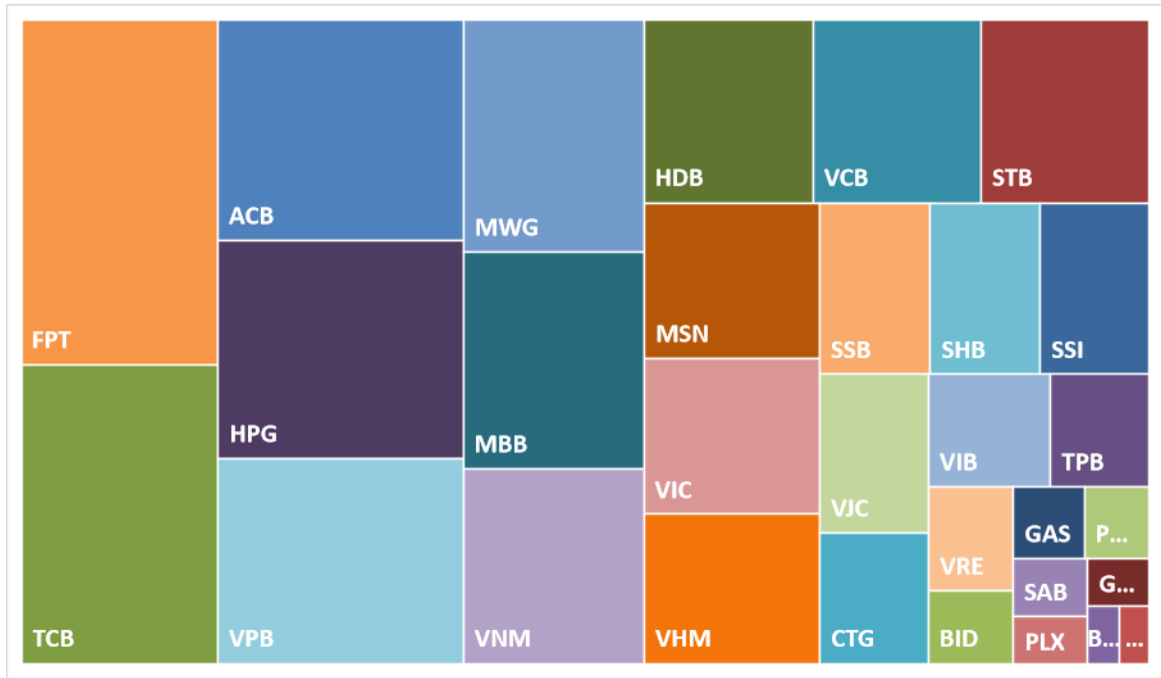
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ VN30-INDEX

Chỉ số VN30-Index đóng cửa tăng 0.25% với HPG, TCB, STB hỗ trợ chỉ số nhiều nhất.

