

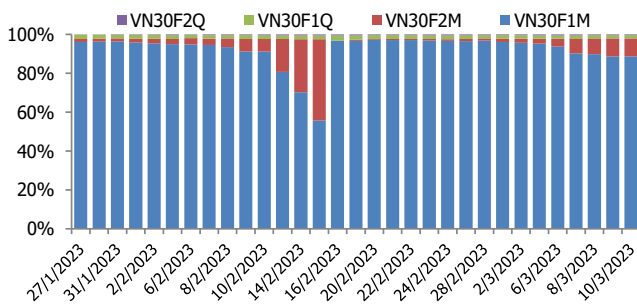
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	3	1048,00	49.620
VN30F2304	20/4/2023	38	1046,00	7.746
VN30F2306	15/6/2023	94	1038,20	1.059
VN30F2309	21/9/2023	192	1038,10	247

TỶ TRỌNG VỊ THẾ MỞ GIỮA CÁC KỲ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	% Chg	P/E	YTD
VNIndex	1.052,80	(0,02)	13,73	(28,20)
Dow Jones	31.819,14	(0,28)	19,18	(3,73)
S&P500	3.855,76	(0,15)	18,76	0,58
Nikkei 225	27.199,50	(2,29)	23,49	6,03
Shanghai	3.268,70	-	14,31	4,50
DAX	14.959,47	(3,04)	12,38	10,80
Vàng	1.921,06	2,40		(5,95)
Dầu WTI	74,80	(2,50)		(30,39)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - CPI lõi (tháng/tháng) (Tháng 2)	14/3	0,4%	
Mỹ - Doanh số bán lẻ lõi (Tháng 2)	15/3	2,3%	
Mỹ - Giá sản xuất PPI (Tháng 2)	15/3	0,7%	
Mỹ - Chỉ số Fed Philadelphia (T3)	16/3	-24,3	
Châu Âu - Quyết định lãi suất (T3)	16/3	3,00%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

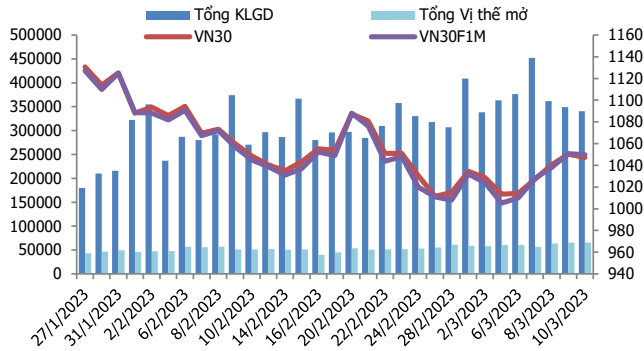
- Thị trường phái sinh ghi nhận các nhịp dao động giảm co trong phiên, với 3/4 HĐTL đóng cửa giảm từ 1 đến 1,8 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 2,87 điểm. Tổng thanh khoản phiên này giảm 3,77% so với phiên liền trước, đạt 327.637 hợp đồng được khớp lệnh trong phiên. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 3 với 5.067 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 755 hợp đồng.
- Trước sức ép từ bên ngoài, việc thị trường cơ sở giảm điểm trong phiên hôm nay là hoàn toàn dễ hiểu. Tuy vậy, diễn biến trong phiên hôm nay cho thấy thị trường đang tốt hơn so với kỳ vọng của nhà đầu tư. Lực kéo chính giúp thị trường “suyt” ngược dòng thành công tiếp tục đến từ khối ngoại đang ở tuần cơ cấu danh mục với lực mua nhiều hơn lực bán.
- Thị trường phái sinh tiếp tục điều chỉnh trong phiên đầu tuần, với các nhịp rung lắc mạnh trong phiên. Tuy không có nhiều yếu tố tác động mạnh, nhưng nhà đầu tư vẫn cần duy trì tâm lý thận trọng trước những tin tức quốc tế quan trọng xuất hiện trong tuần này. Nhà đầu tư có thể cân nhắc mở vị thế mua ở các nhịp điều chỉnh trong phiên.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số Dow Jones mất 90,50 điểm (-0,28%) còn 31.819,14 điểm. Chỉ số này, vốn đã giảm phiên thứ 5 liên tiếp vào ngày thứ Hai, đã có thể xoá bớt mức giảm sau khi sụt hơn 284 điểm vào đầu phiên. Chỉ số S&P 500 lùi 0,15% xuống 3.855,76 điểm, sau khi có thời điểm giảm tới 1,37%. Trong khi, chỉ số Nasdaq Composite tiến 0,45% lên 11.188,84 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1040-1045 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1034 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1072-1080 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1057-1060 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HDTL

