

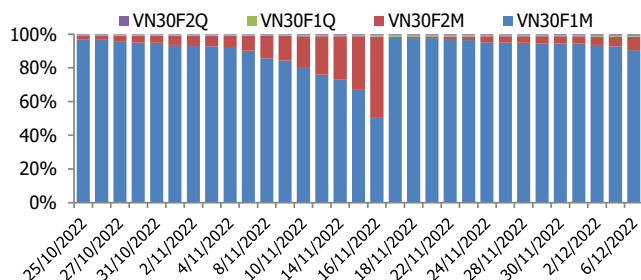
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	9	1046.00	45,741
VN30F2301	19/1/2023	44	1042.00	3,970
VN30F2303	16/3/2023	100	1032.90	357
VN30F2306	15/6/2023	191	1028.30	421

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	1,048.69	(4.11)	10.98	(30.01)
Dow Jones	33,596.34	(1.03)	19.34	(7.55)
S&P500	3,941.26	(1.44)	19.05	(17.31)
Nikkei 225	27,717.00	(0.61)	18.75	(3.73)
Shanghai	3,212.53	0.02	14.39	(11.74)
DAX	14,343.19	(0.72)	13.08	(9.71)
Vàng	1,769.59	(0.08)		(3.26)
Dầu WTI	74.20	(0.07)		(1.34)

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	50.4
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

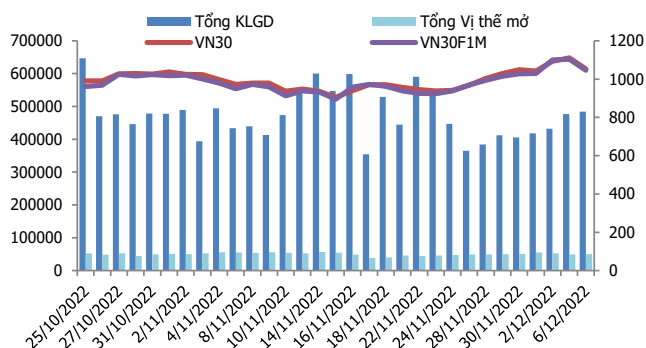
- Thị trường phái sinh gặp áp lực chốt lời mạnh xuyên suốt phiên giao dịch. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 51,2 đến 68 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 56,88 điểm. Basis của các HĐTL phiên này cải thiện đôi chút lên mức từ -25,76 đến -8,06 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư vẫn được duy trì ở trạng thái ổn định trước một phiên điều chỉnh mạnh.
- Thị trường trong nước xuất hiện phiên chốt lời mạnh nhất kể từ khi tạo đáy, đây cũng là phiên điều chỉnh thứ 2 trong 5 phiên gần đây. Thanh khoản trên toàn bộ thị trường tiếp tục ở mức cao với giá trị khớp lệnh đạt gần 27.000 tỷ đồng so với mức 23.000 tỷ đồng ở phiên liền trước, đây có thể là tuần có thanh khoản ở mức cao tương đương với quý 1 đầu năm.
- Trên thị trường chứng khoán phái sinh, bên bán tạm thời chiếm ưu thế khi thị trường cơ sở có một phiên điều chỉnh sau chuỗi tăng liên tiếp. Tuy nhiên, điểm hấp dẫn cho vị thế mua chính là việc độ lệch giữa phái sinh và cơ sở vẫn chênh hơn 8 điểm và khối ngoại đang mua ròng khoảng 7.460 hợp đồng. Do vậy, nhà đầu tư nên tiếp tục duy trì chiến lược mua thấp, bán cao trong biên độ.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ tiếp tục giảm điểm do lo ngại về suy thoái kinh tế bao trùm Phố Wall. Đóng cửa, chỉ số S&P 500 lùi 1,44% xuống 3.941,26 điểm, chỉ số Nasdaq Composite mất 2% còn 11.014,89 điểm và chỉ số Dow Jones rút 350,76 điểm (-1,03%) xuống 33.596,34 điểm. Chứng khoán Mỹ nổi dài đà sụt giảm trong ngày thứ Hai (05/12), với S&P 500 giảm phiên thứ 4 liên tiếp và có phiên tiêu cực thứ 7 trong 8 phiên vừa qua.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1033-1036 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1024 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1060-1063 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1056-1060 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

- Áp lực chốt lời mạnh xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 51,2 đến 68 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 1,66% so với phiên liền trước, đạt 484.449 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 12 với 476.925 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 12 với 2.271 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 7.460 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.054,4 điểm (cao hơn 8,4 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.055,7 điểm (+13,7 điểm), VN30F2303 là 1.057,8 điểm (+24,9 điểm) và VN30F2306 là 1.061,21 điểm (+32,91 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1046.0	6.00	476,925	1.0	45,741	
VN30F2301	1042.0	3.00	4,307	75.72	3,970	
VN30F2303	1032.9	2.00	2,219	94.8	357	
VN30F2306	1028.3	3.00	998	12.77	421	
Tổng			484,449	1.7	50,489	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	BUY
Hỗ trợ	1033-1036	1025-1028	1015-1024
Kháng cự	1060-1063	1064-1068	1068-1075

