

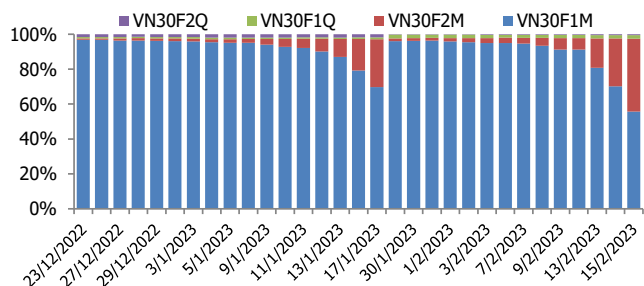
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	1	1037.00	28,468
VN30F2303	16/3/2023	29	1036.50	21,379
VN30F2306	15/6/2023	120	1032.90	1,037
VN30F2309	21/9/2023	218	1028.20	249

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	1,048.20	0.92	13.63	4.08
Dow Jones	34,128.05	0.11	20.14	2.96
S&P500	4,147.60	0.28	19.78	8.02
Nikkei 225	27,666.61	0.60	22.68	6.02
Shanghai	3,280.34	(0.00)	14.25	6.19
DAX	15,506.34	0.82	12.66	11.37
Vàng	1,841.42	0.29		0.95
Dầu WTI	78.87	0.36		(1.73)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Nhật Bản - Tổng GDP (Quý 4)	13/2	-0.3%	0.2%
Mỹ - CPI lõi (Tháng 1)	14/2	0.4%	0.4%
Mỹ - Doanh số bán lẻ lõi (Tháng 1)	15/2	-0.9%	2.3%
Mỹ - Chi số PPI (Tháng 1)	16/2	-0.4%	
Anh - Doanh số bán lẻ (Tháng 1)	17/2	-1.0%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

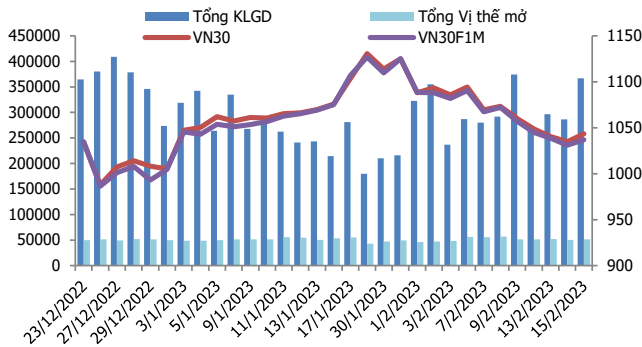
- Thị trường phái sinh hôm nay hồi phục tích cực nhờ lực kéo từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch. Đóng cửa, cả 4 HDTL tăng từ 6,1 đến 11,6 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 8,41 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục giảm xuống mức âm 6,34 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái tâm lý bi quan trước các nhịp giảm điểm liên tiếp của thị trường.
- Thị trường cơ sở phục hồi phiên đầu tiên sau khi đã trải qua 2 tuần giảm và vẫn mất hơn 7 điểm ở tuần này, do vậy chưa làm thay đổi xu hướng giảm trong ngắn hạn. Điểm tích cực là độ rộng thị trường ở 2 phiên vừa qua khá tích cực nhờ sự trở lại của nhóm cổ phiếu vừa và nhỏ. Thanh khoản thị trường cũng tăng trở lại dù vẫn ở mức thấp nhờ nhóm cổ phiếu đầu tư công và ngân hàng.
- Thị trường phái sinh trở lại với sắc xanh sau 2 tuần điều chỉnh. Tuy nhiên, với việc basis hiện vẫn đang ở mức âm và không có thông tin kinh tế quan trọng hỗ trợ, nhà đầu tư cần tiếp tục thận trọng quan sát vì đây có thể chỉ là 1 nhịp hồi phục kỹ thuật và thị trường vẫn chưa chấm dứt được xu hướng đi xuống trong ngắn hạn.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số Dow Jones nhích 38,78 điểm (+0,11%) lên 34.128,05 điểm, tăng hơn 250 điểm từ mức đáy trong phiên. Chỉ số S&P 500 tiến 0,28% lên 4.147,60 điểm, được hỗ trợ nhờ cổ phiếu SolarEdge và Generac, khi lần lượt vọt 9,05% và 8%. Chỉ số Nasdaq Composite cộng 0,92% lên 12.070,59 điểm, được thúc đẩy bởi đà leo dốc 13,35% của cổ phiếu Airbnb sau báo cáo lợi nhuận vượt kỳ vọng.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1027-1031 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1022 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1054-1062 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1045-1048 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

- Lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã giúp cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 6,1 đến 11,6 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 28,09% so với phiên liền trước, đạt 366.884 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 348.395 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 2 với 5.481 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 4.247 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1043,38 điểm (cao hơn 6,38 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1044,41 điểm (+7,91 điểm), VN30F2306 là 1047,78 điểm (+14,88 điểm) và VN30F2309 là 1051,42 điểm (+23,22 điểm).

