



THÁNG MƯỜI HAI

6

THỨ NĂM

Bản tin Phái sinh 6h



CHIẾN LƯỢC GIAO DỊCH

Xu hướng

"VN30Index đang ở vùng cân bằng của xu hướng trung hạn. Do đó, vẫn nên hạn chế mở vị thế đối với chiến lược phòng vệ danh mục cơ sở và đầu cơ xu hướng. Chúng tôi sẽ cập nhật lệnh mở vị thế khi có dấu hiệu thích hợp."

Trong phiên

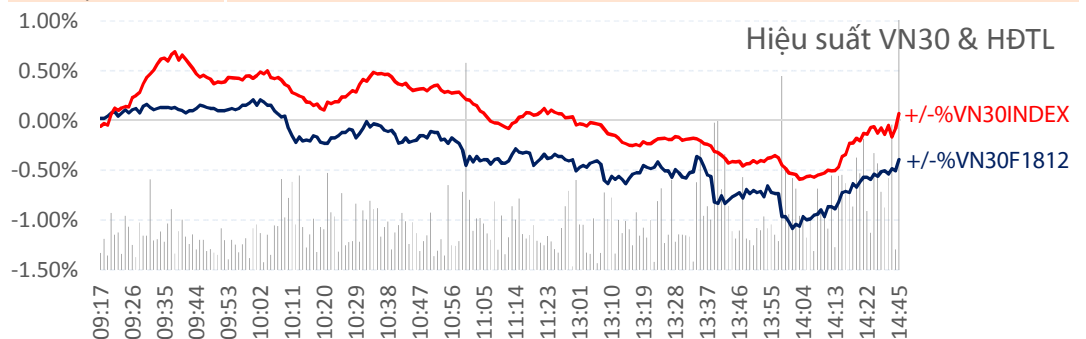
"Mặc dù xu hướng của HĐ VN30F1812 vẫn còn tiêu cực nhưng với mức chênh lệch âm lớn nên việc mở vị thế Short sẽ gánh chịu mức rủi ro lớn. Do đó, xem xét mở vị thế Long khi HĐ VN30F1812 được hỗ trợ trong vùng 903 - 905 điểm, cắt lỗ tại 902 điểm, chốt lời tại vùng 911 - 916 điểm. Ngược lại, có thể xem xét Short khi HĐ bị kháng cự mạnh tại vùng 916 - 921 điểm, cắt lỗ tại 923, chốt lời tại vùng 903 - 906 điểm."



"Tranh chấp xu hướng"

TÓM LƯỢC XU HƯỚNG - KHÁNG CỰ - HỖ TRỢ

Đồ thị	Daily - VN30INDEX	15 min - VN30F1M	Hourly - VN30F1M
Ngắn hạn	Tích cực	Trung lập	Trung lập
Trung hạn	Trung lập	Tích cực	Tích cực
Dài hạn	Trung lập	Tích cực	Tích cực
Kháng cự 2	950	950	950
Kháng cự 1	925	925	925
Hỗ trợ 1	870	860	860
Hỗ trợ 2	840	840	840



Bloomberg: VDSC <GO>

THÔNG TIN CÁC HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

Hợp đồng	Ngày đáo hạn	Giá TC	Đóng cửa		KLGD (hđ)	% +/- KLGD
			Giá	+/- % +/-		
VN30F1812	20/12/18	915.5	909.0	-6.5 -0.71%	143,614	-8.9%
VN30F1901	17/01/19	914.5	908.0	-6.5 -0.71%	559	-11.8%
VN30F1903	21/03/19	913.9	908.1	-5.8 -0.63%	89	-46.7%
VN30F1906	20/06/19	916.0	909.9	-6.1 -0.67%	75	-54.3%

