

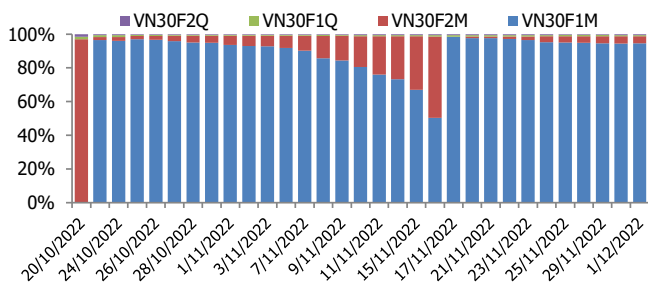
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	14	1029.00	52,015
VN30F2301	19/1/2023	49	1028.00	2,377
VN30F2303	16/3/2023	105	1021.00	342
VN30F2306	15/6/2023	196	1020.00	286

TỶ TRỌNG VỊ THỂ MỞ GIỮA CÁC KỲ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	%Chg	P/E	YTD
VNIndex	1,036.28	(1.16)	10.86	(30.84)
Dow Jones	34,395.01	(0.56)	19.80	(5.35)
S&P500	4,076.57	(0.09)	19.71	(14.47)
Nikkei 225	27,771.33	(1.61)	18.80	(3.54)
Shanghai	3,165.47	0.45	14.18	(13.03)
DAX	14,490.30	0.65	13.21	(8.78)
Vàng	1,798.26	(0.27)		(1.69)
Dầu WTI	81.21	(0.01)		7.98

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Úc - Doanh số bán lẻ	28/11	0.6%	-0.2%
Mỹ - Niềm tin tiêu dùng của CB	29/11	102.2	100.2
Mỹ - Dự trữ dầu thô	30/11	-3.691M	-12.580M
Mỹ - PMI của ISM	1/12	50.2	
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp	2/12	3.7%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

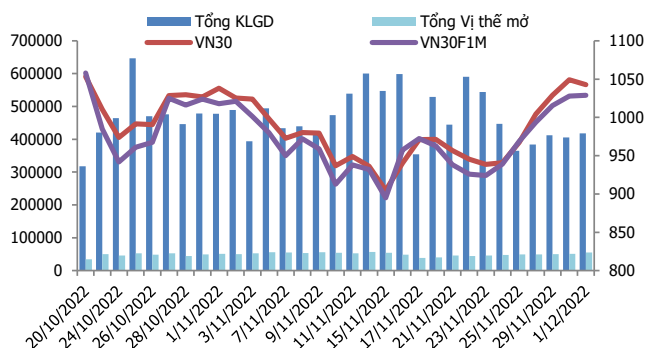
- Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 1,1 đến 3 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 6,57 điểm. Basis của các HĐTL phiên này cải thiện lên mức từ -22,64 đến -13,64 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư vẫn được duy trì ở trạng thái tích cực trước một phiên biến động mạnh. Tổng thanh khoản thị trường phiên này tăng 2,95% so với phiên liền trước, đạt 417.883 hợp đồng được khớp lệnh. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 12 với 1.018 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 15.296 hợp đồng.
- Thị trường cơ sở không thể duy trì được sắc xanh sang phiên thứ 6 liên tiếp do gặp áp lực chốt lời mạnh tới từ nhóm cổ phiếu bluechips. Thanh khoản khớp lệnh trên sàn HOSE hôm nay lên cao nhất 11 tháng với giá trị khớp lệnh đạt gần 20.314 tỷ đồng so với mức 14.346 tỷ đồng trong phiên liền trước. Sau 3 tuần tăng liên tiếp kể từ mức 873 điểm, nhiều cổ phiếu mang lại lợi nhuận 50-150% nên thị trường gặp các nhịp chốt lời là điều dễ hiểu, điều cần chú ý là dòng tiền đang tìm cơ hội ở nhóm cổ phiếu nào tiếp theo.
- Dao động trong biên rộng là kịch bản được tính đến, vì vậy cơ hội đang phân đều cho hai bên. Theo đó, chiến lược “mua thấp, bán cao” sẽ phù hợp. Trong kịch bản chỉ số dao động rộng, nhà đầu tư có thể cân nhắc mở vị thế mua tại hỗ trợ 1016-1020 điểm, với mục tiêu giá tiến lên sát 1040-1050 điểm. Trường hợp giá thủng nền 1016 điểm sẽ là điều kiện để bên bán giá tăng sức ép.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm vào ngày thứ Năm (01/12), xoá sạch đà tăng trước đó khi nhà đầu tư chờ đợi dữ liệu việc làm công bố vào ngày thứ Sáu (02/12) có thể xác định tốc độ thắt chặt lãi suất trong tương lai của Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed). Đóng cửa, chỉ số Dow Jones giảm 193 điểm (tương đương 0,6%), sau khi tăng 737 điểm vào ngày thứ Tư.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

