

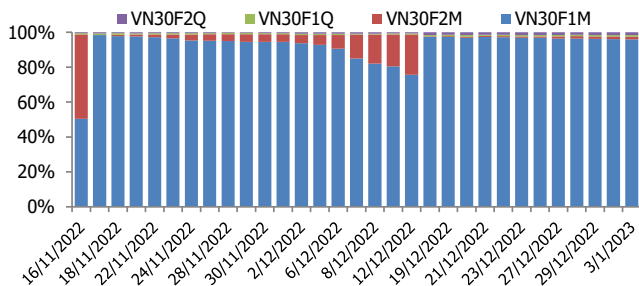
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	16	1045.50	46,686
VN30F2302	16/2/2023	44	1043.80	804
VN30F2306	15/6/2023	163	1028.00	430
VN30F2309	21/9/2023	261	1015.00	796

TỶ TRỌNG VỊ THẾ MỞ GIỮA CÁC KỶ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	%Chg	P/E	YTD
VNIndex	1,043.90	3.66	10.89	3.66
Dow Jones	33,136.37	(0.03)	18.72	(0.03)
S&P500	3,824.14	(0.40)	18.45	(0.40)
Nikkei 225	25,715.83	(1.45)	17.40	(1.45)
Shanghai	3,116.51	0.88	14.03	0.88
DAX	14,181.67	0.80	13.12	1.85
Vàng	1,840.11	0.03		0.88
Dầu WTI	77.06	0.17		(3.99)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Đức - PMI sản xuất (T12)	2/1	46.2	47.1
TQ - PMI sản xuất của Caixin (T12)	3/1	49.4	49.0
Mỹ - PMI sản xuất của ISM (T12)	4/1	49.0	
Mỹ - Dự trữ dầu thô	5/1	0,718M	
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (T12)	6/1	3.7%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

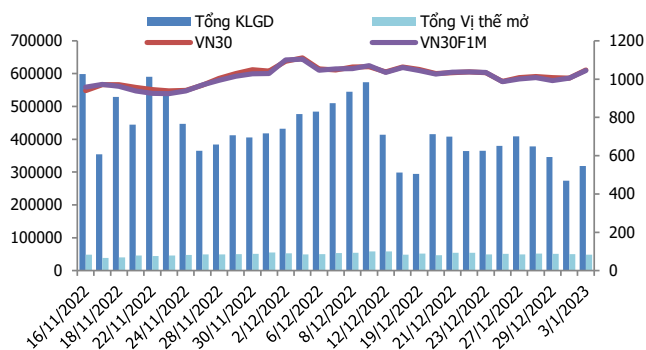
- Thị trường phái sinh nói rộng đà tăng điểm nhờ lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 37,6 đến 43,8 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 42,06 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này giảm nhẹ xuống mức -1,75, cho thấy tâm lý nhà đầu tư vẫn đang khá thận trọng khi mới chỉ có 1 nhịp tăng mạnh trong phiên giao dịch đầu tiên của năm 2023.
- Thị trường đã có sự khởi đầu thuận lợi ở phiên đầu năm mới, dòng tiền nội quay trở lại ở phiên sáng chính là động lực giúp thị trường có phiên tăng mạnh nhất trong vòng 1 tháng qua, trong khi dòng tiền ngoại tiếp tục đổ vào thị trường sau một năm mua ròng 1,25 tỷ USD. Về kỹ thuật, với phiên tăng mạnh hôm nay, nhiều cổ phiếu ở nhóm midcap và smallcap đã vượt qua kênh giảm 1 năm qua, do vậy nhiều cổ phiếu tăng trần nhưng lực kéo chính lại đến từ nhóm bluechips Vn30.
- Thị trường phái sinh nhiều khả năng sẽ ghi nhận thêm một phiên giao dịch tích cực, do các tín hiệu khả quan vẫn đến từ dòng tiền ngoại. Tuy nhiên, tâm lý thận trọng nghi ngờ khả năng đi lên của phái sinh vẫn duy trì trong những phiên giao dịch tới. Theo đó, chiến lược tốt nhất hiện tại là canh phản ứng giá tại các nền hỗ trợ, kháng cự quan trọng của VN30F1M.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Đóng cửa, chỉ số S&P 500 lùi 0,4% xuống 3.824,14 điểm khi chỉ số sản xuất tháng 12 của Mỹ giảm với tốc độ nhanh nhất kể từ tháng 5/2020. Chỉ số Dow Jones hạ 10,88 điểm (-0,03%) xuống 33.136,37 điểm khi cổ phiếu Boeing xoá bớt mức giảm. Chỉ số Nasdaq Composite mất 0,76% còn 10.386,99 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1030-1038 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1020 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1060-1064 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1050-1055 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 HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1045.5	0.00	318,203	16.5	46,686	
VN30F2301	1043.8	5.00	534	94.18	804	
VN30F2303	1028.0	2.00	129	34.4	430	
VN30F2306	1015.0	0.00	114	5.56	796	
Tổng			318,980	16.6	48,716	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HDTL

- Lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã giúp cả 4 HDTL đóng cửa tăng từ 37,6 đến 43,8 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này tăng 16,6% so với phiên liền trước, đạt 318.980 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 1 với 318.203 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 1 với 439 hợp đồng, lụy kế mua ròng khoảng 17.794 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1047,84 điểm (cao hơn 2,34 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1048,88 điểm (+5,08 điểm), VN30F2303 là 1053,31 điểm (+25,31 điểm) và VN30F2306 là 1056,97 điểm (+41,97 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	SELL
Hỗ trợ	1030-1038	1020-1025	1006-1016
Kháng cự	1050-1055	1060-1064	1075-1080