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

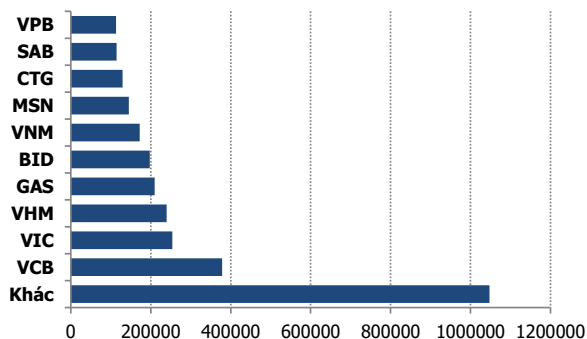


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1048.69	1054.06
Thay đổi	-44.98	-56.88
%Chg	-4.11	-5.12
YTD	-30.01	-31.36
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,185.73	3,002.17
P/E	10.98	9.04
P/B	1.68	1.67

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính chìm trong sắc đỏ. Toàn bộ 30 mã bluechips đều ghi nhận mức giảm điểm trong phiên. VPB và HPG trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -5,71 điểm và -4,68 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 56,88 điểm (-5,12%) xuống 1.054,06 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 413,68 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 9.156 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 22 liên tiếp với 814,79 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như SSI (+151 tỷ đồng), VHM (+134 tỷ đồng), NLG (+55 tỷ đồng), VIC (+50 tỷ đồng), KBC (+47 tỷ đồng).

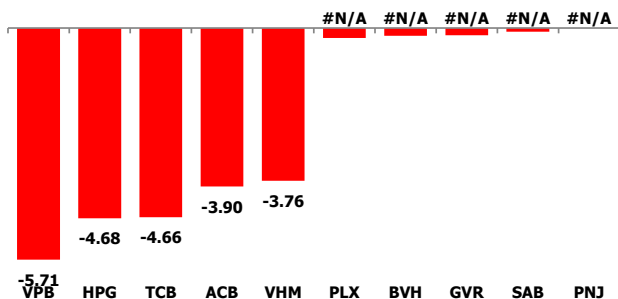
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, HPG và TCB là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, VPB gây ảnh hưởng -5,71 điểm tới 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	16,900	-6.89	10.06%	613.004	-5.71	5.64	1.20
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	76,000	-2.94	3.82%	119.657	-2.24	15.83	4.19
VNM	Food Products	82,500	-2.94	3.15%	117.006	-2.19	21.84	5.54
MSN	Food Products	102,000	-2.86	3.84%	114.193	-2.01	15.13	5.66
ACB	Banks	22,300	-5.51	6.50%	119.449	-3.90	5.69	1.35
VIC	Real Estate Management & Development	66,600	-2.20	5.38%	120.619	-1.50	232.76	2.24
TCB	Banks	27,050	-6.72	7.41%	402.052	-4.66	4.48	0.87
VHM	Real Estate Management & Development	55,000	-5.66	7.37%	239.303	-3.76	7.62	1.76
HPG	Metals & Mining	18,600	-7.00	7.26%	1204.335	-4.68	6.99	1.10
MWG	Specialty Retail	44,350	-6.83	6.43%	187.831	-3.73	12.66	2.79
MBB	Banks	17,700	-6.84	7.63%	404.881	-3.39	4.57	1.11
VCB	Banks	80,000	-5.88	6.50%	109.013	-2.72	14.33	2.95
STB	Banks	20,750	-6.95	9.16%	1055.673	-3.06	9.43	1.06
HDB	Banks	16,400	-3.24	6.40%	93.028	-1.01	5.46	1.17
VJC	Airlines	106,000	-0.84	2.09%	72.692	-0.25	928.42	3.28
VRE	Real Estate Management & Development	29,350	-6.97	5.45%	86.733	-2.09	32.29	2.05
VIB	#N/A	20,400	-6.85	7.84%	238.085	#N/A	5.12	1.41
SSI	Capital Markets	19,550	-6.01	7.16%	839.323	-1.36	8.68	1.32
CTG	Banks	27,000	-5.59	6.52%	211.557	-1.21	8.34	1.23
TPB	Banks	21,600	-6.70	7.18%	257.745	-1.41	5.64	1.12
NVL	Real Estate Management & Development	20,600	-7.00	2.91%	1082.16	-1.26	14.07	1.08
KDH	Real Estate Management & Development	29,550	-4.98	4.74%	99.972	-0.76	16.55	1.85
SAB	Food Products	178,500	-0.67	1.18%	44.82	-0.09	21.18	4.70
GAS	Gas Utilities	109,500	-3.27	4.13%	54.833	-0.37	15.71	3.70
BID	Banks	39,100	-5.21	5.12%	106.29	-0.46	12.22	2.05
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	10,900	-5.22	5.96%	138.94	-0.29	21.86	0.86
PDR	Capital Markets	15,500	-6.91	10.00%	697.281	-0.32	4.79	1.24
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	30,200	-5.77	6.33%	33.87	-0.25	40.94	1.65
BVH	Beverages	48,000	-4.95	4.58%	44.844	-0.19	20.35	1.60
GVR	Real Estate Management & Development	14,550	-6.73	6.53%	57.198	-0.18	13.70	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.