

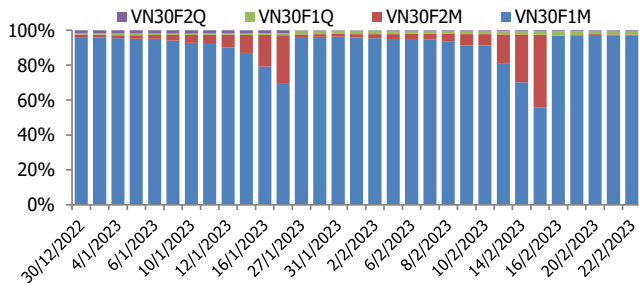
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	22	1043.80	49,490
VN30F2304	20/4/2023	57	1040.60	279
VN30F2306	15/6/2023	113	1042.90	998
VN30F2309	21/9/2023	211	1042.40	229

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	1,054.28	(2.58)	13.68	4.69
Dow Jones	33,045.09	(0.26)	19.47	(0.31)
S&P500	3,991.05	(0.16)	19.05	3.95
Nikkei 225	27,104.32	(1.34)	22.25	3.87
Shanghai	3,296.21	0.15	14.30	6.70
DAX	15,399.89	0.01	12.45	10.60
Vàng	1,827.78	0.13		0.21
Dầu WTI	74.13	0.24		(7.64)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Trung Quốc - Lãi suất cho vay PBoC	20/2	3.65%	3.65%
Mỹ - Doanh số bán nhà hiện tại (T1)	21/2	4,03M	4,00M
Đức - CPI (năm/năm) (Tháng 2)	22/2	8.1%	8.7%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	23/2	194K	
Mỹ - Chỉ số giá PCE lõi (Tháng 1)	24/2	0.3%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

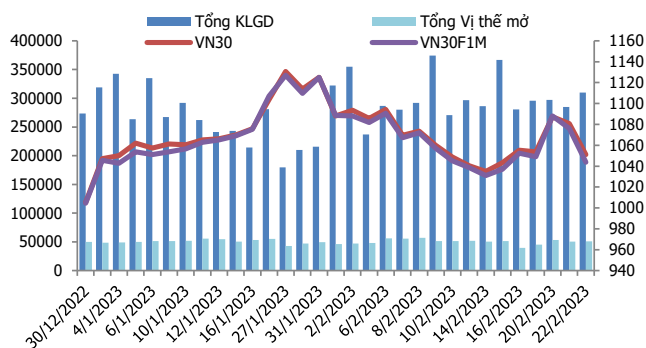
- Thị trường phái sinh hôm nay tiếp tục điều chỉnh khá mạnh. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 24,3 đến 36,8 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 29,82 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục sụt giảm xuống mức âm 4,8 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang duy trì trạng thái tâm lý thận trọng khi thị trường có vẻ như vẫn chưa ra khỏi vùng điều chỉnh.
- Thị trường cơ sở giảm mạnh mang yếu tố cộng hưởng từ tác động của chứng khoán thế giới, ở trong nước khối ngoại cũng có phiên bán ròng mạnh ở nhóm bluechips, bên cạnh đó phiên hôm nay cũng là phiên T+2,5 của lượng hàng ở ngày 20/2 về tài khoản và ở trạng thái lỗ nhiều hơn lãi. Nếu không có nhịp giảm mạnh ở những phút cuối phiên, thị trường đóng cửa dù giảm điểm sau nhịp hồi đầu phiên chiều thì có thể đây vẫn là phiên giảm bình thường.
- Thị trường tiếp tục có 1 phiên điều chỉnh mạnh, cùng với việc basis vẫn ở mức âm là tín hiệu cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái phòng thủ trước các nhịp dao động giảm co của thị trường trong giai đoạn này. Nhà đầu tư cần thận trọng quan sát, có thể cân nhắc mở vị thế mua ở các nhịp điều chỉnh trong phiên với mục tiêu giao dịch ở mức 1030-1040 điểm.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số Dow Jones giảm 84,50 điểm (-0,26%) xuống 33.045,09 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 0,16% còn 3.991,05 điểm. Trong khi, chỉ số Nasdaq Composite tiến 0,13% lên 11.507,07 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1030-1040 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1022 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1071-1085 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1051-1060 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 bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 24,3 đến 36,8 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 11,17% so với phiên liền trước, đạt 309.747 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 3 với 309.129 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 3 với 532 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 5.348 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1051,86 điểm (cao hơn 8,06 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1053,16 điểm (+12,56 điểm), VN30F2306 là 1055,25 điểm (+12,35 điểm) và VN30F2309 là 1058,92 điểm (+16,52 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1043.8	42.00	309,129	8.8	49,490	
VN30F2304	1040.6	83.00	453	-15.33	279	
VN30F2306	1042.9	125.00	72	-8.9	998	
VN30F2309	1042.4	33.00	93	82.35	229	
Tổng			309,747	8.8	50,996	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1030-1040	1010-1022	991-1000
Kháng cự	1051-1060	1071-1085	1104-1120

