

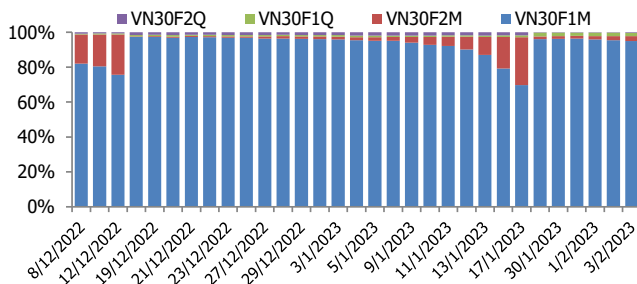
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	13	1081.90	45,554
VN30F2303	16/3/2023	41	1082.50	1,281
VN30F2306	15/6/2023	132	1067.00	926
VN30F2309	21/9/2023	230	1064.50	181

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	1,077.15	(0.04)	13.94	6.96
Dow Jones	33,926.01	(0.38)	20.24	2.35
S&P500	4,136.48	(1.04)	19.60	7.73
Nikkei 225	27,509.46	0.39	21.70	5.42
Shanghai	3,263.41	(0.68)	14.26	5.64
DAX	15,476.43	(0.21)	12.64	11.15
Vàng	1,864.97	(2.50)		2.25
Dầu WTI	73.39	(3.28)		(8.56)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Đức - GDP (Quý 4)	30/1	0.5%	-0.2%
Mỹ - Niềm tin tiêu dùng của CB (T1)	31/1	109.0	107.1
Mỹ - Quyết định lãi suất	1/2	4.50%	4.75%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	2/2	186K	183K
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (T1)	3/2	3.5%	3.4%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

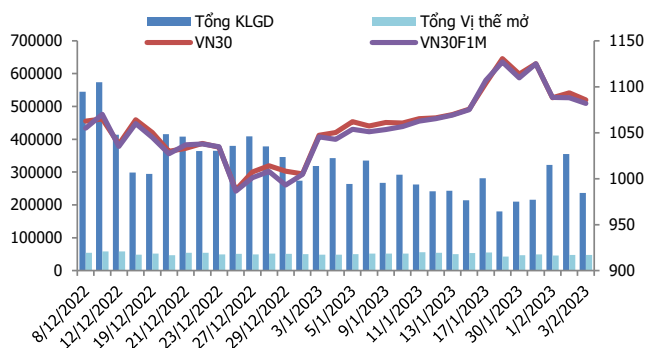
- Thị trường phái sinh hôm nay đánh mất sắc xanh khi gặp áp lực bán mạnh về cuối phiên. Đóng cửa, 3/4 HĐTL giảm từ 3 đến 6,1 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 7,78 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này cải thiện đôi chút, tuy nhiên vẫn đang ở mức âm 3,8 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang duy trì trạng thái tâm lý thận trọng trước các nhịp tăng giảm đan xen của thị trường.
- Thị trường cơ sở đi ngang nhưng số cổ phiếu thiệt hại tiếp tục tăng lên, thanh khoản giảm dần về cuối tuần cho thấy nhà đầu tư rất thận trọng không chỉ vì đây là phiên cơ cấu danh mục của các quỹ ETF mà còn do đây là phiên T+2,5 của phiên có lượng hàng nhiều nhất trong vòng 2 tháng vừa qua về tài khoản và nhiều cổ phiếu ở trạng thái lỗ.
- Thị trường phái sinh tiếp tục ghi nhận 1 phiên giao dịch giằng co và giảm điểm mạnh về cuối phiên. Các nhịp tăng giảm đan xen trong các phiên giao dịch gần đây, cùng với mức basis ở mức âm, cho thấy thị trường vẫn đang trong giai đoạn điều chỉnh sau khi đã tăng điểm liên tiếp, do vậy nhà đầu tư cần thận trọng quan sát.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số S&P 500 lùi 1,04% xuống 4.136,48 điểm, chỉ số Nasdaq Composite rớt 1,59% xuống 12.006,95 điểm, trong khi chỉ số Dow Jones mất 127,93 điểm (-0,38%) còn 33.926,01 điểm – ngay cả khi cổ phiếu Apple tăng.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1069-1075 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1065 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1099-1105 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1091-1094 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 về cuối phiên hôm nay đã xóa đi đà tăng điểm trước đó và khiến 3/4 HĐTL đóng cửa giảm từ 3 đến 6,1 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 33,26% so với phiên liền trước, đạt 236.903 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 236.022 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 2 với 398 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 14.488 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1086,16 điểm (cao hơn 4,26 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1087,24 điểm (+4,74 điểm), VN30F2306 là 1090,74 điểm (+23,74 điểm) và VN30F2309 là 1094,53 điểm (+30,03 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1081.9	45.00	236,022	-33.3	45,554	
VN30F2303	1082.5	40.00	702	-40.51	1,281	
VN30F2306	1067.0	60.00	73	9.0	926	
VN30F2309	1064.5	88.00	106	-5.36	181	
Tổng			236,903	-33.3	47,942	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1069-1075	1054-1058	1030-1043
Kháng cự	1091-1094	1099-1105	1110-1126