- Áp lực bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên giao dịch hôm nay đã khiến 3/4 HDTL đóng cửa giảm từ 1 đến 1,8 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 3,77% so với phiên liền trước, đạt 327.637 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 3 với 319.609 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 3 với 5.067 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 755 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1047,31 điểm (thấp hơn 2,49 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1048,61 điểm (+6,61 điểm), VN30F2306 là 1050,69 điểm (+10,69 điểm) và VN30F2309 là 1054,34 điểm (+15,24 điểm).

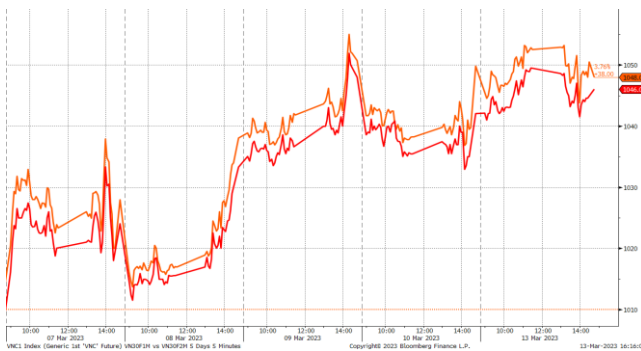
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1048,0	-0,20	319.609	-5,0	49.620	
VN30F2304	1046,0	0,40	7.819	106,25	7.746	
VN30F2306	1038,2	-0,20	163	-6,3	1.059	
VN30F2309	1038,1	-0,10	46	-32,35	247	
Tổng			327.637	-6,2	58.672	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	SELL
Hỗ trợ	1040-1045	1020-1034	1000-1005
Kháng cự	1057-1060	1072-1080	1093-1100

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

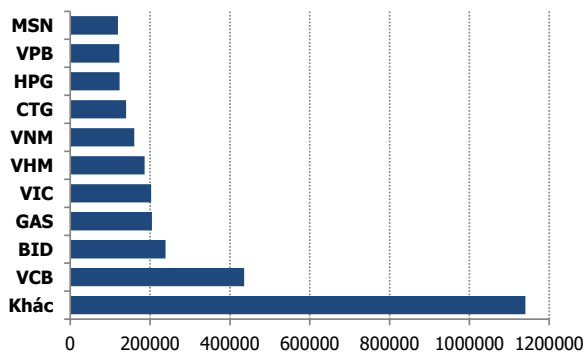


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1052,8	1050,07
Thay đổi	-0,20	2,87
%Chg	-0,02	0,27
YTD	-28,20	-29,11
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4.212,73	3.084,41
P/E	13,73	11,03
P/B	1,67	1,62

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính hồi phục nhẹ. Số mã giảm điểm (15) áp đảo so với số mã tăng điểm (14) và 1 mã đứng tham chiếu, trong đó VHM và VPB trở thành hai trụ đồng góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +2,15 điểm và +1,95 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 2,87 điểm (+0,27%) lên 1.050,07 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 243,52 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 5.905 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 5 liên tiếp với 855,63 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+98 tỷ đồng), SSI (+89 tỷ đồng), VHM (+88 tỷ đồng), POW (+82 tỷ đồng), HSG (+71 tỷ đồng).