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

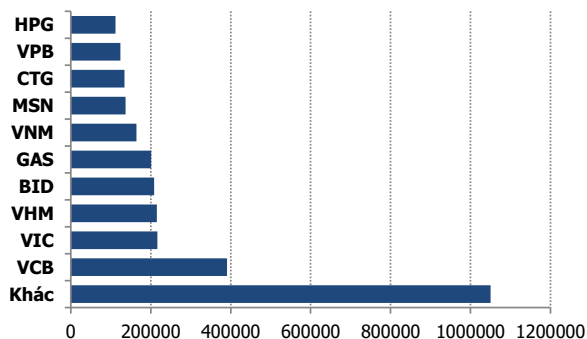


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1043.9	1047.25
Thay đổi	36.81	42.06
%Chg	3.66	4.18
YTD	3.66	4.18
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,164.00	2,953.58
P/E	10.89	8.98
P/B	1.67	1.66

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính hồi phục tích cực. Toàn bộ 30 mã cổ phiếu bluechip đều ghi nhận mức tăng điểm, trong đó HPG và TCB trở thành hai trụ đóng góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +4,18 điểm và +3,83 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 42,06 điểm (+4,18%) lên 1.047,25 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 168,08 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.996 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 7 liên tiếp với 256,14 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+66 tỷ đồng), VNM (+45 tỷ đồng), MSN (+36 tỷ đồng), VIC (+28 tỷ đồng), VHM (+25 tỷ đồng).

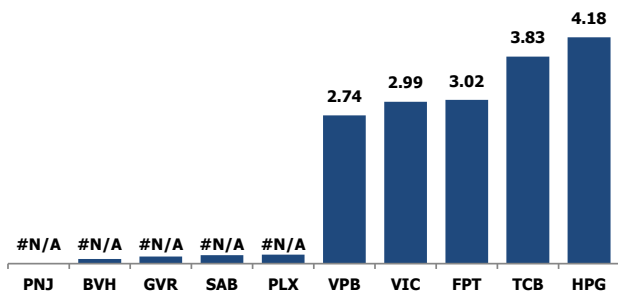
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 HPG, TCB và FPT là những nhân tố chính giúp chỉ số VN30 hồi phục tích cực. Trong đó, HPG đóng góp +4,18 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT HPG

Phân tích kỹ thuật HPG



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18,500	3.35	3.93%	368.237	2.74	6.18	1.31
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,000	4.03	4.17%	121.138	3.02	16.66	4.41
VNM	Food Products	78,500	3.15	3.02%	116.08	2.10	20.78	5.27
ACB	Banks	22,700	3.65	3.42%	34.557	2.40	5.79	1.38
TCB	Banks	27,450	6.19	6.60%	101.672	3.83	4.54	0.89
HPG	Metals & Mining	19,250	6.94	5.77%	531.633	4.18	7.23	1.14
MSN	Food Products	96,000	3.23	3.23%	69.97	2.01	14.24	5.33
VIC	Real Estate Management & Development	56,800	5.58	6.37%	110.261	2.99	195.96	1.91
VHM	Real Estate Management & Development	49,400	2.92	5.11%	78.676	1.59	6.84	1.58
MWG	Specialty Retail	43,950	2.45	3.53%	87.019	1.21	12.54	2.76
MBB	Banks	18,000	5.26	4.65%	133.561	2.35	4.64	1.13
STB	Banks	23,500	4.44	4.89%	377.452	1.97	10.68	1.20
VCB	Banks	82,600	3.25	2.99%	88.383	1.42	14.79	3.05
VJC	Airlines	111,700	2.01	2.38%	43.946	0.62	978.34	3.46
HDB	Banks	16,500	3.45	3.77%	15.43	1.01	5.49	1.18
VRE	Real Estate Management & Development	28,100	6.84	6.64%	108.45	1.71	30.91	1.96
VIB	#N/A	19,900	4.74	5.01%	46.472	#N/A	5.00	1.38
CTG	Banks	28,000	2.75	2.75%	95.934	0.57	8.65	1.28
SSI	Capital Markets	18,900	6.78	6.18%	336.288	1.31	8.39	1.28
TPB	Banks	21,900	4.04	4.04%	50.074	0.77	5.72	1.13
KDH	Real Estate Management & Development	28,000	5.66	6.02%	49.275	0.73	15.68	1.76
SAB	Food Products	169,000	1.26	3.15%	20.719	0.15	20.05	4.45
NVL	Real Estate Management & Development	14,650	4.64	6.14%	175.012	0.53	10.00	0.77
GAS	Gas Utilities	105,000	3.45	3.04%	29.856	0.35	15.07	3.55
BID	Banks	41,200	6.74	5.51%	69.973	0.55	12.87	2.17
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,050	3.76	4.72%	66.435	0.20	22.16	0.87
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	32,950	3.94	3.61%	24.234	0.17	44.67	1.80
PDR	Capital Markets	14,550	6.99	5.43%	212.945	0.27	4.49	1.16
BVH	Beverages	47,700	2.36	2.69%	12.771	0.09	20.22	1.59
GVR	Real Estate Management & Development	14,600	5.80	5.80%	31.155	0.13	13.74	1.16

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.