Diễn biến - Chênh lệch giữa HĐTL và VN30 trong phiên

Phiên hiện tại

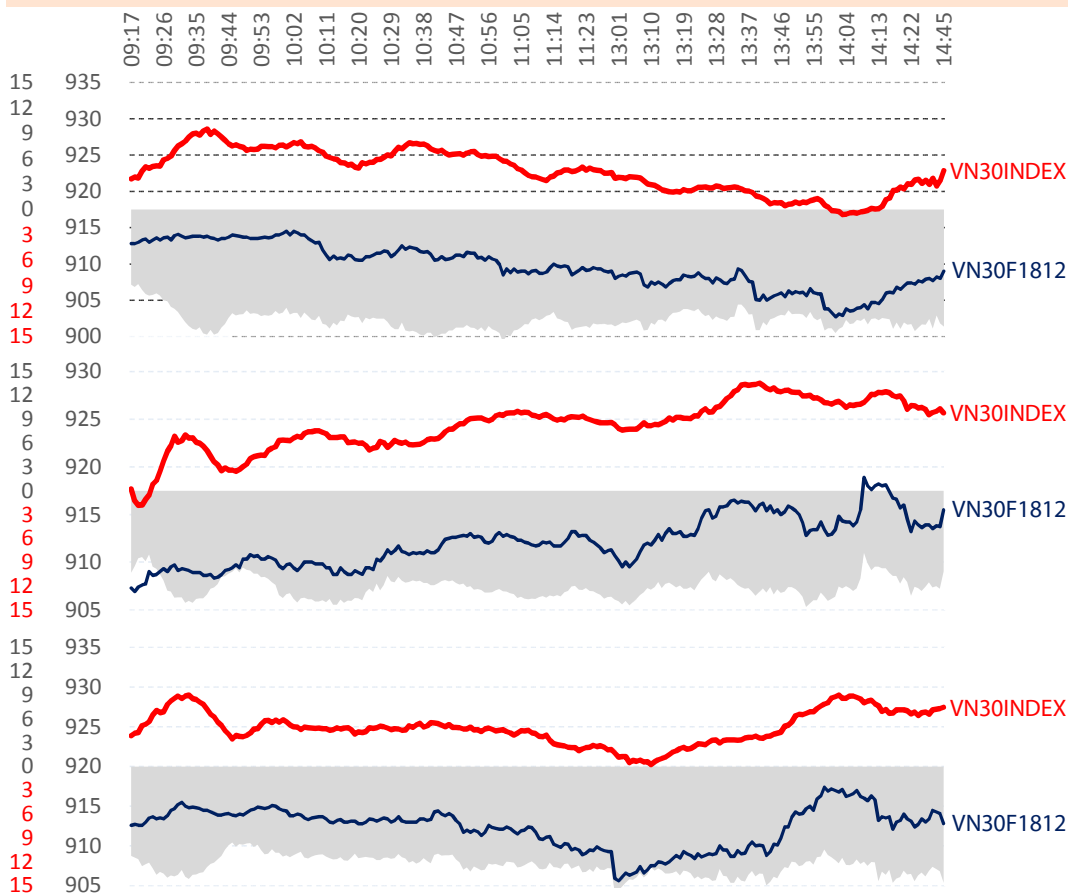
High Gap -8.8
Low Gap -15.7
Average Gap -13.1