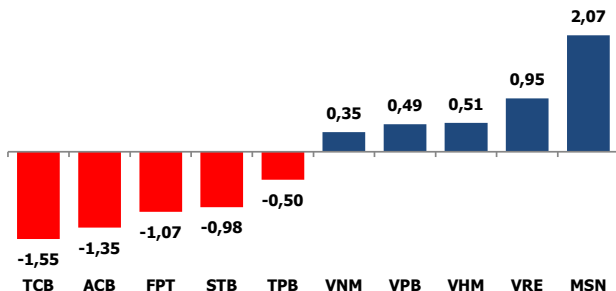
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VHM, VPB và VRE là những nhân tố chính đưa chỉ số VN30 quay lại đà tăng điểm. Trong đó, VHM đóng góp +2,15 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VHM

Phân tích kỹ thuật VHM



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18.300	0,55	2,23%	268,074	0,49	6,69	1,30
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	79.500	-1,36	1,77%	50,918	-1,07	16,55	4,38
ACB	Banks	24.900	-1,78	1,82%	60,435	-1,35	6,14	1,44
HPG	Metals & Mining	21.300	0,47	2,14%	476,277	0,33	8,00	1,26
VNM	Food Products	76.900	0,52	1,45%	109,646	0,35	21,17	5,38
TCB	Banks	27.150	-2,34	2,22%	58,084	-1,55	4,49	0,88
MSN	Food Products	83.900	3,84	4,97%	116,554	2,07	33,36	4,57
VIC	Real Estate Management & Development	53.100	0,19	1,52%	47,505	0,10	183,20	1,79
STB	Banks	26.000	-1,89	3,47%	618,896	-0,98	11,82	1,33
VCB	Banks	92.100	-0,97	1,09%	65,143	-0,49	16,49	3,40
VHM	Real Estate Management & Development	42.850	1,06	2,38%	108,403	0,51	5,93	1,37
MBB	Banks	17.750	-0,28	1,14%	93,566	-0,13	4,58	1,11
MWG	Specialty Retail	39.750	-0,63	1,78%	62,425	-0,29	11,35	2,50
HDB	Banks	18.500	0,00	2,49%	27,049	0,00	6,16	1,32
VJC	Airlines	100.600	-1,18	4,26%	30,554	-0,34	881,12	3,11
VRE	Real Estate Management & Development	28.000	3,70	4,28%	63,428	0,95	22,92	1,91
TPB	Banks	24.000	-2,04	2,30%	65,395	-0,50	6,27	1,24
VIB	#N/A	20.950	-1,18	1,93%	48,808	#N/A	5,22	1,35
CTG	Banks	29.200	-0,68	1,92%	46,743	-0,15	9,02	1,33
SSI	Capital Markets	19.800	0,00	2,06%	262,796	0,00	8,79	1,34
SAB	Food Products	185.600	-0,48	1,30%	49,763	-0,07	22,02	4,88
NVL	Real Estate Management & Development	10.650	-2,74	2,83%	82,996	-0,34	7,27	0,56
GAS	Gas Utilities	107.000	0,19	1,71%	24,502	0,02	13,95	3,42
BID	Banks	47.150	-1,05	1,06%	40,609	-0,11	14,73	2,48
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12.950	-0,38	1,95%	115,76	-0,03	25,97	1,02
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38.150	-2,18	2,63%	25,035	-0,11	51,72	2,08
BVH	Beverages	49.200	-0,51	1,23%	5,495	-0,02	20,86	1,64
PDR	Capital Markets	11.750	-2,08	2,59%	40,546	-0,08	3,63	0,94
BCM	#N/A	83.800	-0,24	2,07%	12,282	#N/A	50,66	4,96
GVR	Real Estate Management & Development	15.000	-0,99	2,68%	40,333	-0,03	14,12	1,19