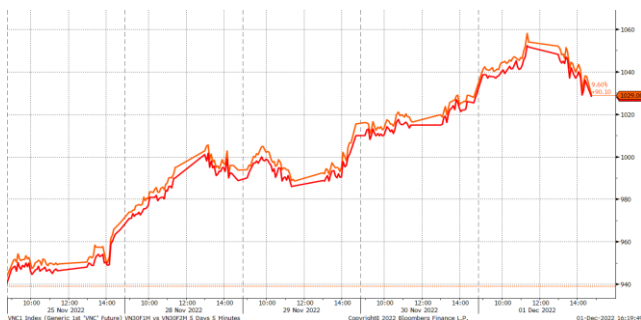
Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1016-1020 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1007 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1040-1050 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1032-1035 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.



DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HỢTTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1029.0	17.00	412,958	2.3	52,015	
VN30F2301	1028.0	37.00	1,038	-29.91	2,377	
VN30F2303	1021.0	13.00	2,233	230.8	342	
VN30F2306	1020.0	4.00	1,654	2076.32	286	
Tổng			417,883	2.9	55,020	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HỢTTL

- Thị trường phái sinh vẫn giữ vững chỉ số trên mốc tham chiếu. Đóng cửa, cả 4 HỢTTL tăng từ 1,1 đến 3 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 6,57 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này tăng 2,95% so với phiên liền trước, đạt 417.883 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HỢTTL tháng 12 với 412.958 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HỢTTL tháng 12 với 1.018 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 15.296 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.043,16 điểm (cao hơn 14,16 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.044,45 điểm (+16,45 điểm), VN30F2303 là 1.046,52 điểm (+25,52 điểm) và VN30F2306 là 1.049,9 điểm (+29,9 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	BUY	BUY
Hỗ trợ	1016-1020	1007-1016	975-1000
Kháng cự	1040-1050	1047-1060	1067-1080

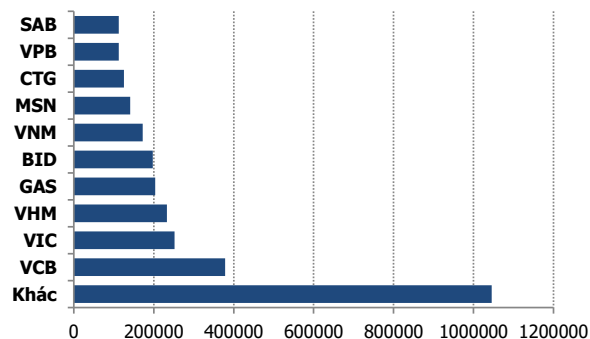
ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

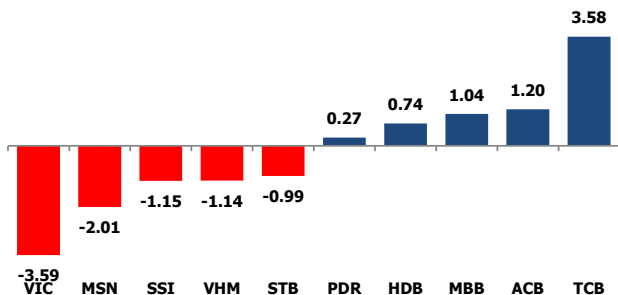


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1036.28	1042.64
Thay đổi	-12.14	-6.57
%Chg	-1.16	-0.63
YTD	-30.84	-32.11
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,136.03	2,973.63
P/E	10.86	8.94
P/B	1.66	1.65

TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính không còn duy trì được sắc xanh. Số mã giảm điểm (19) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (9) và 2 mã đứng tham chiếu. VIC và MSN trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -3,59 điểm và -2,01 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 6,57 điểm (-0,63%) xuống 1.042,64 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 447,57 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 10.391 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 19 liên tiếp với 1.111,14 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như VHM (+211 tỷ đồng), STB (+147 tỷ đồng), MSN (+106 tỷ đồng), VIC (+102 tỷ đồng), HPG (+85 tỷ đồng).

NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VIC, MSN và SSI là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, VIC gây ảnh hưởng -3,59 điểm tới chỉ số VN30.

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VIC

Phân tích kỹ thuật VIC



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	16,800	0.00	4.82%	527.62	0.00	5.61	1.19
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	74,700	0.13	2.29%	133.191	0.10	15.55	4.12
VNM	Food Products	82,400	-0.48	1.59%	181.956	-0.35	21.81	5.53
ACB	Banks	22,500	1.81	3.86%	153.199	1.20	5.74	1.36
MSN	Food Products	99,000	-2.94	3.03%	154.467	-2.01	14.68	5.50
VIC	Real Estate Management & Development	66,000	-5.17	5.45%	217.784	-3.59	230.66	2.22
TCB	Banks	27,400	5.79	5.52%	450.678	3.58	4.54	0.89
VHM	Real Estate Management & Development	53,500	-1.83	5.05%	323.207	-1.14	7.41	1.72
HPG	Metals & Mining	18,200	-1.09	9.17%	1274.086	-0.67	6.84	1.08
MWG	Specialty Retail	44,050	-0.11	6.67%	259.505	-0.06	12.57	2.77
MBB	Banks	17,800	2.30	5.44%	498.325	1.04	4.59	1.11
VCB	Banks	80,000	-1.23	2.78%	94.422	-0.54	14.33	2.95
STB	Banks	19,500	-2.50	8.21%	800.01	-0.99	8.86	1.00
HDB	Banks	15,950	2.57	3.19%	50.58	0.74	5.31	1.14
VJC	Airlines	#####	0.19	3.20%	76.425	0.06	903.89	3.19
VRE	Real Estate Management & Development	30,000	-1.80	4.23%	84.558	-0.52	33.00	2.09
VIB	#N/A	20,000	-1.23	5.01%	205.336	#N/A	5.02	1.38
SSI	Capital Markets	18,200	-5.45	7.97%	708.038	-1.15	8.08	1.23
TPB	Banks	21,800	-0.91	5.32%	335.575	-0.18	5.69	1.13
CTG	Banks	26,150	-4.04	6.54%	292.197	-0.83	8.07	1.19
NVL	Real Estate Management & Development	23,350	0.00	13.41%	1831.279	0.00	15.94	1.22
KDH	Real Estate Management & Development	27,200	-0.73	11.83%	176.74	-0.10	15.23	1.71
SAB	Food Products	#####	-2.56	3.14%	66.704	-0.34	20.81	4.61
GAS	Gas Utilities	#####	-3.36	6.67%	56.132	-0.37	15.28	3.60
BID	Banks	39,000	-5.11	6.41%	78.509	-0.44	12.18	2.05
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,200	-3.86	6.25%	145.313	-0.22	22.46	0.88
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31,000	5.08	3.33%	49.033	0.20	42.03	1.69
PDR	Capital Markets	14,600	6.96	3.91%	612.54	0.27	4.51	1.16
BVH	Beverages	47,800	-1.34	2.73%	52.535	-0.05	20.26	1.59
GVR	Real Estate Management & Development	14,800	4.23	5.94%	62.317	0.10	13.93	1.17

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.