Phiên T-1

High Gap -7.9
Low Gap -14.6
Average Gap -12.2

Phiên T-2

High Gap -9.6
Low Gap -15.8
Average Gap -12.5

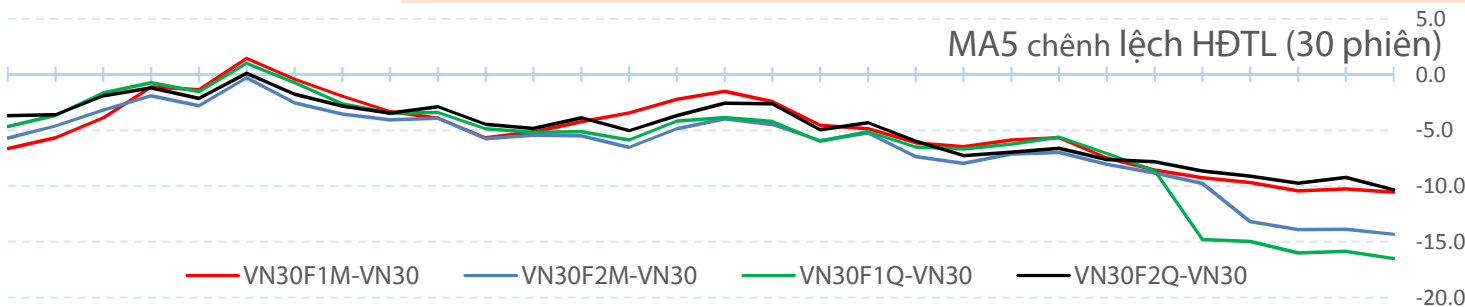


DIỄN BIẾN CHÊNH LỆCH HĐTL SO VỚI VN30INDEX

Chênh lệch HĐTL	Hiện tại		Phiên trước	Thay đổi	MA5	MA22
	Điểm	% Cơ sở				
VN30F1M - VN30INDEX	-13.9	-1.5%	-10.2	-3.7	-10.5	-6.7
VN30F2M - VN30INDEX	-14.9	-1.6%	-11.2	-3.7	-14.3	-8.5
VN30F1Q - VN30INDEX	-14.8	-1.6%	-11.8	-3.0	-16.5	-8.6
VN30F2Q - VN30INDEX	-13.0	-1.4%	-9.7	-3.3	-10.3	-6.7

Ghi chú:

VN30F1M: HĐTL tháng hiện tại.
VN30F2M: HĐTL tháng kế tiếp.
VN30F1Q: HĐTL quý hiện tại.
VN30F2Q: HĐTL quý kế tiếp.
MA5: trung bình chênh lệch 5 phiên gần nhất.
MA22: trung bình chênh lệch 22 phiên gần nhất.



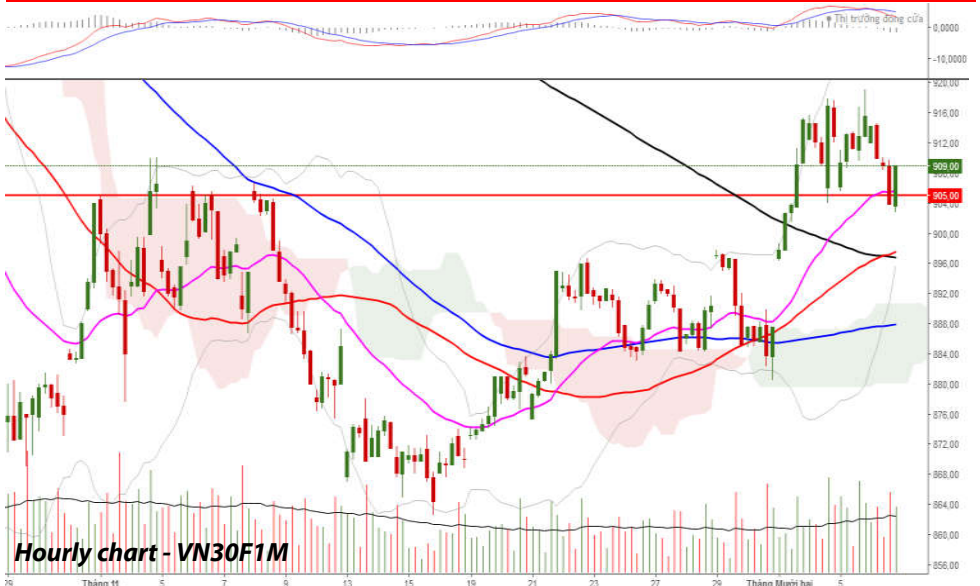
PHÂN TÍCH KỸ THUẬT VN30INDEX

- Với diễn biến tiêu cực của thị trường chứng khoán thế giới, VN30Index tiếp tục chịu áp lực bán nhưng vẫn được hỗ trợ tại mức 925 điểm và hồi phục trở lại. Kết phiên chỉ số chỉ còn giảm nhẹ và dừng trước đường biên kháng cự trung hạn. Thanh khoản khớp lệnh giảm so với phiên trước nhưng vẫn đạt được mức khá. Điều này cho thấy tâm lý nhà đầu tư vẫn còn kỳ vọng vào xu hướng hồi phục hiện tại.
- Mặc dù xu hướng hồi phục vẫn đang được duy trì nhưng đồ thị tiếp tục hình thành nến Star và tạo dấu hiệu Tri Star tại đường biên kháng cự trung hạn. Do đó, cần thận trọng khả năng đảo chiều nếu chỉ số không thể vượt được đường biên này.



