

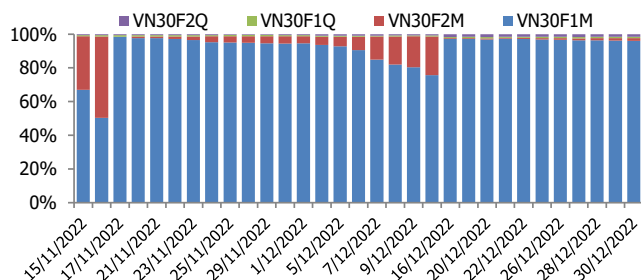
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	17	1004.50	48,041
VN30F2302	16/2/2023	45	1000.00	759
VN30F2306	15/6/2023	164	990.00	403
VN30F2309	21/9/2023	262	977.40	788

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	1,007.09	(0.22)	10.50	-
Dow Jones	33,147.25	(0.22)	18.73	-
S&P500	3,839.50	(0.25)	18.52	-
Nikkei 225	26,094.50	0.00	17.65	-
Shanghai	3,089.26	0.51	13.91	-
DAX	14,069.26	1.05	13.01	1.05
Vàng	1,829.61	0.31		0.31
Dầu WTI	79.90	(0.45)		(0.45)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - Doanh số nhà chờ bán (T11)	28/12	-4.6%	-4.0%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	29/12	216K	225K
Mỹ - Dự trữ dầu thô	29/12	-5,894M	0,718M

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

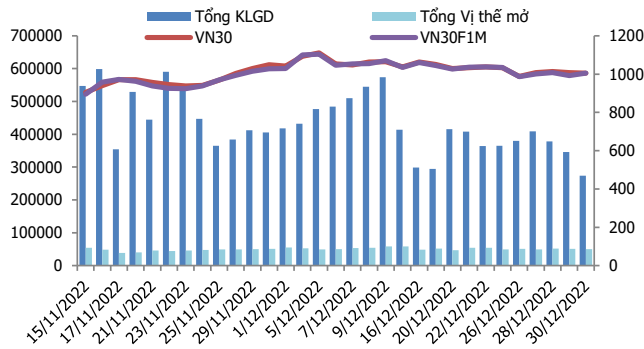
- Lực kéo mạnh từ bên mua xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã giúp thị trường phái sinh hồi phục. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 3,7 đến 11,5 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 3,11 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này cải thiện mạnh lên mức -0,69, cho thấy tâm lý nhà đầu tư đã trở nên tích cực hơn trước tín hiệu hồi phục của thị trường trong phiên giao dịch cuối năm.
- Thị trường trong nước khép lại một năm đầy sóng gió ở ngưỡng 1.007,09 điểm, đây cũng là tuần giảm thứ 3 trong 4 tuần gần đây. Điểm sáng là khối ngoại vẫn duy trì mạch mua ròng ở tháng thứ 2 liên tiếp, qua đó ghi nhận một năm vào ròng mạnh hơn 1,24 tỷ USD sau 2 năm bán ròng liên tiếp. Thị trường sẽ quay trở lại sau kỳ nghỉ lễ dài ngày, tín hiệu từ dòng tiền cùng kết quả kinh doanh quý 4/2022 sẽ là cơ sở để nhà đầu tư ra quyết định cho chiến lược đầu tư trong năm mới.
- Thị trường phái sinh nhiều khả năng sẽ duy trì xu hướng đi ngang thận trọng trong phiên giao dịch đầu tiên của năm 2023, do các tín hiệu từ thị trường cơ sở cũng như thanh khoản thị trường đều chưa thật sự khả quan. Nhà đầu tư nên cẩn trọng khi giao dịch và không nên mua đuổi.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm điểm vào ngày thứ Sáu (30/12) để khép lại một năm 2022 khó khăn với sắc đỏ, khi Phố Wall kết thúc năm tồi tệ nhất kể từ năm 2008 bằng một phiên âm ảm. Đóng cửa, chỉ số Dow Jones lùi 73,55 điểm (-0,22%) xuống 33.147,25 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 0,25% còn 3.839,50 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite hạ 0,11% xuống 10.466,88 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 992-997 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 983 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1020-1029 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1010-1014 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	1004.5	54.00	273,078	-20.9	48,041	
VN30F2301	1000.0	47.00	275	-50.00	759	
VN30F2303	990.0	32.00	96	35.2	403	
VN30F2306	977.4	45.00	108	-18.18	788	
Tổng			273,557	-21.0	49,991	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HẾT LẠI

- Lực kéo mạnh từ bên mua xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã giúp cả 4 HẾT LẠI đóng cửa tăng từ 3,7 đến 11,5 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 20,97% so với phiên liền trước, đạt 273.557 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HẾT LẠI tháng 1 với 273.078 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HẾT LẠI tháng 1 với 991 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 18.233 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1005,9 điểm (cao hơn 1,4 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1006,9 điểm (+6,9 điểm), VN30F2303 là 1007,9 điểm (+17,9 điểm) và VN30F2306 là 1011,15 điểm (+33,75 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	992-997	980-984	963-970
Kháng cự	1010-1014	1020-1029	1040-1062

