

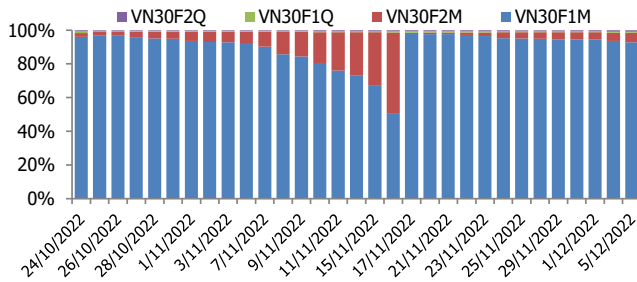
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	10	1104.00	45,391
VN30F2301	19/1/2023	45	1110.00	2,745
VN30F2303	16/3/2023	101	1084.10	349
VN30F2306	15/6/2023	192	1080.00	425

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	1,093.67	1.26	11.45	(27.00)
Dow Jones	33,947.10	(1.40)	19.54	(6.58)
S&P500	3,998.84	(1.79)	19.33	(16.10)
Nikkei 225	27,849.49	0.10	18.84	(3.27)
Shanghai	3,211.81	1.76	14.39	(11.76)
DAX	14,447.61	(0.56)	13.17	(9.05)
Vàng	1,773.72	0.29		(3.03)
Dầu WTI	77.53	0.78		3.08

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	
Mỹ - Dự trữ dầu thô	7/12	-12.580M	
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	8/12	225K	
Mỹ - Giá sản xuất PPI (T11)	9/12	0.2%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

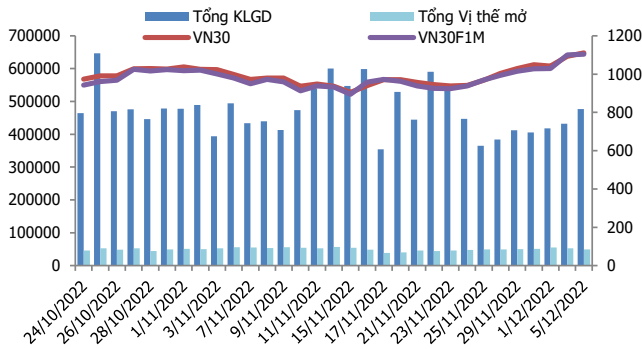
- Thị trường phái sinh vẫn duy trì được sắc xanh nhờ lực cầu trở lại mạnh mẽ trong phiên chiều. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 1 đến 10,1 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 17,95 điểm. Basis của các HĐTL phiên này giảm xuống mức từ -30,94 đến -1 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư có phần thận trọng trước đà tăng điểm khá mạnh và liên tiếp của thị trường.
- Thị trường nối dài chuỗi tăng kể từ đáy sang tuần thứ 4 liên tiếp, chỉ số Vn-index đã phục hồi hơn 25% và bước vào thị trường giá lên (Bull markets). Thanh khoản khớp lệnh trên sàn HOSE tiếp tục ở mức cao với giá trị khớp lệnh đạt 17.955 tỷ đồng so với mức 16.295 tỷ đồng ở phiên liền trước. Hôm nay là phiên có hàng tỷ cổ phiếu về tài khoản trong phiên chiều nhưng thị trường vẫn không có nhịp điều chỉnh trong phiên.
- Trên thị trường chứng khoán phái sinh, bên Mua (Long) vẫn giữ vững ưu thế khi thị trường cơ sở bật tăng mạnh mẽ. Bên cạnh đó, điểm hấp dẫn cho vị thế mua chính là việc độ lệch giữa phái sinh và cơ sở vẫn chênh gần 7 điểm và khối ngoại đang mua ròng khoảng 9.731 hợp đồng. Do vậy, nhà đầu tư nên tiếp tục duy trì chiến lược mua thấp, bán cao trong biên độ ở phiên giao dịch mới.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm điểm do lo ngại rằng Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed) có thể tiếp tục thắt chặt chính sách cho đến khi khiến nền kinh tế rơi vào suy thoái. Đóng cửa, chỉ số Dow Jones rút 482,78 điểm (-1,4%) xuống 33.947,10 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 1,79% còn 3.998,84 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite lùi 1,93% xuống 11.239,94 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1081-1090 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1070 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1120-1126 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1110-1116 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 cầu trở lại trong phiên chiều đã lấn át các nhịp dao động mạnh trong phiên sáng. Đóng cửa, cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 1 đến 10,1 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 10,34% so với phiên liền trước, đạt 476.557 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 12 với 472.082 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 12 với 181 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 9.731 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.111,33 điểm (cao hơn 7,33 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.112,71 điểm (+2,71 điểm), VN30F2303 là 1.114,92 điểm (+30,82 điểm) và VN30F2306 là 1.118,51 điểm (+38,51 điểm).