NHẬN ĐỊNH GIAO DỊCH PHÁI SINH

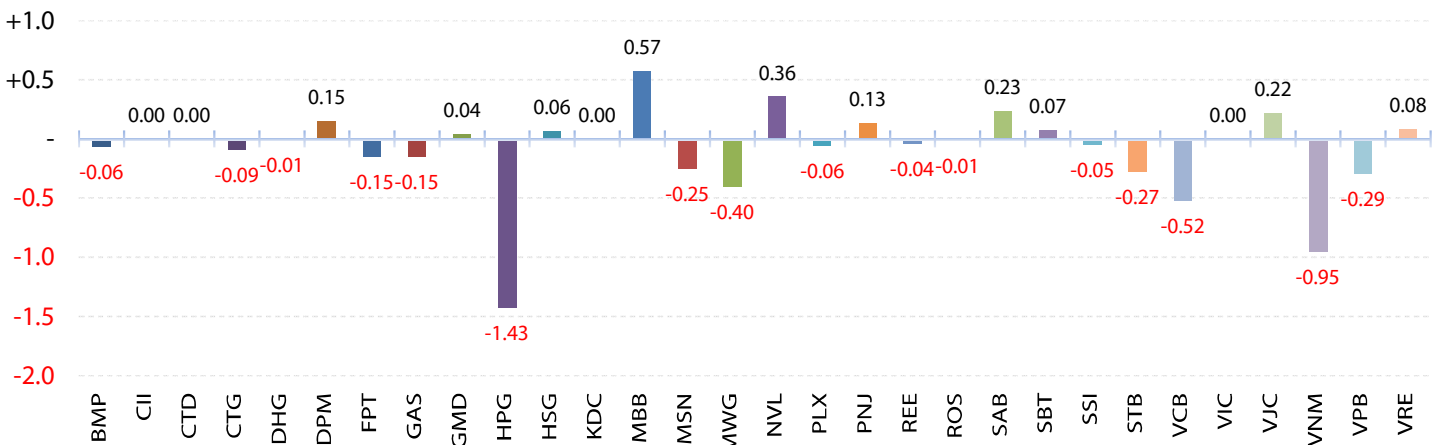
- HĐ VN30F1812 giao dịch thận trọng trên đường EMA(26) và MA(50) trong đồ thị 15 phút, và bắt đầu mở rộng mức điều chỉnh khi rớt dưới 2 đường này. Mặc dù xu thế giao dịch trong phiên tương đối tiêu cực nhưng giá HĐ vẫn tạm thời được hỗ trợ quanh đường MA(100) trong đồ thị 15 phút và đường EMA(26) trong đồ thị 1 giờ, tương ứng vùng 903 - 905 điểm. Kết phiên, giá HĐ thu hẹp đà giảm về mức 909 điểm, tương ứng EMA(26) trong đồ thị 15 phút.
- Mặc dù xu hướng của HĐ VN30F1812 vẫn còn tiêu cực và có thể điều chỉnh giảm trở lại nhưng với mức chênh lệch âm lớn (chênh lệch so với chỉ số cơ sở) nên việc mở vị thế Short sẽ gánh chịu rủi ro khá lớn. Do đó, nhà đầu tư tạm thời xem xét vị thế Long khi giá HĐ điều chỉnh về mức hỗ trợ; vị thế Short chỉ nên mở nếu chỉ số cơ sở xác nhận dấu hiệu đảo chiều.