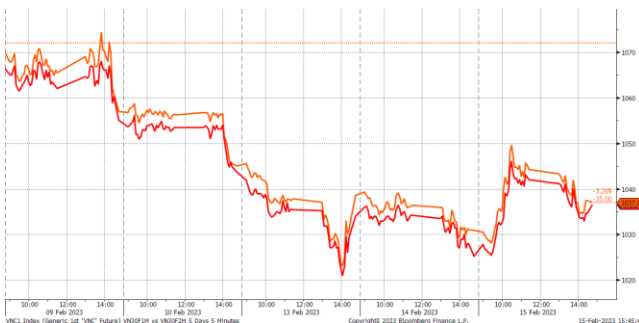
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1037.0	8.00	348,395	25.9	28,468	
VN30F2303	1036.5	33.00	18,187	90.92	21,379	
VN30F2306	1032.9	48.00	217	210.0	1,037	
VN30F2309	1028.2	7.00	85	117.95	249	
Tổng			366,884	28.1	51,133	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	SELL
Hỗ trợ	1027-1031	1016-1022	992-1000
Kháng cự	1045-1048	1054-1062	1071-1080

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

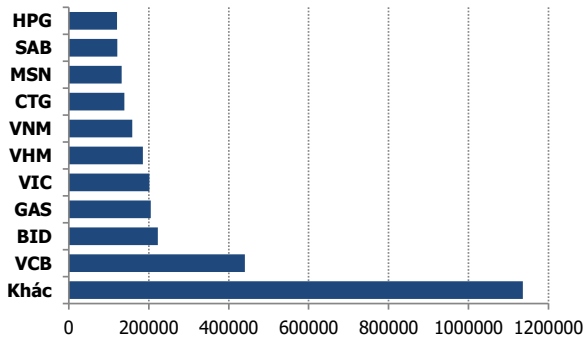


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1048.2	1043.34
Thay đổi	9.56	8.41
%Chg	0.92	0.81
YTD	4.08	3.80
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,183.42	3,062.72
P/E	13.63	10.96
P/B	1.67	1.61

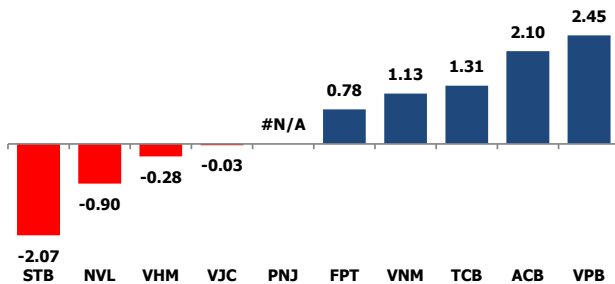
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính hồi phục tích cực. Số mã tăng điểm (25) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (4) và 1 mã đứng tham chiếu, trong đó VPB và ACB trở thành hai trụ đỡ tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +2,45 điểm và +2,1 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 8,41 điểm (+0,81%) lên 1.043,34 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 227,35 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 5.181 tỷ đồng.
- Khối ngoại quay lại bán ròng với 320,12 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như STB (-177 tỷ đồng), NVL (-72 tỷ đồng), DXG (-57 tỷ đồng), VIC (-52 tỷ đồng), VND (-44 tỷ đồng).

TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX

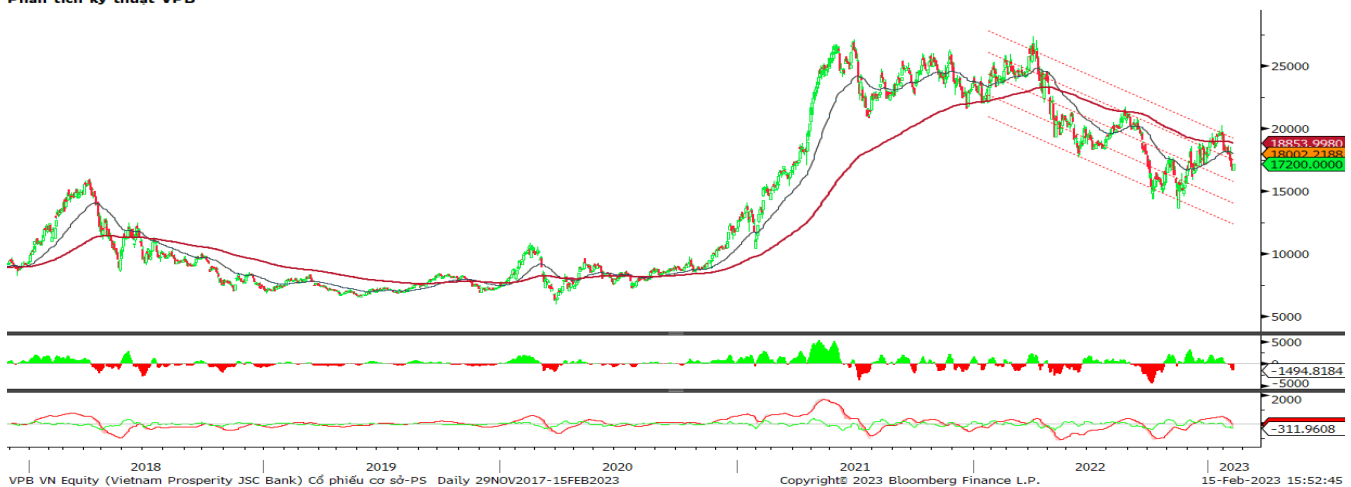


NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, ACB và TCB là những nhân tố chính đưa chỉ số VN30 quay lại với sắc xanh. Trong đó, VPB đóng góp +2,45 điểm cho chỉ số VN30.

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VPB

Phân tích kỹ thuật VPB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	17,200	2.99	2.99%	215.655	2.45	6.29	1.22
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	81,600	0.99	1.99%	52.492	0.78	16.99	4.50
ACB	Banks	24,550	2.94	3.79%	81.035	2.10	6.26	1.49
HPG	Metals & Mining	20,800	0.97	3.95%	417.722	0.67	7.81	1.23
VNM	Food Products	76,000	1.74	2.15%	108.817	1.13	20.12	5.10
TCB	Banks	27,400	2.05	3.76%	71.901	1.31	4.54	0.89
MSN	Food Products	93,000	0.11	1.41%	57.315	0.07	13.79	5.16
VIC	Real Estate Management & Development	52,900	0.00	3.93%	173.758	0.00	182.51	1.78
VCB	Banks	93,000	0.54	3.29%	83.672	0.27	16.65	3.43
MWG	Specialty Retail	42,750	0.59	2.35%	46.622	0.29	12.20	2.69
VHM	Real Estate Management & Development	42,500	-0.58	2.64%	180.569	-0.28	5.89	1.36
MBB	Banks	18,000	0.84	2.82%	117.725	0.39	4.64	1.13
STB	Banks	23,350	-4.30	7.19%	789.193	-2.07	10.61	1.19
HDB	Banks	17,800	0.85	2.56%	32.242	0.28	5.93	1.27
VJC	Airlines	102,700	-0.10	1.88%	18.867	-0.03	899.51	3.18
VRE	Real Estate Management & Development	28,350	1.25	2.90%	27.296	0.33	31.19	1.98
TPB	Banks	23,800	1.28	3.84%	162.182	0.30	6.22	1.23
VIB	#N/A	20,700	0.98	3.70%	69.036	#N/A	5.16	1.34
CTG	Banks	28,900	0.70	2.62%	42.677	0.15	8.92	1.32
SSI	Capital Markets	19,100	1.06	2.93%	197.874	0.22	8.48	1.29
SAB	Food Products	189,000	0.53	1.86%	14.592	0.07	22.43	4.97
NVL	Real Estate Management & Development	11,150	-6.69	6.28%	580.518	-0.90	7.61	0.58
GAS	Gas Utilities	107,100	1.42	1.70%	19.44	0.15	15.37	3.62
BID	Banks	44,000	1.38	3.01%	26.635	0.13	13.75	2.31
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,000	1.27	2.55%	59.72	0.09	24.06	0.95
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,750	1.97	3.45%	26.156	0.10	52.54	2.11
BVH	Beverages	49,400	0.61	1.53%	8.008	0.02	20.94	1.65
BCM	#N/A	84,900	0.47	1.92%	4.255	#N/A	51.32	5.02
PDR	Capital Markets	10,900	2.83	13.00%	52.549	0.09	3.37	0.87
GVR	Real Estate Management & Development	14,500	2.47	4.27%	19.788	0.06	13.65	1.15

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.