

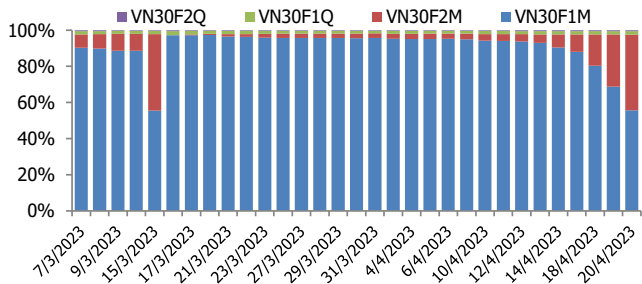
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2304	20/4/2023	1	1055.00	31,298
VN30F2305	18/5/2023	29	1052.50	23,502
VN30F2309	21/9/2023	155	1049.80	1,093
VN30F2312	21/12/2023	246	1046.00	284

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	1,048.98	(0.57)	13.79	4.16
Dow Jones	33,897.01	(0.23)	20.15	2.26
S&P500	4,154.52	(0.01)	19.87	8.20
Nikkei 225	28,572.45	(0.12)	23.52	9.50
Shanghai	3,370.13	(0.68)	13.40	9.09
DAX	15,895.20	0.08	12.59	14.16
Vàng	1,993.55	(0.07)		9.29
Dầu WTI	78.80	(0.45)		(1.82)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Trung Quốc - GDP Quý 1	17/4/2023	3.9%	2.9%
Anh - Thay đổi trợ cấp thất nghiệp	17/4/2023	30.3K	11.2K
Mỹ - Giấy phép xây dựng	18/4/2023	1.339M	1.550M
Anh - Chỉ số giá tiêu dùng (CPI)	19/4/2023	0.30%	0.10%
Trung Quốc - Lãi suất cho vay	20/4/2023	3.65%	3.65%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

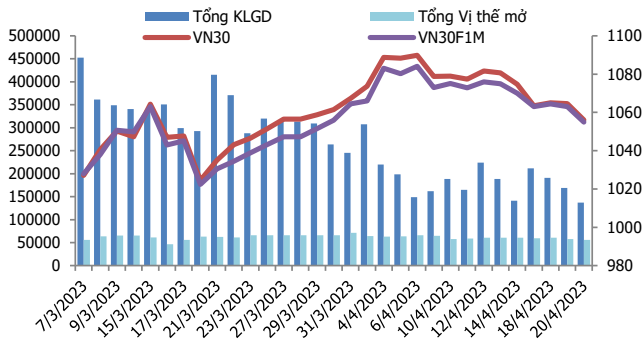
- Áp lực bán mạnh cuối phiên từ nhóm cổ phiếu vốn hóa lớn, 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 7.7 đến 9.5 điểm. Trong đó, VN30F2304 giảm 0.75% xuống mức 1055 điểm, hiện đang thấp hơn 1.14 điểm so với chỉ số cơ sở VN30. Tổng thanh khoản thị trường phiên hôm nay giảm 29.23 % so với phiên liền trước, đạt 125 335 hợp đồng được khớp lệnh trong phiên. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 4 với 4244 hợp đồng.
- Tâm lý thận trọng tiếp tục bao trùm lên thị trường trước phiên đảo hạn hợp đồng phái sinh tháng 4. Nhóm cổ phiếu ngân hàng tiếp tục là nhân tố chính tác động tiêu cực lên chỉ số, ngoài ra còn các nhóm bất động sản, chứng khoán, ... Về kỹ thuật, thị trường vẫn đang ở giai đoạn điều chỉnh, các phiên giảm điểm đi kèm thanh khoản thấp là dấu hiệu tốt để kiểm tra lực cung. Chúng tôi đánh giá nhịp điều chỉnh này lành mạnh và thị trường có xác suất cao sẽ tạo đáy ở vùng 1037 - 1041 điểm.
- Thị trường phái sinh giằng co trong biên độ hẹp, lực bán những phút cuối phiên khiến chỉ số giảm 8 điểm. Nhà đầu tư có thể canh mở vị thế MUA khi xuất hiện các nhịp rung lắc trong phiên hôm nay, đồng thời các thông tin kinh tế quan trọng trong tuần này cũng là điều đáng chú ý.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết thúc phiên giao dịch ngày thứ Tư, chỉ số S&P 500 hạ 0.01% xuống 4,154.52 điểm, còn chỉ số Nasdaq Composite nhích 0.03% lên 12,157.23 điểm. Chỉ số Dow Jones mất 79.62 điểm (tương đương 0.23%) còn 33,897.01 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh MUA quanh khu vực 1047-1051 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1045 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1057-1059 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1054-1055 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 cuối phiên từ nhóm cổ phiếu vốn hóa lớn, 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 7.7 đến 9.5 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên hôm nay giảm 29.23 % so với phiên liền trước, đạt 125 335 hợp đồng được khớp lệnh trong phiên. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 4 với 4244 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2304 là 1080.96 điểm cao hơn 5.96 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2305 là 1082.03 điểm (+10.63 điểm), VN30F2306 là 1086.86 điểm (+16.96 điểm) và VN30F2309 là 1090.37 điểm (+24.37 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI
VN30F2304	1055.0	46.00	125,340	-21.5	31,298
VN30F2305	1052.5	140.00	11,609	26.35	23,502
VN30F2309	1049.8	130.00	32	23.1	1,093
VN30F2312	1046.0	24.00	41	-4.65	284
Tổng			137,022	-18.9	56,177