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

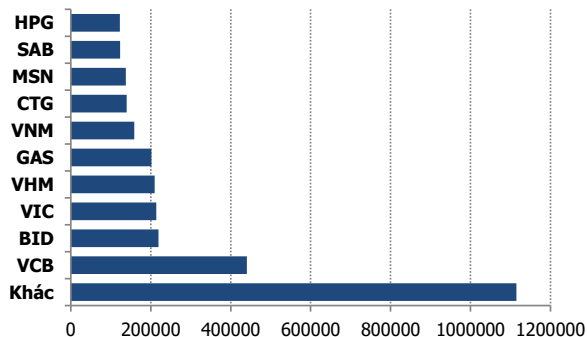


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1077.15	1085.7
Thay đổi	-0.44	-7.78
%Chg	-0.04	-0.71
YTD	6.96	8.01
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,298.86	3,080.49
P/E	13.94	11.41
P/B	1.77	1.68

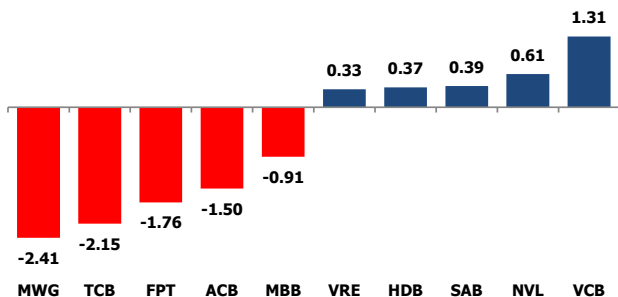
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính chìm trong sắc đỏ. Số mã giảm điểm (16) áp đảo so với số mã tăng điểm (14) và 0 mã đứng tham chiếu, trong đó MWG và TCB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,41 điểm và -2,15 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 7,78 điểm (-0,71%) xuống 1.085,7 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 217,97 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 5.594 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 3 liên tiếp với 568,76 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như STB (+171 tỷ đồng), HPG (+107 tỷ đồng), NVL (+49 tỷ đồng), VCB (+31 tỷ đồng), KBC (+28 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 MWG, TCB và FPT là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 quay đầu giảm điểm về cuối phiên. Trong đó, MWG gây ảnh hưởng -2,41 điểm tới chỉ số VN30.

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT MWG

Phân tích kỹ thuật MWG



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18,250	-0.82	2.77%	366.311	-0.68	6.67	1.30
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,100	-2.20	2.37%	139.208	-1.76	16.68	4.42
ACB	Banks	24,500	-2.00	3.48%	234.843	-1.50	6.25	1.48
HPG	Metals & Mining	21,100	-0.94	2.62%	446.133	-0.67	7.93	1.25
VNM	Food Products	76,000	-0.91	1.58%	141.656	-0.61	20.12	5.10
TCB	Banks	27,100	-3.21	4.06%	177.114	-2.15	4.49	0.88
MSN	Food Products	96,500	-0.21	3.31%	54.043	-0.13	14.31	5.36
VIC	Real Estate Management & Development	56,000	0.36	1.82%	66.499	0.20	193.20	1.89
MWG	Specialty Retail	47,800	-4.21	1.67%	298.06	-2.41	13.64	3.00
VHM	Real Estate Management & Development	48,100	0.42	2.11%	59.777	0.23	6.66	1.54
STB	Banks	26,050	-0.38	4.22%	814.849	-0.20	11.84	1.33
VCB	Banks	93,000	2.65	4.38%	82.069	1.31	16.65	3.43
MBB	Banks	18,600	-1.85	2.69%	188.501	-0.91	4.80	1.16
HDB	Banks	18,550	1.09	4.21%	45.689	0.37	6.17	1.33
VJC	Airlines	109,100	-2.59	3.94%	18.345	-0.82	955.57	3.37
VIB	#N/A	24,300	2.97	3.18%	102.597	#N/A	6.10	1.68
VRE	Real Estate Management & Development	29,200	1.21	2.10%	31.733	0.33	32.12	2.04
CTG	Banks	29,050	-0.51	1.20%	105.589	-0.11	8.97	1.32
TPB	Banks	24,000	0.42	1.91%	141.899	0.09	6.27	1.24
SSI	Capital Markets	19,750	-1.99	3.57%	263.536	-0.44	8.77	1.34
SAB	Food Products	192,800	2.83	3.77%	19.944	0.39	22.88	5.07
KDH	Real Estate Management & Development	26,950	1.32	2.08%	55.693	0.17	15.09	1.69
NVL	Real Estate Management & Development	14,950	5.28	4.55%	296.176	0.61	10.21	0.78
GAS	Gas Utilities	105,200	-1.68	1.71%	27.431	-0.18	15.10	3.55
BID	Banks	43,350	0.46	1.51%	59.734	0.04	13.54	2.28
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,150	1.25	2.95%	78.081	0.07	24.36	0.96
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	37,300	3.04	3.32%	29.608	0.15	50.57	2.03
BVH	Beverages	49,700	-0.50	2.85%	23.387	-0.02	21.07	1.66
PDR	Capital Markets	13,700	-0.36	4.10%	120.481	-0.01	4.23	1.09
GVR	Real Estate Management & Development	15,400	0.98	2.99%	23.769	0.03	14.50	1.22

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.