

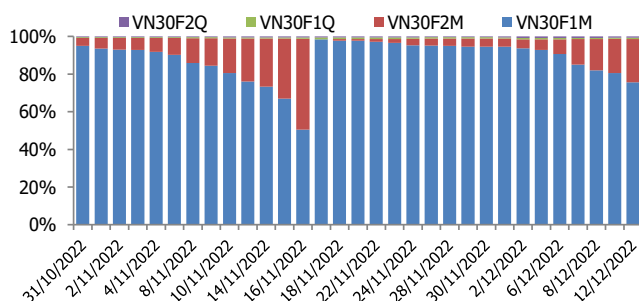
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	1	1059,60	27.082
VN30F2301	19/1/2023	36	1059,00	24.767
VN30F2303	16/3/2023	92	1047,30	353
VN30F2306	15/6/2023	183	1038,60	467

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	1.050,43	0,28	10,80	(29,04)
Dow Jones	33.966,35	(0,42)	19,57	(6,53)
S&P500	3.995,32	(0,61)	19,28	(16,17)
Nikkei 225	28.150,50	(0,05)	18,93	(2,23)
Shanghai	3.176,53	-	14,27	(12,73)
DAX	14.460,20	(0,26)	13,36	(8,97)
Vàng	1.808,09	(0,10)		1,34
Dầu WTI	77,28	2,57		5,37

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Anh - Thay đổi GDP (3T/3T)	12/12	-0,2%	-0,3%
Mỹ - CPI lõi (tháng/tháng) (T11)	13/12	0,3%	0,2%
Mỹ - Quyết định lãi suất	14/12	4,00%	4,50%
Mỹ - Chi số Fed Philadelphia (T12)	15/12	-19,4	
Châu Âu - CPI (năm/năm) (T11)	16/12	10,0%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

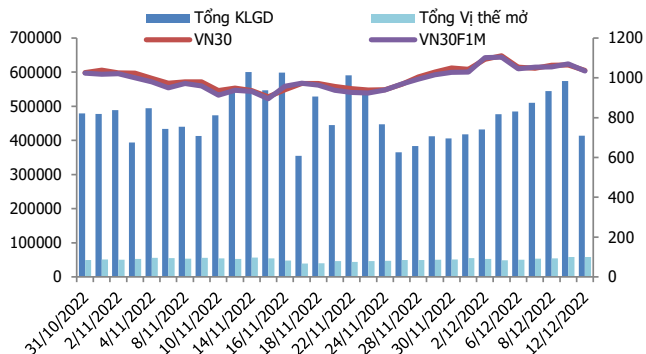
- Thị trường ghi nhận các nhịp dao động giằng co khá mạnh trong phiên, tuy nhiên chỉ số vẫn được duy trì trên mức tham chiếu. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 1,3 đến 5,4 điểm, trong khi chỉ số sơ giảm 0,26 điểm. Tâm lý của nhà đầu tư tiếp tục duy trì ở trạng thái thận trọng trước một phiên dao động giằng co.
- Thị trường trong nước duy trì sắc xanh khi mở cửa phiên sáng 14/12, VN-Index có thời điểm tăng hơn 10 điểm lên sát ngưỡng 1.060 điểm. Tương chừng thị trường sẽ có phiên bùng nổ với các thông tin tích cực được công bố. Tuy nhiên, dường như nhiều nhà đầu tư xem thông tin tích cực này là cơ hội để chốt lời ngắn hạn hơn là để mua vào đón con sóng trung, dài hạn, nên thị trường quay đầu hạ nhiệt sau đó.
- Kịch bản rung lắc 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, đối với phiên đảo hạn, chỉ nên ưu tiên quan sát và chỉ nên hành động khi chạm ngưỡng kháng cự và hỗ trợ quan trọng.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ trượt dài trong phiên giao dịch ngày thứ Tư sau động thái nâng lãi suất mới nhất nhằm ghìm cương lạm phát của Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed). Đóng cửa, chỉ số Dow Jones Industrial Average giảm 142,29 điểm (-0,42%) đóng cửa tại 33.966,35 điểm. Chỉ số S&P 500 hạ 0,61% xuống 3.995,32 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite rớt 0,76% còn 11.170,89 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1020-1024 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1013 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1080-1083 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1064-1067 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 HĐTL

- Thị trường phiên hôm nay duy trì được điểm số trên mức tham chiếu với cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 1,3 đến 5,4 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 12,48% so với phiên liền trước, đạt 399.480 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 12 với 382.118 hợp đồng, lũy kế bán rông khoảng 378 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.037,53 điểm (cao hơn 2,33 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.038,82 điểm (+6,82 điểm), VN30F2303 là 1.040,88 điểm (+18,88 điểm) và VN30F2306 là 1.044,23 điểm (+23,53 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1059,6	0,20	382.118	-13,2	27.082	
VN30F2301	1059,0	0,50	17.070	7,95	24.767	
VN30F2303	1047,3	0,10	135	-34,8	353	
VN30F2306	1038,6	0,40	157	-36,18	467	
Tổng			399.480	-30,4	52.669	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	BUY
Hỗ trợ	1051-1054	1020-1024	1000-1004
Kháng cự	1064-1067	1080-1083	1100-1120

