

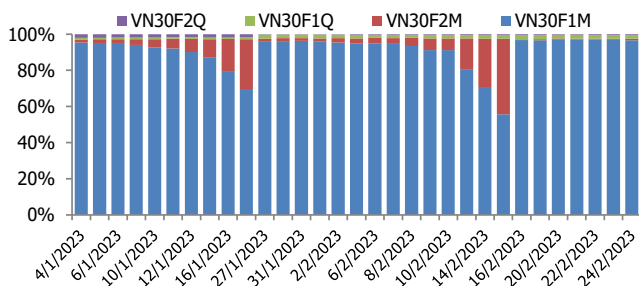
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	18	1020.00	50,988
VN30F2304	20/4/2023	53	1019.90	483
VN30F2306	15/6/2023	109	1030.00	1,011
VN30F2309	21/9/2023	207	1019.50	278

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	1,039.56	(1.34)	13.50	3.22
Dow Jones	32,816.92	(1.02)	19.24	(1.00)
S&P500	3,970.04	(1.05)	19.05	3.40
Nikkei 225	27,394.38	(0.22)	22.41	4.98
Shanghai	3,262.27	(0.15)	14.27	5.60
DAX	15,209.74	(1.72)	12.30	9.24
Vàng	1,813.51	0.14		(0.58)
Dầu WTI	76.31	(0.01)		(4.92)

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	195K	192K
Mỹ - Chỉ số giá PCE lõi (Tháng 1)	24/2	0.4%	0.6%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

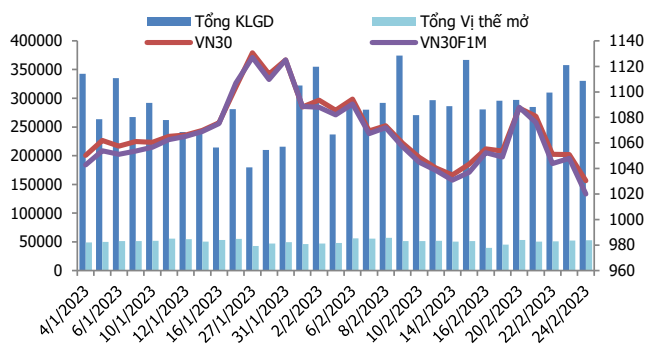
- Thị trường phái sinh hôm nay gặp áp lực bán mạnh tới từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 14,2 đến 28 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 20,53 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này sụt giảm mạnh xuống mức âm 10,42 điểm, cho thấy nhà đầu tư đang chuyển dần sang trạng thái tâm lý bi quan khi thị trường có vẻ như vẫn chưa ra khỏi vùng điều chỉnh.
- Thị trường cơ sở đã khép lại một tuần giảm điểm cùng xu hướng với chứng khoán thế giới. Với 3 tuần giảm liên tiếp, đa phần các thị trường trên thế giới đang trong nhịp điều chỉnh kỹ thuật để kiểm tra lại ngưỡng hỗ trợ kỹ thuật MA50. Sau 4 phiên giảm liên tiếp và vị thế lỗ chiếm đa số, dòng tiền nội đã co lại nhanh chóng, thị trường nhiều khả năng sẽ tìm điểm cân bằng và dao động trong vùng 1.030 – 1.035 điểm trong bối cảnh trong nước không có thông tin hỗ trợ.
- Thị trường phái sinh cũng khép lại một tuần điều chỉnh mạnh, cùng với việc basis giảm sâu (-10,42 điểm) cho thấy nhà đầu tư có vẻ như đang chuyển dần sang trạng thái tâm lý không mấy tích cực trước các nhịp giảm điểm liên tiếp của thị trường. Nhà đầu tư cần thận trọng quan sát, có thể cân nhắc mở vị thế mua ở các nhịp điều chỉnh trong phiên.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm mạnh vào ngày thứ Sáu (24/02), khép lại tuần tồi tệ nhất của năm 2023, sau khi thước đo lạm phát ưa thích của Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed) cho thấy lạm phát tăng mạnh hơn dự báo trong tháng trước. Kết phiên, chỉ số Dow Jones rớt 336,99 điểm (-1,0%) xuống 32.816,92 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 1% còn 3.970,04 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite lùi 1,7% xuống 11.394,94 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1010-1017 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1000 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1048-1053 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1030-1037 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	1020.0	10.00	329,590	-7.6	50,988	
VN30F2304	1019.9	0.00	605	-14.31	483	
VN30F2306	1030.0	0.00	41	-52.9	1,011	
VN30F2309	1019.5	24.00	79	-15.96	278	
Tổng			330,315	-7.6	52,760	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HĐTL

- Áp lực bán lớn từ nhóm cổ phiếu trụ xuất hiện ngay từ đầu phiên và tiếp tục mạnh dần về cuối phiên đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 14,2 đến 28 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 7,62% so với phiên liền trước, đạt 330.315 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 3 với 329.590 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 3 với 1.097 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 2.914 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1031,15 điểm (cao hơn 11,15 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1032,43 điểm (+12,53 điểm), VN30F2306 là 1034,48 điểm (+4,48 điểm) và VN30F2309 là 1038,07 điểm (+18,57 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1010-1017	990-1000	972-980
Kháng cự	1030-1037	1048-1053	1060-1065

