

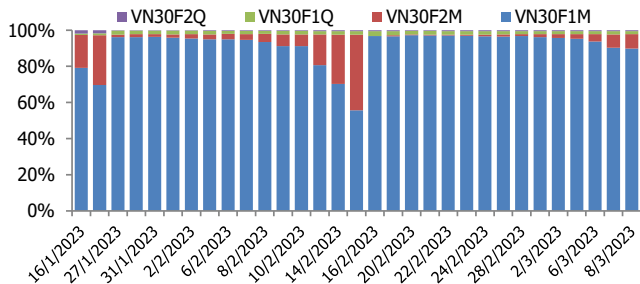
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	8	1038.00	57,199
VN30F2304	20/4/2023	43	1033.30	5,091
VN30F2306	15/6/2023	99	1029.00	1,076
VN30F2309	21/9/2023	197	1027.70	287

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	1,049.18	1.09	13.64	4.18
Dow Jones	32,798.40	(0.18)	19.50	(1.05)
S&P500	3,992.01	0.14	19.11	3.97
Nikkei 225	28,618.66	0.61	23.34	9.67
Shanghai	3,283.25	(0.06)	14.34	6.28
DAX	15,631.87	0.46	11.86	12.27
Vàng	1,814.92	0.06		(0.50)
Dầu WTI	76.58	(0.10)		(4.59)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Anh - PMI xây dựng (Tháng 2)	6/3	48.4	54.6
Úc - Quyết định lãi suất (Tháng 3)	7/3	3.35%	3.60%
Mỹ - Cơ hội việc làm của JOLTs (T1)	8/3	11,234M	10,824M
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	9/3	190K	
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (Tháng 2)	10/3	3.4%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

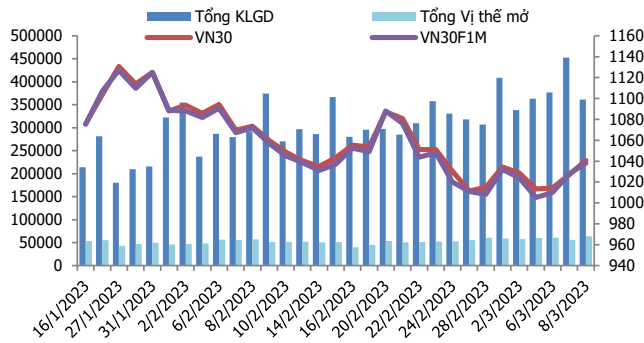
- Thị trường phái sinh nói rộng đã hồi phục với cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 3,8 đến 10,1 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 13,43 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này sụt giảm xuống mức âm 2,59 điểm, cho thấy nhà đầu tư có vẻ vẫn đang ở trạng thái tâm lý thận trọng khi thị trường chưa thực sự bật tăng mạnh mẽ.
- Đà phục hồi của thị trường cơ sở có khả năng còn tiếp diễn đến ngưỡng 1.053 điểm, dòng tiền bắt đáy đang mạnh dần nhờ tín hiệu mua ròng trở lại từ khối ngoại đang là yếu tố dẫn dắt thị trường bất chấp chứng khoán thế giới đang chịu ảnh hưởng từ Fed. Thị trường đã có thời gian tích lũy và bật tăng nên ở nhiều nhóm cổ phiếu đang có mức lợi suất tốt hơn so với chỉ số chung, tạo vùng đệm giảm áp lực từ lượng cung đi trong các nhịp rung lắc sắp tới.
- Thị trường phái sinh duy trì sắc xanh nhờ lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên. Thị trường tiếp đà hồi phục, tuy nhiên áp lực bán mạnh vẫn xuất hiện trong phần lớn thời gian phiên giao dịch hôm nay, cùng với việc basis chưa ổn định và tác động từ thị trường quốc tế là các dấu hiệu cho thấy nhà đầu tư vẫn cần thận trọng quan sát.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chỉ số Dow Jones giảm nhẹ khi Chủ tịch Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed) Jerome Powell gợi ý về khả năng lãi suất cao hơn trong thời gian dài hơn. Kết phiên, chỉ số Dow Jones lùi 58,06 điểm (-0,18%) xuống 32.798,40 điểm. Trong khi, chỉ số S&P 500 nhích 0,14% lên 3.992,01 điểm và chỉ số Nasdaq Composite cộng 0,4% lên 11.576,00 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

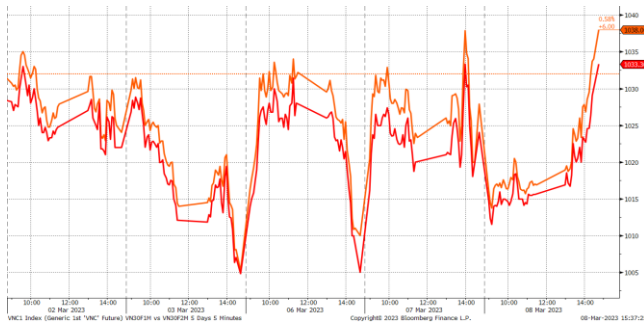
Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1020-1034 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1000 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1062-1072 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1045-1050 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.



DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1038.0	10.00	358,994	-19.9	57,199	
VN30F2304	1033.3	1.00	2,428	-35.49	5,091	
VN30F2306	1029.0	14.00	136	17.2	1,076	
VN30F2309	1027.7	1.00	85	-27.35	287	
Tổng			361,643	-20.0	63,653	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HĐTL

- Lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã giúp cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 3,8 đến 10,1 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 22,12% so với phiên liền trước, đạt 352.226 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 3 với 448.293 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 3 với 6 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 5.987 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1040,88 điểm (cao hơn 2,88 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1042,17 điểm (+8,87 điểm), VN30F2306 là 1044,24 điểm (+15,24 điểm) và VN30F2309 là 1047,87 điểm (+20,17 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	SELL
Hỗ trợ	1020-1034	1000-1004	980-991
Kháng cự	1045-1050	1062-1072	1082-1090

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

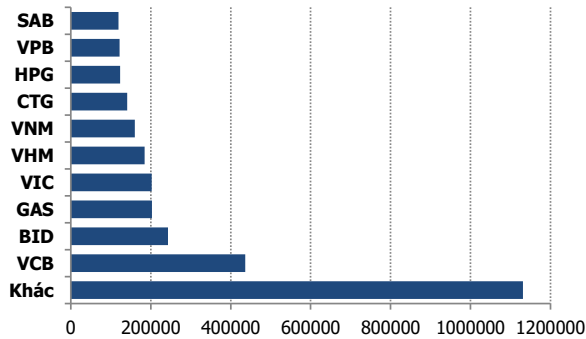


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1049.18	1040.59
Thay đổi	11.34	13.43
%Chg	1.09	1.31
YTD	4.18	3.52
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,185.74	3,065.41
P/E	13.64	10.93
P/B	1.66	1.61

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính tiếp tục nới rộng đà hồi phục. Số mã tăng điểm (27) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (3), trong đó VPB và ACB trở thành hai trụ đóng góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +3,68 điểm và +1,5 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 13,43 điểm (+1,31%) lên 1.040,59 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 156,69 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.601 tỷ đồng.
- Khối ngoại tiếp tục mua ròng với 258,48 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+44 tỷ đồng), VND (+37 tỷ đồng), SSI (+32 tỷ đồng), FRT (+27 tỷ đồng), HSG (+26 tỷ đồng).

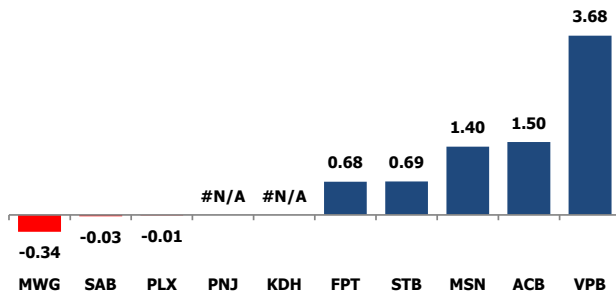
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, ACB và MSN là những nhân tố chính duy trì đà hồi phục của chỉ số VN30. Trong đó, VPB đóng góp +3,68 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	4.31	5.52%	485.499	3.68	6.63	1.29
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	79,500	0.89	1.27%	40.246	0.68	16.55	4.38
ACB	Banks	25,000	2.04	3.09%	68.538	1.50	6.37	1.51
HPG	Metals & Mining	21,200	0.47	1.92%	339.68	0.33	7.96	1.26
VNM	Food Products	76,500	0.92	2.00%	94.342	0.61	21.06	5.36
TCB	Banks	27,300	0.74	2.24%	52.528	0.48	4.52	0.88
MSN	Food Products	80,400	2.68	4.11%	119.393	1.40	31.97	4.38
VIC	Real Estate Management & Development	53,000	0.57	2.11%	43.903	0.30	182.85	1.78
VCB	Banks	92,200	0.33	1.65%	79.815	0.16	16.51	3.40
STB	Banks	25,350	1.40	2.01%	344.703	0.69	11.52	1.29
VHM	Real Estate Management & Development	42,350	0.12	2.54%	81.542	0.06	5.86	1.36
MBB	Banks	17,600	1.15	2.33%	128.754	0.52	4.54	1.10
MWG	Specialty Retail	39,400	-0.76	2.33%	78.994	-0.34	11.25	2.48
HDB	Banks	18,600	0.54	3.33%	37.599	0.18	6.19	1.33
VJC	Airlines	98,300	1.24	1.85%	11.959	0.34	860.97	3.04
VRE	Real Estate Management & Development	27,250	2.44	3.22%	58.877	0.62	22.31	1.85
TPB	Banks	23,950	1.91	3.00%	128.595	0.45	6.26	1.24
VIB	#N/A	20,700	0.49	1.97%	55.239	#N/A	5.16	1.34
CTG	Banks	29,400	1.38	3.69%	99.09	0.30	9.08	1.34
SSI	Capital Markets	19,800	2.06	4.21%	285.037	0.44	8.79	1.34
SAB	Food Products	186,500	-0.21	1.14%	18.03	-0.03	22.13	4.91
NVL	Real Estate Management & Development	11,050	1.84	5.69%	157.444	0.22	7.55	0.58
GAS	Gas Utilities	105,900	1.34	2.12%	15.501	0.14	15.20	3.58
BID	Banks	48,000	2.35	4.58%	57.966	0.23	15.00	2.52
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,750	1.59	2.81%	97.716	0.12	25.57	1.01
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,900	-0.26	1.81%	16.076	-0.01	52.74	2.12
BVH	Beverages	49,000	1.45	1.77%	7.555	0.05	20.77	1.63
PDR	Capital Markets	11,850	4.87	7.73%	76.046	0.17	3.66	0.94
BCM	#N/A	84,500	0.60	2.30%	10.066	#N/A	51.08	5.00
GVR	Real Estate Management & Development	14,500	0.69	2.47%	22.155	0.02	13.65	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.