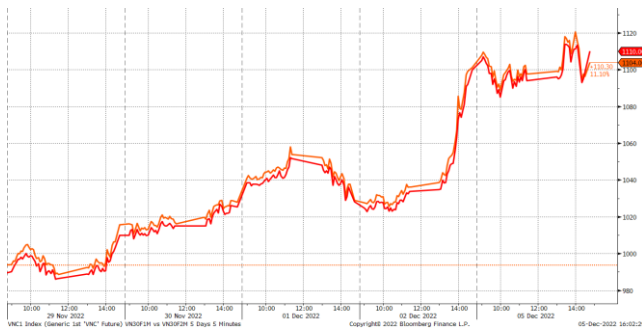
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1104.0	1.00	472,082	9.8	45,391	
VN30F2301	1110.0	53.00	2,451	70.33	2,745	
VN30F2303	1084.1	0.00	1,139	401.8	349	
VN30F2306	1080.0	16.00	885	172.31	425	
Tổng			476,557	10.3	48,910	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	BUY
Hỗ trợ	1081-1090	1060-1080	1050-1068
Kháng cự	1120-1126	1126-1140	1140-1150

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

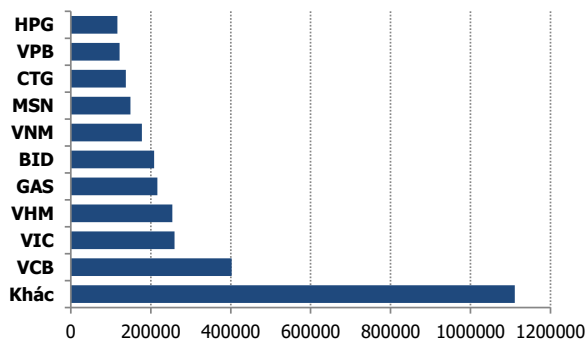


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1093.67	1110.94
Thay đổi	13.66	17.95
%Chg	1.26	1.64
YTD	-27.00	-27.66
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,365.20	3,154.78
P/E	11.45	9.52
P/B	1.75	1.76

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính tiếp tục giữ vững sắc xanh. Số mã tăng điểm (25) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (3) và 2 mã đứng tham chiếu. VPB và STB trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +3,88 điểm và +2,86 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 17,95 điểm (+1,64%) lên 1.110,94 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 458,24 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 10.748 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 21 liên tiếp với 1.393,93 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+185 tỷ đồng), SSI (+178 tỷ đồng), VHM (+177 tỷ đồng), STB (+118 tỷ đồng), MSN (+76 tỷ đồng).

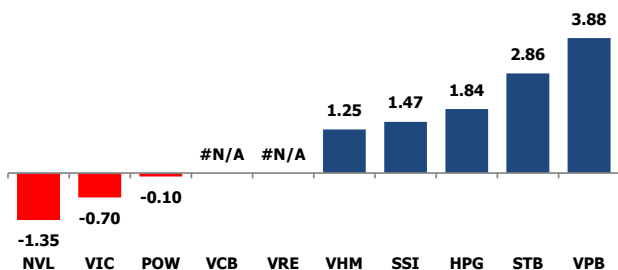
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, STB và HPG là những nhân tố chính duy trì đà tăng điểm của chỉ số VN30. Trong đó, VPB đóng góp +3,88 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



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	18,150	4.91	5.44%	781.604	3.88	6.06	1.29
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	78,300	1.16	2.07%	95.091	0.88	16.30	4.32
VNM	Food Products	85,000	1.19	1.78%	175.563	0.87	22.50	5.70
ACB	Banks	23,600	0.43	3.45%	111.271	0.30	6.02	1.43
MSN	Food Products	105,000	1.06	7.32%	107.276	0.74	15.57	5.83
TCB	Banks	29,000	0.69	3.47%	246.593	0.48	4.80	0.94
VIC	Real Estate Management & Development	68,100	-1.02	2.94%	158.678	-0.70	238.00	2.29
HPG	Metals & Mining	20,000	2.83	4.62%	930.833	1.84	7.51	1.19
VHM	Real Estate Management & Development	58,300	1.92	2.64%	264.715	1.25	8.07	1.87
MWG	Specialty Retail	47,600	1.28	3.83%	199.404	0.69	13.59	2.99
MBB	Banks	19,000	1.06	2.93%	379.38	0.52	4.90	1.19
VCB	Banks	85,000	0.00	5.45%	141.433	0.00	15.22	3.14
STB	Banks	22,300	6.95	2.06%	855.353	2.86	10.14	1.14
HDB	Banks	16,950	2.73	3.00%	66.155	0.83	5.64	1.21
VJC	Airlines	106,900	0.38	1.69%	73.132	0.11	936.30	3.31
VRE	Real Estate Management & Development	31,550	0.00	2.10%	73.802	0.00	34.71	2.20
VIB	#N/A	21,900	2.34	3.73%	191.582	#N/A	5.50	1.51
SSI	Capital Markets	20,800	6.94	5.05%	725.4	1.47	9.23	1.41
CTG	Banks	28,600	2.33	2.88%	217.228	0.49	8.83	1.30
TPB	Banks	23,150	1.54	4.58%	379.03	0.32	6.05	1.20
NVL	Real Estate Management & Development	22,150	-6.93	11.51%	1387.378	-1.35	15.12	1.16
KDH	Real Estate Management & Development	31,100	6.87	4.71%	106.876	0.97	17.41	1.95
SAB	Food Products	179,700	1.53	2.20%	30.025	0.20	21.32	4.73
GAS	Gas Utilities	113,200	1.80	2.62%	56.405	0.20	16.25	3.83
BID	Banks	41,250	0.12	3.58%	68.569	0.01	12.89	2.17
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,500	-1.71	3.91%	160.978	-0.10	23.06	0.91
PDR	Capital Markets	16,650	6.73	7.42%	580.897	0.30	5.14	1.33
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	32,050	1.91	2.22%	28.357	0.08	43.45	1.75
BVH	Beverages	50,500	4.77	3.91%	78.393	0.18	21.41	1.68
GVR	Real Estate Management & Development	15,600	0.65	4.22%	46.703	0.02	14.69	1.24

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.