

BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



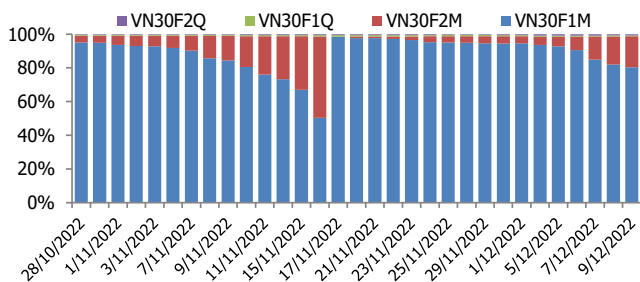
DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

- Thị trường phải sinh ghi nhận các nhịp dao động giằng co trong biên độ nhưng vẫn duy trì được đà tăng điểm nhờ lực kéo mạnh từ bên mua. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 8,4 đến 20,3 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 2,35 điểm. Basis của các HĐTL phiên này cải thiện lên mức từ -22,08 đến 4,92 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư được cải thiện tích cực trước tín hiệu khả quan của thị trường.
- Nhóm cổ phiếu dẫn dắt như ngân hàng, chứng khoán,... sau 3 tuần tăng liên tiếp đang đi vào nhịp phân hóa nhường chỗ cho nhóm cổ phiếu xây dựng, nhóm hưởng lợi từ đầu tư công, nhóm xuất khẩu,... có thể là tín hiệu củng cố cho kịch bản thị trường nhiều khả năng sẽ dao động trong vùng 1.030 đến đỉnh của nhịp phôi vừa qua (gần 1.100 điểm) trong khi chờ đợt tín hiệu từ thị trường chứng khoán thế giới trong tuần tới.
- Kịch bản dao động nhẹ trong biên độ ghi nhận trong phiên giao dịch hôm nay của chỉ số VN30F1M cho thấy xu hướng ngắn hạn vẫn đang trong trạng thái giằng co. Theo đó, nên ưu tiên quan sát và chỉ nên hành động khi chạm ngưỡng kháng cự và hỗ trợ quan trọng.

THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	5	1070.00	46,922
VN30F2301	19/1/2023	40	1060.30	10,671
VN30F2303	16/3/2023	96	1048.40	299
VN30F2306	15/6/2023	187	1043.00	421

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	1,051.81	0.12	11.01	(29.80)
Dow Jones	33,476.46	(0.90)	19.27	(7.88)
S&P500	3,934.38	(0.73)	19.01	(17.45)
Nikkei 225	27,901.01	1.18	18.88	(3.09)
Shanghai	3,206.95	0.30	14.38	(11.89)
DAX	14,370.72	0.74	13.10	(9.53)
Vàng	1,797.32	0.46		(1.74)
Dầu WTI	71.02	(0.62)		(5.57)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

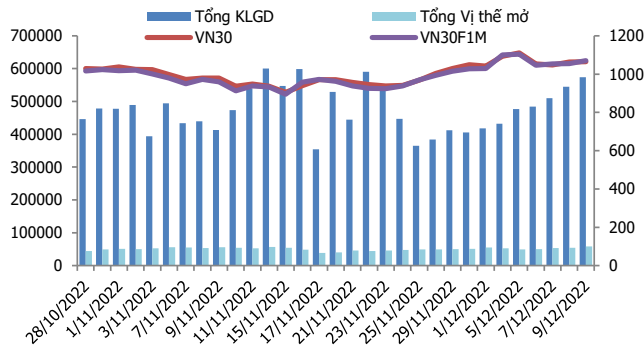
Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - PMI phi sản xuất của ISM (T11)	5/12	54.4	56.5
Anh - PMI xây dựng (T11)	6/12	53.2	50.4
Mỹ - Dự trữ dầu thô	7/12	-12.580M	-5.187M
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	8/12	226K	230K
Mỹ - Giá sản xuất PPI (T11)	9/12	0.3%	0.3%

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ mang sắc đỏ trong phiên giao dịch ngày thứ Sáu với việc cả ba chỉ số chính đều ghi nhận tuần giảm điểm trước nỗi lo dai dẳng về việc Fed sẽ tiếp tục nâng lãi suất. Đóng cửa, Dow Jones Industrial Average giảm 305,02 điểm (-0,9%) xuống 33.476,46 điểm. S&P 500 sụt 0,73% còn 3.934,38 điểm trong khi Nasdaq Composite hạ 0,7% và khép phiên tại 11.004,62 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1064-1068 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1060 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1076-1078 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1074-1076 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.



DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HẾT LẠI CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1070.0	0.00	566,748	5.6	46,922	
VN30F2301	1060.3	0.00	6,889	-4.61	10,671	
VN30F2303	1048.4	0.00	344	112.3	299	
VN30F2306	1043.0	2.00	205	-21.46	421	
Tổng			574,186	5.5	58,313	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HẾT LẠI

- Ưu thế nghiêng về bên mua đã giúp thị trường phái sinh duy trì đà tăng điểm tích cực, với cả 4 HẾT LẠI đóng cửa tăng từ 8,4 đến 20,3 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này tăng 5,46% so với phiên liền trước, đạt 574.186 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HẾT LẠI tháng 12 với 566.748 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HẾT LẠI tháng 12 với 1.975 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 1.358 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.065,31 điểm (thấp hơn 4,69 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.066,63 điểm (+6,33 điểm), VN30F2303 là 1.068,74 điểm (+20,34 điểm) và VN30F2306 là 1.072,19 điểm (+29,19 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	BUY
Hỗ trợ	1064-1068	1060-1065	1040-1056
Kháng cự	1076-1078	1080-1085	1087-1090

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

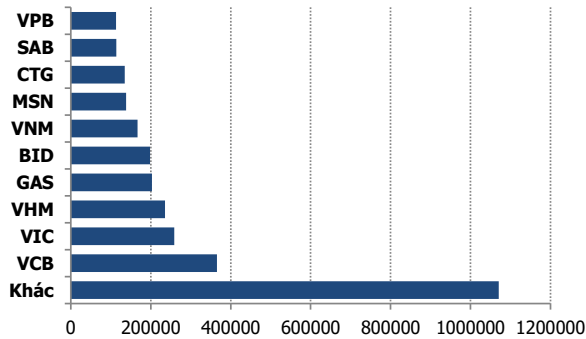


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1051.81	1065.08
Thay đổi	1.28	2.35
%Chg	0.12	0.22
YTD	-29.80	-30.65
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,198.21	2,999.56
P/E	11.01	9.13
P/B	1.69	1.69

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính nói rộng đà hồi phục. Số mã tăng điểm (17) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (9) và 4 mã đứng tham chiếu. STB và VJC trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +1,38 điểm và +1,27 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 2,35 điểm (+0,22%) lên 1.065,08 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 270,42 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 6.125 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 25 liên tiếp với 477,78 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+114 tỷ đồng), STB (+71 tỷ đồng), CTG (+50 tỷ đồng), VHM (+40 tỷ đồng), SSI (+31 tỷ đồng).

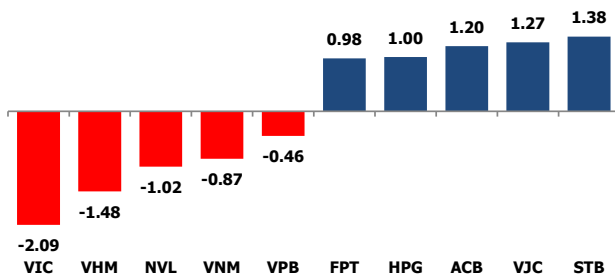
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