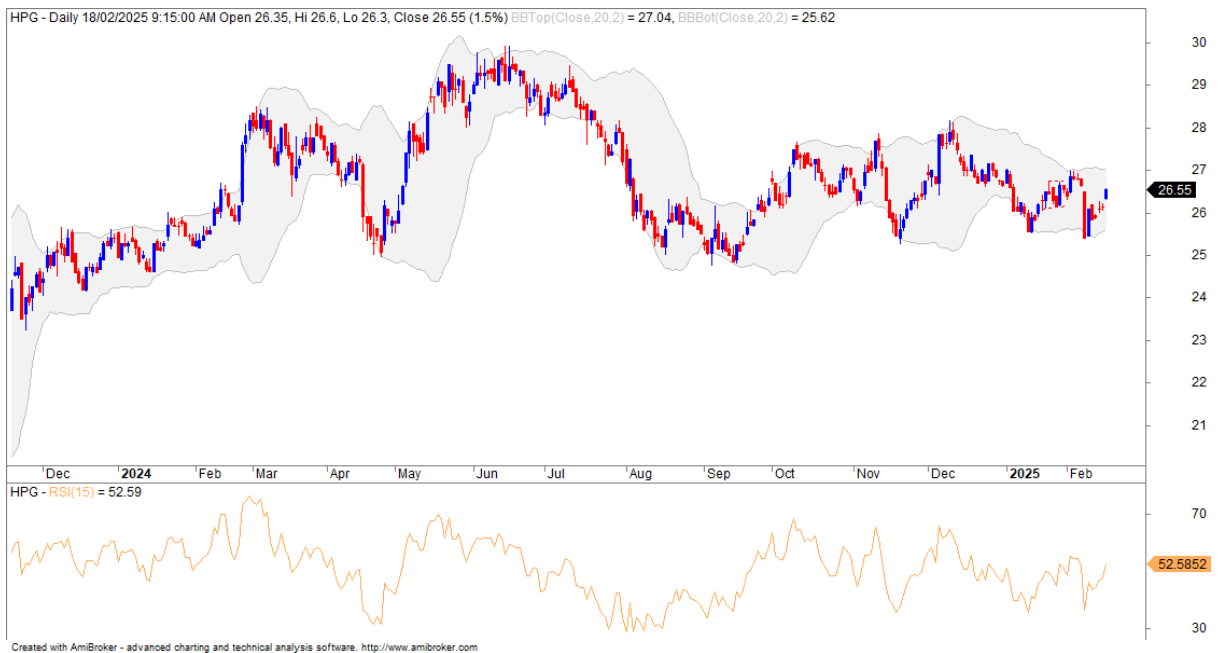
CỔ PHIẾU ẢNH HƯỞNG TRONG VN30-INDEX



VỐN HÓA TRONG VN30-INDEX



ĐỒ THỊ HPG



DANH SÁCH CP CHỈ SỐ VN30

Mã CP	Tên	Ngành	Tỷ trọng	Giá đóng cửa	Vốn hóa	PER	PBR	KLGD 3 tháng	SH Nước Ngoài	Cao 52 Tuần	Thấp 52 Tuần
		Đơn vị:	%	VND	Tỷ VND	x	x	'000 cp	%	VND	VND
ACB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Á Châu	Tài chính	7.2%	25,750	115,016	6.9	1.4	5,770	30%	26,500	23,000
BCM	Tổng Công ty Đầu tư và Phát triển Công nghiệp - CTCP	Bất động sản	0.2%	69,500	71,933	34.2	3.7	249	2%	74,500	50,400
BID	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Tài chính	0.8%	40,500	279,349	11.3	2.0	2,967	17%	46,860	35,537
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Tài chính	0.3%	57,300	42,535	20.4	1.9	741	27%	57,300	38,200
CTG	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Công thương Việt Nam	Tài chính	2.2%	40,300	216,411	8.5	1.5	6,140	27%	41,350	29,950
FPT	Công ty Cổ phần FPT	CNTT	9.4%	143,900	211,687	26.8	7.1	4,251	45%	156,000	89,826
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam - Công ty Cổ phần	Dịch vụ tiện ích	0.6%	68,000	159,302	15.5	2.6	553	2%	84,412	66,200
GVR	Tập đoàn Công nghiệp Cao su Việt Nam - Công ty Cổ phần	Nguyên vật liệu	0.3%	30,850	123,400	29.3	2.3	1,931	0%	39,000	26,350
HDB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Phát Triển Thành phố Hồ Chí Minh	Tài chính	4.1%	22,700	79,338	6.2	1.5	10,584	18%	26,650	17,958
HPG	Công ty Cổ phần Tập đoàn Hòa Phát	Nguyên vật liệu	6.5%	26,550	169,820	14.1	1.5	16,193	22%	29,950	24,750
MBB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Quân đội	Tài chính	5.3%	22,700	138,522	6.1	1.2	8,926	23%	23,250	18,870
MSN	Công ty Cổ phần Tập đoàn Masan	Hàng tiêu dùng thiết yếu	3.6%	66,400	95,507	50.1	3.2	3,372	27%	82,300	63,700
MWG	Công ty Cổ phần Đầu tư Thế Giới Di Động	Hàng tiêu dùng không thiết yếu	4.4%	54,500	79,651	21.4	2.9	5,234	45%	70,800	43,050
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Năng lượng	0.3%	42,600	54,127	19.7	2.1	865	18%	51,700	34,550
LPB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Lộc Phát Việt Nam	Tài chính	7.2%	36,600	109,335	11.3	2.5	2,730	1%	38,300	13,527
SAB	Tổng Công ty Cổ phần Bia - Rượu - Nước Giải khát Sài Gòn	Hàng tiêu dùng thiết yếu	0.5%	51,200	65,667	15.3	2.8	513	61%	69,400	51,000
SHB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Sài Gòn – Hà Nội	Tài chính	2.4%	10,950	40,103	4.3	0.7	10,231	3%	12,350	10,050
SSB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Đông Nam Á	Tài chính	2.7%	19,750	55,991	11.8	1.6	2,100	0%	21,128	15,050
SSI	Công ty Cổ phần Chứng khoán SSI	Tài chính	2.4%	25,150	49,341	17.1	2.0	13,128	#VALUE!	31,582	23,500
STB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Sài Gòn Thương Tín	Tài chính	5.0%	38,650	72,864	7.2	1.3	8,104	23%	39,300	26,150
TCB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Kỹ thương Việt Nam	Tài chính	8.2%	25,850	182,626	8.5	1.3	10,522	23%	26,250	19,225
TPB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Tiên Phong	Tài chính	1.5%	16,900	44,649	7.4	1.2	8,781	30%	18,100	13,667
VCB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Ngoại thương Việt Nam	Tài chính	3.9%	91,600	511,961	15.1	2.6	1,396	23%	100,500	85,000
VHM	Công ty Cổ phần Vinhomes	Bất động sản	2.8%	38,900	159,778	5.4	0.8	5,678	12%	48,550	34,000
VIB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Quốc tế Việt Nam	Tài chính	2.7%	20,400	60,774	8.5	1.5	7,333	5%	21,368	17,265
VIC	Tập đoàn Vingroup - Công ty CP	Bất động sản	3.2%	40,200	153,711	12.7	1.1	1,631	9%	49,350	39,700
VJC	Công ty Cổ phần Hàng không Vietjet	Công nghiệp	2.0%	97,400	52,753	37.0	3.1	621	13%	119,600	95,100
VNM	Công ty Cổ phần Sữa Việt Nam	Hàng tiêu dùng thiết yếu	3.5%	60,300	126,024	15.0	3.9	2,260	51%	76,200	60,000
VPB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Việt Nam Thịnh Vượng	Tài chính	5.7%	18,950	150,348	9.5	1.1	11,341	25%	21,050	17,500
VRE	Công ty Cổ phần Vincom Retail	Bất động sản	1.1%	16,850	38,289	9.3	0.9	5,666	18%	28,750	16,100