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

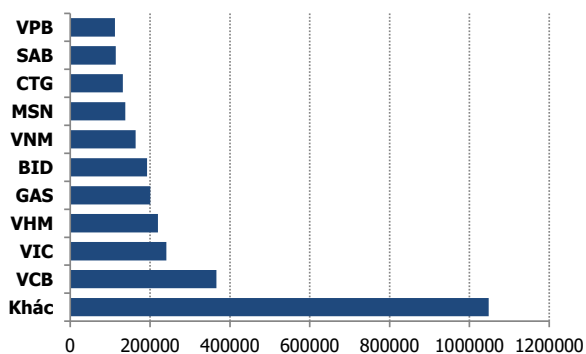


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1050,43	1056,17
Thay đổi	2,98	-0,26
%Chg	0,28	-0,02
YTD	-29,04	-30,53
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4.119,47	2.928,78
P/E	10,80	8,89
P/B	1,65	1,64

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính dao động giảm co. Số mã tăng điểm (13) ngang bằng so với số mã giảm điểm (13) và 4 mã đứng tham chiếu. FPT và VIC trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -0,87 điểm và -0,79 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 0,26 điểm (-0,02%) xuống 1.056,17 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 239,68 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 5.956 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 28 liên tiếp với 23,84 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như VHM (+78 tỷ đồng), NVL (+51 tỷ đồng), HCM (+50 tỷ đồng), STB (+48 tỷ đồng), VCI (+19 tỷ đồng).

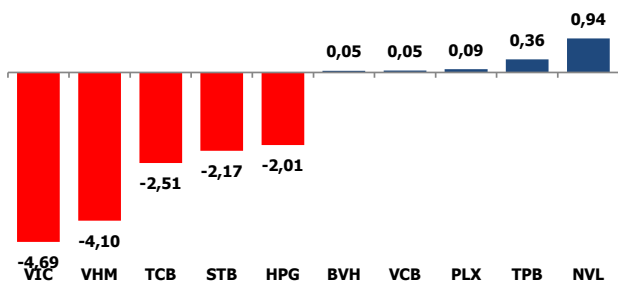
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 FPT, VIC và MSN là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 giảm điểm nhẹ. Trong đó, FPT gây ảnh hưởng -0,87 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐÒ THỊ KỸ THUẬT FPT

Phân tích kỹ thuật FPT



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	16.650	-1,48	4,80%	396,224	-1,14	5,56	1,18
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	77.000	-1,28	2,36%	93,842	-0,98	16,03	4,25
VNM	Food Products	78.500	-1,88	4,46%	248,809	-1,31	20,78	5,27
ACB	Banks	22.500	-2,39	3,56%	72,887	-1,65	5,74	1,36
MSN	Food Products	97.000	0,00	4,17%	88,483	0,00	14,38	5,38
TCB	Banks	27.200	-3,72	4,96%	173,387	-2,51	4,50	0,88
VIC	Real Estate Management & Development	63.100	-6,93	7,77%	187,792	-4,69	217,70	2,12
HPG	Metals & Mining	18.600	-3,13	5,11%	684,278	-2,01	6,99	1,10
VHM	Real Estate Management & Development	50.500	-6,65	7,33%	201,932	-4,10	6,99	1,62
MWG	Specialty Retail	45.900	-0,65	5,11%	161,252	-0,34	13,10	2,88
MBB	Banks	17.700	-2,75	4,25%	225,9	-1,30	4,57	1,11
VCB	Banks	77.400	0,13	4,01%	166,543	0,05	13,86	2,86
STB	Banks	21.300	-4,91	6,10%	459,045	-2,17	9,68	1,09
VJC	Airlines	111.400	-0,09	3,10%	52,002	-0,03	975,71	3,45
HDB	Banks	16.200	-3,57	5,86%	63,981	-1,11	5,39	1,16
VRE	Real Estate Management & Development	27.050	-6,40	10,72%	91,062	-1,76	29,76	1,89
VIB	#N/A	20.350	-2,86	4,93%	97,157	#N/A	5,11	1,41
SSI	Capital Markets	19.150	-5,43	8,64%	530,732	-1,20	8,50	1,30
TPB	Banks	22.900	1,78	4,04%	331,247	0,36	5,98	1,18
CTG	Banks	27.450	-2,14	2,73%	107,007	-0,45	8,48	1,25
NVL	Real Estate Management & Development	17.800	6,91	0,00%	124,402	0,94	12,15	0,93
KDH	Real Estate Management & Development	27.950	-6,99	7,33%	106,205	-1,02	15,65	1,75
SAB	Food Products	178.300	0,17	1,07%	42,172	0,02	21,16	4,69
GAS	Gas Utilities	105.000	-0,94	3,24%	37,398	-0,10	15,07	3,55
BID	Banks	38.100	-2,81	4,72%	77,296	-0,23	11,90	2,00
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11.150	-0,45	3,59%	108,416	-0,02	22,36	0,88
PDR	Capital Markets	15.500	-6,06	11,94%	275,856	-0,28	4,79	1,24
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31.100	2,30	3,62%	26,768	0,09	42,16	1,70
BVH	Beverages	48.500	1,25	2,83%	36,874	0,05	20,56	1,62
GVR	Real Estate Management & Development	14.800	-1,66	6,42%	39,829	-0,04	13,93	1,17

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 đảo 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 đảo 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 đảo hạn hoặc thoát khỏi vị thế trước thời điểm đảo 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.