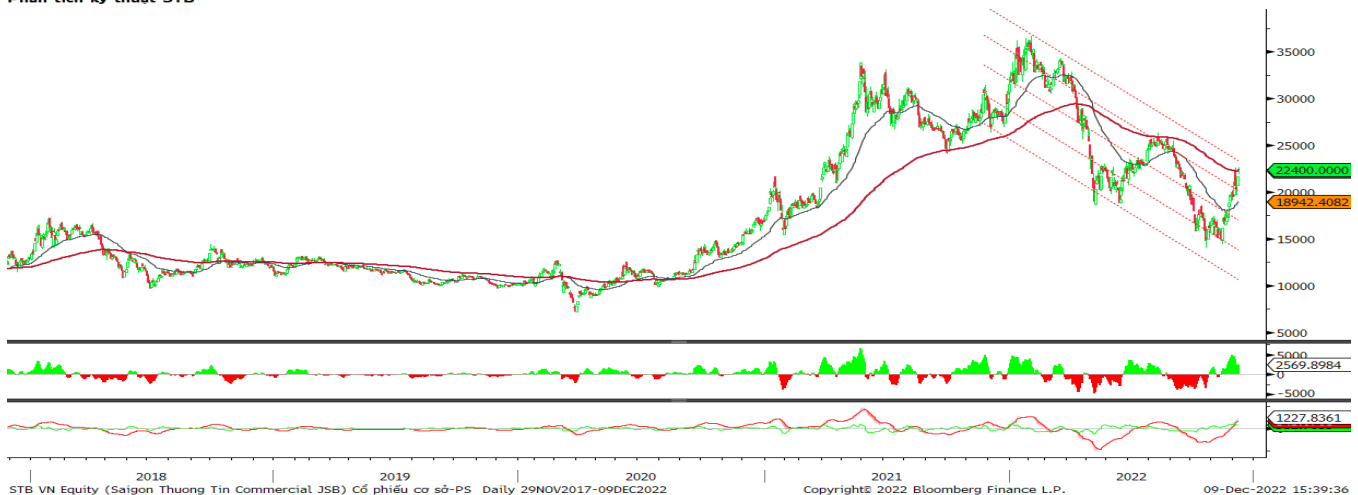
- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 STB, VJC và ACB là những nhân tố chính duy trì đà tăng điểm tích cực của chỉ số VN30. Trong đó, STB đóng góp +1,38 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT STB

Phân tích kỹ thuật STB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	16,900	-0.59	3.30%	232.504	-0.46	5.64	1.20
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	78,000	1.30	2.36%	76.534	0.98	16.24	4.30
VNM	Food Products	80,000	-1.23	2.25%	194.347	-0.87	21.18	5.37
ACB	Banks	23,050	1.77	3.34%	75.682	1.20	5.88	1.40
VIC	Real Estate Management & Development	67,800	-3.00	5.75%	183.893	-2.09	233.91	2.28
TCB	Banks	28,250	0.18	2.89%	124.005	0.12	4.68	0.91
MSN	Food Products	97,000	1.04	6.04%	116.381	0.67	14.38	5.38
HPG	Metals & Mining	19,200	1.59	5.14%	655.61	1.00	7.21	1.14
VHM	Real Estate Management & Development	54,100	-2.35	3.54%	181.113	-1.48	7.49	1.74
MWG	Specialty Retail	46,200	0.43	2.76%	76.958	0.23	13.19	2.90
MBB	Banks	18,200	0.55	3.10%	169.91	0.26	4.70	1.14
STB	Banks	22,400	3.23	3.20%	589.683	1.38	10.18	1.14
VCB	Banks	77,300	0.39	2.72%	131.746	0.16	13.84	2.85
VJC	Airlines	111,500	4.21	8.64%	53.999	1.27	976.59	3.45
HDB	Banks	16,800	1.82	3.03%	47.35	0.55	5.59	1.20
VRE	Real Estate Management & Development	28,900	0.52	5.17%	105.487	0.14	31.79	2.02
VIB	#N/A	20,950	0.00	2.67%	107.237	#N/A	5.26	1.45
SSI	Capital Markets	20,250	-1.46	4.52%	377.471	-0.33	8.99	1.37
CTG	Banks	28,050	0.90	3.70%	138.013	0.19	8.66	1.28
TPB	Banks	22,500	2.27	5.50%	297.675	0.46	5.88	1.16
KDH	Real Estate Management & Development	30,050	-0.83	3.42%	73.233	-0.12	16.83	1.88
NVL	Real Estate Management & Development	16,650	-6.98	6.31%	939.251	-1.02	11.37	0.87
SAB	Food Products	178,000	0.00	1.30%	38.802	0.00	21.12	4.68
GAS	Gas Utilities	106,000	0.00	2.36%	40.056	0.00	15.21	3.58
BID	Banks	39,200	0.51	3.13%	62.958	0.04	12.25	2.06
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,200	0.00	2.26%	54.614	0.00	22.46	0.88
PDR	Capital Markets	16,500	-0.60	5.75%	210.154	-0.03	5.10	1.32
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	30,400	2.01	2.01%	19.42	0.08	41.22	1.66
BVH	Beverages	47,900	-1.24	2.43%	36.345	-0.05	20.30	1.60
GVR	Real Estate Management & Development	15,050	2.38	5.54%	27.816	0.06	14.17	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 của 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.