THÔNG TIN LIÊN HỆ

Phòng phân tích khối khách hàng cá nhân

+84 28 3622 6868 ext 3826

research.re@yuanta.com.vn

Appendix A: Important Disclosures

Analyst Certification

Each research analyst primarily responsible for the content of this research report, in whole or in part, certifies that with respect to each security or issuer that the analyst covered in this report: (1) all of the views expressed accurately reflect his or her personal views about those securities or issuers; and (2) no part of his or her compensation was, is, or will be, directly or indirectly, related to the specific recommendations or views expressed by that research analyst in the research report.

Ratings Definitions

BUY: We have a positive outlook on the stock based on our expected absolute or relative return over the investment period. Our thesis is based on our analysis of the company's outlook, financial performance, catalysts, valuation and risk profile. We recommend investors add to their position.

HOLD-Outperform: In our view, the stock's fundamentals are relatively more attractive than peers at the current price. Our thesis is based on our analysis of the company's outlook, financial performance, catalysts, valuation and risk profile.

HOLD-Underperform: In our view, the stock's fundamentals are relatively less attractive than peers at the current price. Our thesis is based on our analysis of the company's outlook, financial performance, catalysts, valuation and risk profile.

SELL: We have a negative outlook on the stock based on our expected absolute or relative return over the investment period. Our thesis is based on our analysis of the company's outlook, financial performance, catalysts, valuation and risk profile. We recommend investors reduce their position.

Under Review: We actively follow the company, although our estimates, rating and target price are under review.

Restricted: The rating and target price have been suspended temporarily to comply with applicable regulations and/or Yuanta policies.

Note: Yuanta research coverage with a Target Price is based on an investment period of 12 months. Greater China Discovery Series coverage does not have a formal 12 months Target Price and the recommendation is based on an investment period specified by the analyst in the report.

Global Disclaimer

© 2018 Yuanta. All rights reserved. The information in this report has been compiled from sources we believe to be reliable, but we do not hold ourselves responsible for its completeness or accuracy. It is not an offer to sell or solicitation of an offer to buy any securities. All opinions and estimates included in this report constitute our judgment as of this date and are subject to change without notice.

This report provides general information only. Neither the information nor any opinion expressed herein constitutes an offer or invitation to make an offer to buy or sell securities or other investments. This material is prepared for general circulation to clients and is not intended to provide tailored investment advice and does not take into account the individual financial situation and objectives of any specific person who may receive this report. Investors should seek financial advice regarding the appropriateness of investing in any securities, investments or investment strategies discussed or recommended in this report. The information contained in this report has been compiled from sources believed to be reliable but no representation or warranty, express or implied, is made as to its accuracy, completeness or correctness. This report is not (and should not be construed as) a solicitation to act as securities broker or dealer in any jurisdiction by any person or company that is not legally permitted to carry on such business in that jurisdiction.

Yuanta research is distributed in the United States only to Major U.S. Institutional Investors (as defined in Rule 15a-6 under the Securities Exchange Act of 1934, as amended and SEC staff interpretations thereof). All transactions by a US person in the securities mentioned in this report must be effected through a registered broker-dealer under Section 15 of the Securities Exchange Act of 1934, as amended. Yuanta research is distributed in Taiwan by Yuanta Securities Investment Consulting. Yuanta research is distributed in Hong Kong by Yuanta Securities (Hong Kong) Co. Limited, which is licensed in Hong Kong by the Securities and Futures Commission for regulated activities, including Type 4 regulated activity (advising on securities). In Hong Kong, this research report may not be redistributed, retransmitted or disclosed, in whole or in part or and any form or manner, without the express written.