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	BUY
Hỗ trợ	1047 - 1049	1047-1049	1047-1051
Kháng cự	1057-1059	1057-1059	1057-1059

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

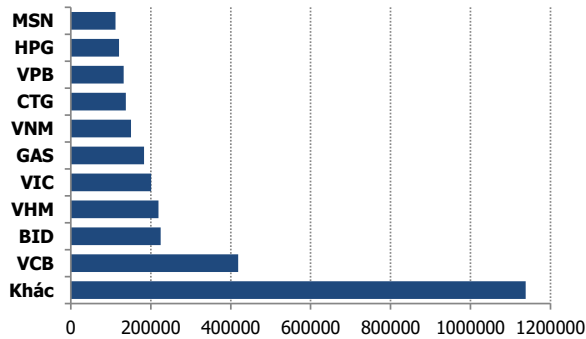


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1048.98	1056.14
Thay đổi	-6.04	-8.41
%Chg	-0.57	-0.79
YTD	4.16	5.07
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,184.81	3,038.19
P/E	13.79	10.93
P/B	1.66	1.63

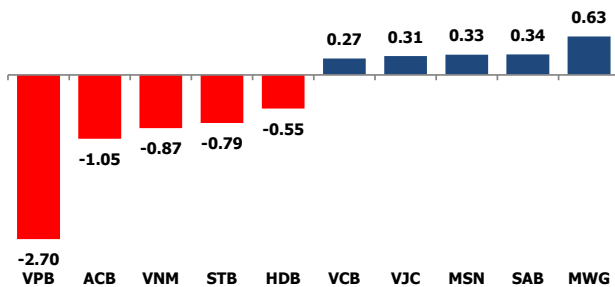
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố chính khiến thị trường giảm điểm. Số mã giảm điểm (25) nhiều hơn số mã giảm điểm (5) và 0 mã đứng tham chiếu, trong đó VNM và VHM trở thành hai trụ ảnh hưởng tích cực nhất tới đà tăng của chỉ số VN30 với mức đóng góp lần lượt là -2.64 điểm và -1.03 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 8.41 điểm (-0.79%) xuống 1056.14 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 151.937 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3465.24 tỷ đồng.
- Khối ngoại quay trở lại bán ròng với giá trị 457.39 tỷ đồng trên HOSE. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như MSB (374.48 tỷ đồng), BMP (43.79 tỷ đồng), STB (35.13 tỷ đồng), VNM (20.32 tỷ đồng), CTG (17.06 tỷ đồng).

TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX

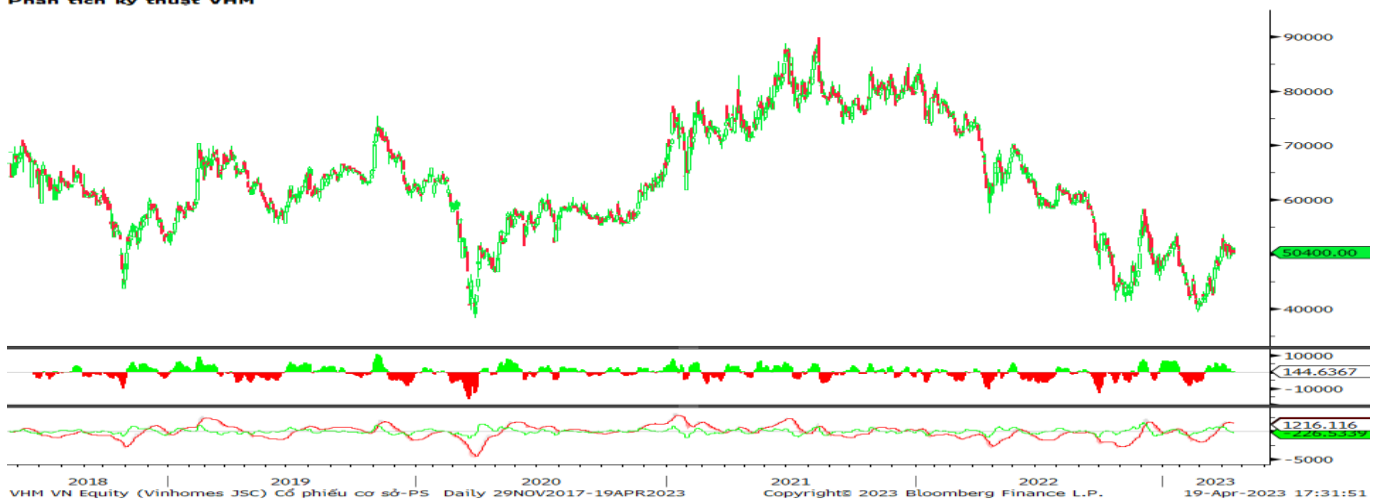


NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, ACB và VNM là những nhân tố chính khiến chỉ số VN30 kết phiên giảm điểm. Trong đó, VPB đóng góp -2.64 điểm cho chỉ số VN30.

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	19,700	-2.72	4.31%	369.144	-2.70	7.24	1.37
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	79,300	-0.13	0.63%	33.346	-0.10	16.36	4.13
ACB	Banks	24,400	-1.41	1.64%	112.827	-1.05	6.02	1.41
HPG	Metals & Mining	20,800	-0.72	1.20%	219.247	-0.50	14.26	1.26
TCB	Banks	29,000	-0.51	1.38%	76.164	-0.36	5.06	0.91
VNM	Food Products	72,000	-1.37	1.53%	58.981	-0.87	19.82	5.04
VHM	Real Estate Management & Development	50,400	-0.79	2.40%	49.214	-0.45	7.61	1.51
MSN	Food Products	78,700	0.64	2.31%	98.276	0.33	31.29	4.28
VIC	Real Estate Management & Development	52,600	-0.38	0.76%	91.694	-0.20	22.22	1.78
STB	Banks	25,500	-1.54	1.96%	364.33	-0.79	9.54	1.24
VCB	Banks	88,500	0.57	0.80%	36.838	0.27	14.01	3.09
MBB	Banks	18,100	-0.28	1.10%	75.625	-0.13	4.69	1.08
MWG	Specialty Retail	40,500	1.38	3.25%	120.133	0.63	14.31	2.48
HDB	Banks	19,050	-1.55	1.57%	23.1	-0.55	6.17	1.30
VJC	Airlines	100,100	1.11	1.52%	14.144	0.31	#N/A N/	3.64
VRE	Real Estate Management & Development	28,300	-0.70	3.78%	69.772	-0.19	23.16	1.93
SSI	Capital Markets	21,300	-2.07	2.82%	293.608	-0.49	14.63	1.43
VIB	#N/A	20,450	-0.97	2.21%	65.547	#N/A	5.09	1.32
TPB	Banks	22,350	-1.97	2.91%	42.03	-0.45	5.65	1.10
CTG	Banks	28,700	-1.37	1.75%	46.486	-0.30	8.22	1.28
NVL	Real Estate Management & Development	14,550	-2.02	5.50%	507.86	-0.34	13.06	0.76
SAB	Food Products	170,400	2.77	2.89%	55.745	0.34	21.41	4.72
GAS	Gas Utilities	95,600	-1.24	2.84%	32.204	-0.12	12.47	3.06
BID	Banks	44,400	-0.45	1.24%	20.065	-0.04	12.37	2.26
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	13,200	-2.22	3.44%	75.313	-0.18	14.99	1.01
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	36,400	-1.09	1.51%	11.863	-0.05	31.44	1.89
PDR	Capital Markets	13,700	-1.44	5.19%	143.366	-0.06	8.00	1.13
BVH	Beverages	46,150	-1.81	2.06%	17.038	-0.07	22.08	1.68
BCM	#N/A	79,200	-0.38	1.15%	3.081	#N/A	58.39	4.84
GVR	Real Estate Management & Development	15,050	-2.90	4.33%	25.852	-0.08	15.67	1.23

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.