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30INDEX

Cổ phiếu	Ngành	Tỷ trọng (%)	Vốn hóa (tỷ VND)	Giá	+/- Giá	Điểm tác động	Nước Ngoài Mua - Bán (CP)	Beta
BMP	Xây dựng và Vật liệu	0.4%	4,698.8	57,400	-1.88%	-0.1	-51,030	1.0
CII	Xây dựng và Vật liệu	0.8%	6,460.4	26,400	-	-	-2,200	0.6
CTD	Xây dựng và Vật liệu	1.2%	12,276.9	157,000	-	-	-17,000	1.2
CTG	Ngân hàng	1.5%	89,175.5	23,950	-0.62%	-0.1	-221,850	2.1
DHG	Dược phẩm	0.5%	10,969.6	83,900	-0.12%	-0.0	+15,240	0.7
DPM	Hóa chất	0.6%	8,531.1	21,800	+2.83%	+0.2	+34,300	0.7
FPT	Phần mềm & Dịch vụ Máy tính	3.5%	27,241.8	44,400	-0.45%	-0.1	-	1.2
GAS	Nước & Khí đốt	1.6%	182,016.6	95,100	-1.04%	-0.2	-99,750	1.6
GMD	Vận tải	1.3%	8,521.7	28,700	+0.35%	+0.0	-490	0.8
HPG	Kim loại	7.6%	73,487.2	34,600	-1.98%	-1.4	-911,790	1.3
HSG	Kim loại	0.3%	2,817.1	7,320	+2.23%	+0.1	-116,160	2.0
KDC	Sản xuất thực phẩm	0.5%	5,049.0	24,550	-	-	-190	-0.0
MBB	Ngân hàng	4.6%	48,610.2	22,500	+1.35%	+0.6	-	1.6
MSN	Sản xuất thực phẩm	7.6%	97,471.9	83,800	-0.36%	-0.3	+226,740	1.4
MWG	Bán lẻ	4.3%	37,831.9	87,900	-1.01%	-0.4	-	1.9
NVL	Bất động sản	3.7%	62,171.4	68,000	+1.04%	+0.4	-42,750	0.1
PLX	Sản xuất Dầu khí	1.2%	70,108.2	60,500	-0.49%	-0.1	+4,360	1.7
PNJ	Hàng cá nhân	2.3%	16,032.3	96,000	+0.63%	+0.1	-	2.4
REE	Công nghiệp nặng	1.0%	10,309.2	33,250	-0.45%	-0.0	+2,310	1.3
ROS	Xây dựng và Vật liệu	0.9%	20,461.9	36,050	-0.14%	-0.0	-91,840	1.0
SAB	Bia và đồ uống	4.1%	158,396.5	247,000	+0.61%	+0.2	-600	-0.2
SBT	Sản xuất thực phẩm	1.0%	9,883.6	19,950	+0.76%	+0.1	-209,800	0.4
SSI	Dịch vụ tài chính	1.5%	14,675.6	29,400	-0.34%	-0.0	+227,240	1.9
STB	Ngân hàng	3.7%	22,726.0	12,600	-0.79%	-0.3	+25,940	1.7
VCB	Ngân hàng	3.5%	204,713.0	56,900	-1.56%	-0.5	+293,980	1.1
VIC	Bất động sản	10.8%	325,864.5	102,100	-	-	-34,630	0.3
VJC	Du lịch & Giải trí	6.2%	71,438.5	131,900	+0.38%	+0.2	-1,860	1.0
VNM	Sản xuất thực phẩm	10.5%	229,345.1	131,700	-0.98%	-1.0	+197,070	0.8
VPB	Ngân hàng	7.1%	55,031.2	22,400	-0.44%	-0.3	-	1.9
VRE	Bất động sản	6.0%	76,851.0	33,000	+0.15%	+0.1	+432,660	1.1

ĐIỂM TÁC ĐỘNG CỦA CÁC MÃ ĐẾN VN30INDEX



PHÒNG TƯ VẤN ĐẦU TƯ KHÁCH HÀNG CÁ NHÂN

Hoàng Thạch Lân
Head of Retail Research
lan.ht@vdsc.com.vn
+ 84 28 62992006 (1336)