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

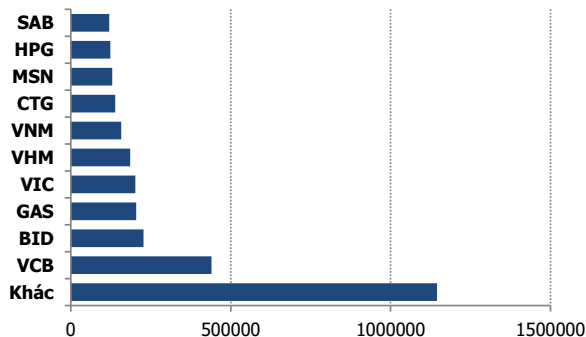


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1054.28	1051.08
Thay đổi	-27.95	-29.82
%Chg	-2.58	-2.76
YTD	4.69	4.57
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,205.44	3,074.82
P/E	13.68	11.05
P/B	1.67	1.62

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính tiếp tục chìm trong sắc đỏ. Toàn bộ 30 mã cổ phiếu ở rổ VN30 đều ghi nhận mức giảm điểm, trong đó VHM và TCB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,95 điểm và -2,15 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 29,82 điểm (-2,76%) xuống 1.051,08 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 210,97 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 4.827 tỷ đồng.
- Khối ngoại bán ròng phiên thứ 6 liên tiếp với 298,48 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như VIC (-58 tỷ đồng), VHM (-54 tỷ đồng), DXG (-39 tỷ đồng), CTG (-38 tỷ đồng), STB (-37 tỷ đồng).

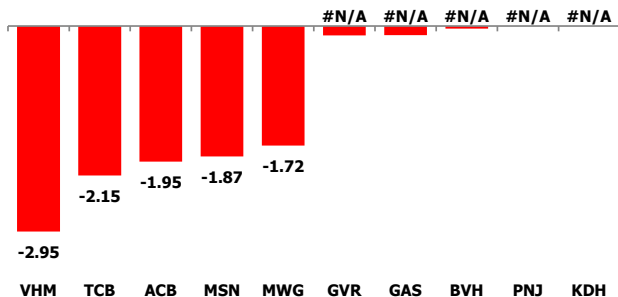
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VHM, TCB và ACB là những nhân tố chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, VHM gây ảnh hưởng -2,95 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VHM

Phân tích kỹ thuật VHM



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	17,450	-1.97	3.15%	299.615	-1.72	6.38	1.24
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	81,800	-1.21	0.86%	61.344	-0.97	17.03	4.51
ACB	Banks	24,850	-2.55	2.82%	66.817	-1.95	6.34	1.51
HPG	Metals & Mining	21,200	-1.85	4.25%	706.301	-1.33	7.96	1.26
VNM	Food Products	75,500	-2.20	1.59%	98.376	-1.48	19.98	5.07
TCB	Banks	27,500	-3.17	2.36%	66.111	-2.15	4.55	0.89
MSN	Food Products	91,000	-2.99	2.53%	71.759	-1.87	13.49	5.05
VIC	Real Estate Management & Development	53,000	-2.39	2.29%	135.12	-1.29	182.85	1.78
VCB	Banks	93,000	-1.27	1.95%	95.589	-0.65	16.65	3.43
MWG	Specialty Retail	43,000	-3.37	3.49%	71.909	-1.72	12.27	2.70
STB	Banks	24,700	-2.56	3.24%	462.678	-1.28	11.23	1.26
VHM	Real Estate Management & Development	42,600	-5.75	5.16%	161.334	-2.95	5.90	1.37
MBB	Banks	18,250	-1.88	1.37%	181.448	-0.91	4.71	1.14
HDB	Banks	18,500	-2.63	2.70%	35.616	-0.92	6.16	1.32
VJC	Airlines	100,800	-1.66	1.59%	38.946	-0.48	882.87	3.12
VRE	Real Estate Management & Development	28,100	-5.07	4.45%	39.19	-1.42	30.91	1.96
TPB	Banks	23,550	-5.04	4.46%	98.057	-1.24	6.15	1.22
VIB	#N/A	21,000	-3.67	3.33%	71.037	#N/A	5.23	1.36
CTG	Banks	28,900	-3.18	2.77%	115.54	-0.71	8.92	1.32
SSI	Capital Markets	19,300	-5.62	5.70%	480.004	-1.25	8.57	1.31
SAB	Food Products	187,000	-1.84	2.14%	15.552	-0.26	22.19	4.92
NVL	Real Estate Management & Development	12,000	-6.61	4.58%	329.726	-0.95	8.19	0.63
GAS	Gas Utilities	107,000	-1.20	2.90%	26.098	-0.13	15.36	3.62
BID	Banks	45,000	-2.70	2.22%	45.208	-0.26	14.06	2.36
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,000	-3.61	4.17%	136.664	-0.27	24.06	0.95
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,200	-5.91	6.28%	34.111	-0.32	51.79	2.08
BVH	Beverages	50,000	-0.99	2.40%	22.535	-0.04	21.19	1.67
BCM	#N/A	84,500	-1.17	2.16%	7.774	#N/A	51.08	5.00
PDR	Capital Markets	11,000	-5.98	5.02%	91.348	-0.22	3.40	0.88
GVR	Real Estate Management & Development	14,550	-5.21	4.81%	35.15	-0.13	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.