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

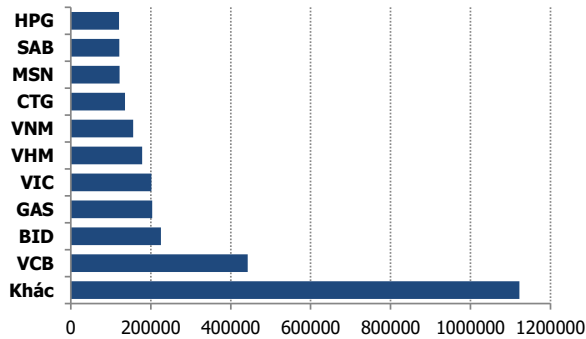


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1039.56	1030.42
Thay đổi	-14.10	-20.53
% Chg	-1.34	-1.95
YTD	3.22	2.51
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,146.70	3,030.85
P/E	13.50	10.83
P/B	1.64	1.59

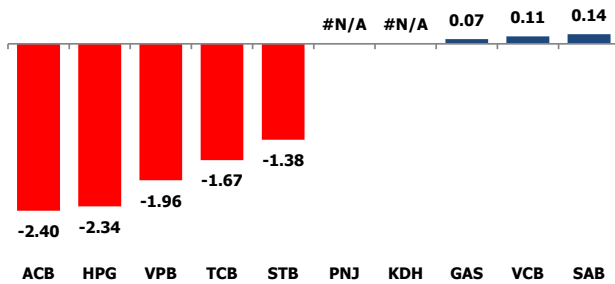
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính tiếp tục chìm trong sắc đỏ. Số mã giảm điểm (26) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (3), trong đó ACB và HPG trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,4 điểm và -2,34 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 20,53 điểm (-1,95%) xuống 1.030,42 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 108,56 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 2.689 tỷ đồng.
- Khối ngoại bán ròng phiên thứ 8 liên tiếp với 182,29 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như VHM (-43 tỷ đồng), VIC (-37 tỷ đồng), DGC (-30 tỷ đồng), DCM (-23 tỷ đồng), VNM (-18 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 ACB, HPG và VPB là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 tiếp tục nằm trong đà giảm điểm. Trong đó, ACB gây ảnh hưởng -2,4 điểm tới chỉ số VN30.

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT ACB

Phân tích kỹ thuật ACB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	17,150	-2.28	2.92%	180.535	-1.96	6.27	1.22
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,800	-0.74	1.12%	45.171	-0.58	16.82	4.46
ACB	Banks	24,600	-3.15	3.05%	55.231	-2.40	6.27	1.49
HPG	Metals & Mining	20,800	-3.26	4.12%	306.893	-2.34	7.81	1.23
VNM	Food Products	74,700	-1.32	2.01%	125.899	-0.87	19.77	5.01
TCB	Banks	27,250	-2.50	2.95%	53.956	-1.67	4.51	0.88
MSN	Food Products	85,900	-1.94	4.59%	61.756	-1.14	12.74	4.77
VIC	Real Estate Management & Development	52,900	-0.19	2.32%	115.796	-0.10	182.51	1.78
VCB	Banks	93,500	0.21	4.44%	58.725	0.11	16.74	3.45
MWG	Specialty Retail	42,100	-2.09	3.25%	68.406	-1.03	12.02	2.64
STB	Banks	24,300	-2.80	3.09%	208.068	-1.38	11.05	1.24
VHM	Real Estate Management & Development	41,000	-2.38	2.69%	124.122	-1.14	5.68	1.32
MBB	Banks	17,700	-2.48	3.11%	179.5	-1.17	4.57	1.11
HDB	Banks	17,500	-3.05	4.00%	27.957	-1.01	5.83	1.25
VJC	Airlines	96,200	-2.04	3.85%	59.1	-0.57	842.58	2.98
VRE	Real Estate Management & Development	26,500	0.00	2.28%	59.612	0.00	29.15	1.85
TPB	Banks	23,500	-2.08	2.98%	55.688	-0.50	6.14	1.21
VIB	#N/A	21,000	-2.33	3.33%	30.67	#N/A	5.23	1.36
CTG	Banks	28,250	-2.59	2.30%	62.446	-0.56	8.72	1.29
SSI	Capital Markets	19,000	-3.55	3.95%	148.678	-0.76	8.43	1.29
SAB	Food Products	189,000	1.02	2.49%	18.567	0.14	22.43	4.97
NVL	Real Estate Management & Development	11,400	-3.39	6.14%	121.18	-0.45	7.78	0.60
GAS	Gas Utilities	106,500	0.66	2.38%	13.49	0.07	15.28	3.60
BID	Banks	44,600	-2.09	2.59%	22.302	-0.20	13.93	2.34
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,000	-1.64	2.92%	52.96	-0.12	24.06	0.95
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	37,700	-1.69	2.53%	14.703	-0.09	51.11	2.06
BVH	Beverages	48,900	-1.41	1.84%	11.798	-0.05	20.73	1.63
BCM	#N/A	84,100	-0.59	2.30%	8.164	#N/A	50.84	4.97
PDR	Capital Markets	10,550	-3.21	4.27%	25.255	-0.11	3.26	0.84
GVR	Real Estate Management & Development	14,300	-3.38	3.50%	13.879	-0.08	13.46	1.14

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.