Trần Quang Khải
Supervisor
khai.tq@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1254)

Dương Anh Vũ
Executive
vu.da@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1215)

Nguyễn Huy Phương
Executive
phuong.nh@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1241)

Nguyễn Đức Phương
Executive
phuong.nd@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1231)

Phùng Minh Hoàng
Executive
hoang.pm@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1291)

Đàm Kim Ngân
Executive
ngan.dk@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1200)

Nguyễn Quốc Bảo
Executive
bao.nq@vdsc.com.vn
+ 84 28 6299 2006 (1253)

HỘI SỞ TẠI TP.HCM

Tòa nhà Việt Dragon, 141 Nguyễn Du
P. Bến Thành, Q.1, TP.HCM
☎ +84 28 6299 2006
☎ +84 28 6291 7986
✉ info@vdsc.com.vn
🌐 www.vdsc.com.vn

CHI NHÁNH HÀ NỘI

2C Thái Phiên, Q. Hai Bà Trưng, Hà Nội
☎ +84 24 6288 2006
☎ +84 24 6288 2008
✉ info@vdsc.com.vn
🌐 www.vdsc.com.vn

CHI NHÁNH NHA TRANG

50Bis Yersin, Nha Trang, Khánh Hòa
☎ +84 258 3820 006
☎ +84 258 3820 008
✉ info@vdsc.com.vn
🌐 www.vdsc.com.vn

CHI NHÁNH CẦN THƠ

Tầng 8, Tòa nhà Sacombank,
số 95-97-99, Võ Văn Tần, P. Tân An,
Ninh Kiều, Cần Thơ
☎ +84.292 3817 578
☎ +84.292 3818 387
✉ info@vdsc.com.vn
🌐 www.vdsc.com.vn



Bản báo cáo này được chuẩn bị cho mục đích duy nhất là cung cấp thông tin và không nhằm đưa ra bất kỳ đề nghị hay hướng dẫn mua bán chứng khoán cụ thể nào. Các quan điểm và khuyến cáo được trình bày trong bản báo cáo này không tính đến sự khác biệt về mục tiêu, nhu cầu, chiến lược và hoàn cảnh cụ thể của từng nhà đầu tư. Ngoài ra, nhà đầu tư cũng ý thức có thể có các xung đột lợi ích ảnh hưởng đến tính khách quan của bản báo cáo này. Nhà đầu tư nên xem báo cáo này như một nguồn tham khảo khi đưa ra quyết định đầu tư và phải chịu toàn bộ trách nhiệm đối với quyết định đầu tư của chính mình. Rong Viet Securities tuyệt đối không chịu trách nhiệm đối với toàn bộ hay bất kỳ thiệt hại nào, hay sự kiện bị coi là thiệt hại, đối với việc sử dụng toàn bộ hoặc từng phần thông tin hay ý kiến nào của bản báo cáo này.

Toàn bộ các quan điểm thể hiện trong báo cáo này đều là quan điểm cá nhân của người phân tích. Không có bất kỳ một phần thu nhập nào của người phân tích liên quan trực tiếp hoặc gián tiếp đến các khuyến cáo hay quan điểm cụ thể trong bản báo cáo này.

Thông tin sử dụng trong báo cáo này được Rong Viet Securities thu thập từ những nguồn mà chúng tôi cho là đáng tin cậy. Tuy nhiên, chúng tôi không đảm bảo rằng những thông tin này là hoàn chỉnh hoặc chính xác. Các quan điểm và ước tính trong đánh giá của chúng tôi có giá trị đến ngày ra báo cáo và có thể thay đổi mà không cần báo cáo trước.

Bản báo cáo này được giữ bản quyền và là tài sản của Rong Viet Securities. Mọi sự sao chép, chuyển giao hoặc sửa đổi trong bất kỳ trường hợp nào mà không có sự đồng ý của Rong Viet Securities đều trái luật, **Bản quyền thuộc Rong Viet Securities, 2018.**