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

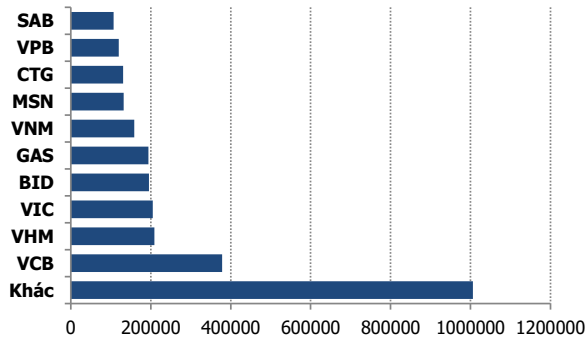


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1007.09	1005.19
Thay đổi	-2.20	-3.11
%Chg	-0.22	-0.31
YTD	0.00	0.00
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,017.29	2,837.90
P/E	10.50	8.62
P/B	1.61	1.59

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính quay đầu giảm điểm. Tuy nhiên, số mã tăng điểm (14) lại áp đảo so với số mã giảm điểm (13) và 3 mã đứng tham chiếu. VNM và MBB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -0,79 điểm và -0,78 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 3,11 điểm (-0,31%) xuống 1.005,19 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 131,58 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.239 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 6 liên tiếp với 530,51 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như STB (+104 tỷ đồng), BCM (+77 tỷ đồng), HPG (+71 tỷ đồng), DGC (+48 tỷ đồng), VHC (+33 tỷ đồng).

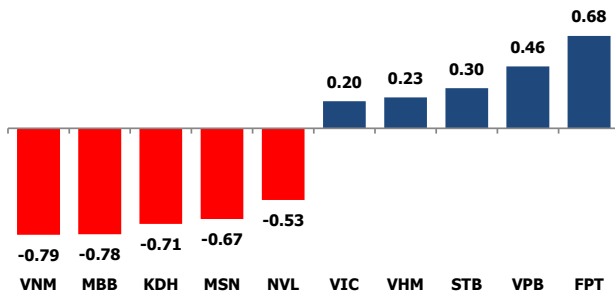
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VNM, MBB và KDH là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 tiếp tục chìm trong sắc đỏ. Trong đó, VNM gây ảnh hưởng -0,79 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐÒ THỊ KỸ THUẬT VNM

Phân tích kỹ thuật VNM



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	17,900	0.56	2.84%	179.343	0.46	5.98	1.27
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	76,900	0.92	1.18%	48.071	0.68	16.01	4.24
VNM	Food Products	76,100	-1.17	2.50%	92.314	-0.79	20.14	5.11
ACB	Banks	21,900	-0.45	1.83%	29.406	-0.30	5.58	1.33
MSN	Food Products	93,000	-1.06	3.23%	42.99	-0.67	13.79	5.16
TCB	Banks	25,850	-0.39	0.97%	56.606	-0.24	4.28	0.84
HPG	Metals & Mining	18,000	0.00	3.07%	262.476	0.00	6.76	1.07
VHM	Real Estate Management & Development	48,000	0.42	3.05%	57.801	0.23	6.65	1.54
VIC	Real Estate Management & Development	53,800	0.37	1.70%	131.922	0.20	185.61	1.81
MWG	Specialty Retail	42,900	0.00	2.26%	70.486	0.00	12.24	2.70
MBB	Banks	17,100	-1.72	2.63%	71.562	-0.78	4.41	1.07
STB	Banks	22,500	0.67	2.25%	238.824	0.30	10.23	1.15
VCB	Banks	80,000	-0.87	3.88%	123.471	-0.38	14.33	2.95
VJC	Airlines	109,500	0.27	4.06%	14.711	0.08	959.07	3.39
HDB	Banks	15,950	0.31	1.92%	24.101	0.09	5.31	1.14
VRE	Real Estate Management & Development	26,300	-0.75	4.02%	48.08	-0.19	28.93	1.84
VIB	#N/A	19,000	0.53	1.85%	27.205	#N/A	4.77	1.31
CTG	Banks	27,250	0.93	2.24%	37.774	0.19	8.41	1.24
SSI	Capital Markets	17,700	0.57	2.84%	114.754	0.11	7.86	1.20
TPB	Banks	21,050	-1.64	2.38%	69.408	-0.32	5.50	1.09
KDH	Real Estate Management & Development	26,500	-5.19	6.79%	21.483	-0.71	14.84	1.66
SAB	Food Products	166,900	-3.47	5.39%	28.45	-0.44	19.80	4.39
NVL	Real Estate Management & Development	14,000	-4.44	6.43%	151.128	-0.53	9.56	0.73
GAS	Gas Utilities	101,500	-1.07	1.28%	14.441	-0.11	14.57	3.43
BID	Banks	38,600	-3.50	7.51%	103.592	-0.30	12.06	2.03
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	10,650	1.43	1.90%	37.849	0.07	21.36	0.84
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31,700	1.12	1.43%	16.256	0.05	42.98	1.73
PDR	Capital Markets	13,600	1.49	7.39%	116.954	0.06	4.20	1.08
BVH	Beverages	46,600	0.22	1.07%	6.576	0.01	19.75	1.55
GVR	Real Estate Management & Development	13,800	0.00	2.55%	8.01	0.00	12.99	1.10

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.