STT	Thông tin cơ bản HĐTL VN30	
1	Mã hợp đồng	VN30F-yy-mm
2	Tài sản cơ sở	Chỉ số cổ phiếu VN30
3	Hệ số nhân hợp đồng	100.000 đồng
4	Quy mô 01 hợp đồng	100.000 đồng * Điểm chỉ số VN30
5	Tháng đáo hạn	- Tháng hiện tại - Tháng tiếp theo - Hai tháng cuối 2 quý gần nhất
6	Phương thức giao dịch	- Giao dịch khớp lệnh; Giao dịch thỏa thuận
7	GD Khớp lệnh định kỳ	- ATO: 08h45 - 09h00 - ATC: 14h30 - 14h45
	Thời gian giao dịch GD khớp lệnh liên tục	- Sáng: 09h00 - 11h30 - Chiều: 13h00 - 14h30
	GD Thỏa thuận	- 08h45 - 14h45
8	Các loại lệnh giao dịch	LO, MOK, MAK, MTL, ATO, ATC.
9	Nguyên tắc khớp lệnh	Ưu tiên giá và thời gian.
10	Khối lượng giao dịch tối thiểu/lệnh	01 hợp đồng
11	Khối lượng giao dịch tối đa/lệnh	500 hợp đồng
12	Đơn vị yết giá/ Bước giá	0,1 điểm chỉ số = 0,1 * 100.000 = 10.000 đồng
13	Biên độ dao động	+/- 7%
14	Ngày giao dịch cuối cùng	Thứ 5 của tuần thứ 3 của tháng đáo hạn. Nếu rơi vào ngày nghỉ lễ thì sẽ được điều chỉnh lên ngày giao dịch liền trước.
15	Ngày thanh toán cuối cùng	Ngày làm việc liền sau ngày giao dịch cuối cùng.
16	Phương thức thanh toán	Thanh toán bằng tiền
17	Giá thanh toán hàng ngày	Giá hợp đồng phái sinh do HNX xác định để tính toán giá trị lãi/lỗ phát sinh cuối ngày của từng hợp đồng.
18	Giá thanh toán cuối cùng	Giá đóng cửa của chỉ số VN30 tại ngày giao dịch cuối cùng của HĐTL.
19	Giá tham chiếu	Giá thanh toán cuối ngày của hợp đồng tương lai trong ngày giao dịch liền trước.
20	Mở tài khoản	Nhà đầu tư cần có 2 tài khoản để tham gia giao dịch phái sinh: 1 tài khoản giao dịch tại các CTCK là thành viên giao dịch CKPS và 1 tài khoản ký quỹ tại các CTCK là thành viên bù trừ CKPS.
21	Giới hạn vị thế nắm giữ tối đa trên 1 TK	NĐT Chứng khoán chuyên nghiệp: 20.000 hợp đồng; NĐT tổ chức: 10.000 hợp đồng; NĐT cá nhân: 5.000 hợp đồng
22	Mức ký quỹ ban đầu	Tài sản nhà đầu tư phải đặt cọc với công ty môi giới đối với mỗi hợp đồng trước khi giao dịch. VSD quy định tỷ lệ ký quỹ ban đầu là 10% quy mô hợp đồng nhưng để phòng ngừa rủi ro, các CTCK thường yêu cầu mức ký quỹ cao hơn.
23	Mức ký quỹ duy trì	Tài sản ký quỹ tối thiểu trong TK đối với mỗi vị thế mở mà nhà đầu tư đang nắm giữ, thường ít hơn so với mức ký quỹ ban đầu.
24	Ký quỹ bổ sung	Nộp tài sản bổ sung để số dư TK ký quỹ không thấp hơn mức ký quỹ duy trì hoặc đóng bớt vị thế trên TK để đảm bảo tiếp tục giao dịch.
25	Thoát khỏi hợp đồng tham gia	Nhà đầu tư nắm giữ vị thế hợp đồng cho đến thời điểm đáo hạn hoặc thoát khỏi vị thế trước thời điểm đáo hạn bằng cách đặt một/nhiều lệnh tại vị thế đối nghịch với vị thế trước đó.

TUYÊN BỐ MIỄN TRÁCH NHIỆM

Bản quyền năm 2017 thuộc về Công ty CP Chứng khoán MB (MBS). Những thông tin sử dụng trong báo cáo được thu thập từ những nguồn đáng tin cậy và MBS không chịu trách nhiệm về tính chính xác của chúng. Quan điểm thể hiện trong báo cáo này là của (các) tác giả và không nhất thiết liên hệ với quan điểm chính thức của MBS. Không một thông tin cũng như ý kiến nào được viết ra nhằm mục đích quảng cáo hay khuyến nghị mua/bán bất kỳ chứng khoán nào. Báo cáo này không được phép sao chép, tái bản bởi bất kỳ cá nhân hoặc tổ chức nào khi chưa được phép của MBS.