

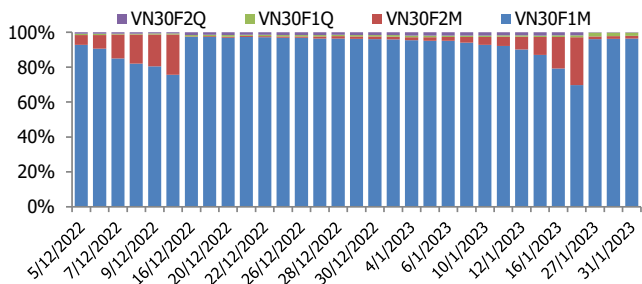
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	16	1125.00	47,488
VN30F2303	16/3/2023	44	1123.60	761
VN30F2306	15/6/2023	135	1109.60	939
VN30F2309	21/9/2023	233	1103.10	102

TỶ TRỌNG VỊ THẾ MỞ GIỮA CÁC KỶ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	%Chg	P/E	YTD
VNIndex	1,111.18	0.78	12.88	10.34
Dow Jones	34,086.04	1.09	19.12	2.83
S&P500	4,076.60	1.46	19.32	6.18
Nikkei 225	27,500.37	0.63	21.55	5.39
Shanghai	3,255.67	(0.42)	14.22	5.39
DAX	15,128.27	0.01	12.30	8.65
Vàng	1,925.90	(0.13)		5.59
Dầu WTI	79.20	0.42		(1.32)

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%	
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	2/2	186K	
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (T1)	3/2	3.5%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

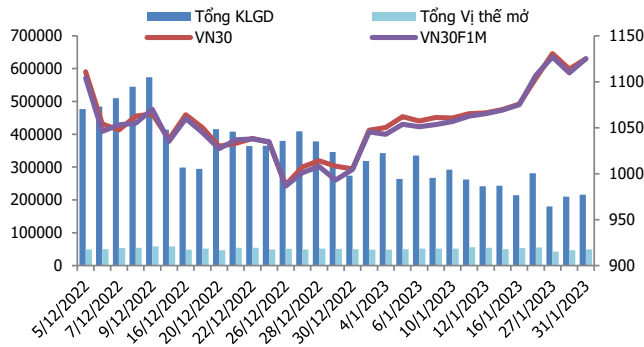
- Thị trường ngược dòng hồi phục về cuối phiên nhờ lực kéo mạnh tới từ nhóm cổ phiếu trụ. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 12,5 đến 15,2 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 11,12 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này cải thiện lên mức -0,07 điểm, cho thấy nhà đầu tư đã quay trở lại với tâm lý tích cực khi thị trường chỉ gặp một vài nhịp điều chỉnh nhẹ và tiếp tục mạch tăng điểm về dài hạn.
- Sự trở lại của nhóm cổ phiếu ngân hàng đã tạo sức lan tỏa rộng khắp sang các nhóm cổ phiếu dẫn dắt khác như: chứng khoán, bất động sản tầm trung, nhóm vật liệu xây dựng, đầu tư công, thủy sản, v.v... Về kỹ thuật, chỉ số Vn-index đã tăng 9/10 phiên gần đây, nhịp điều chỉnh 1,5 phiên test lại đỉnh tháng 12 hoàn tất, mở ra cơ hội cho thị trường vượt đỉnh và hướng tới ngưỡng MA200 ở khu vực 1.160 điểm.
- Thị trường phái sinh có một phiên ngược dòng và quay trở về trạng thái tăng điểm tích cực. Các nhịp điều chỉnh nhẹ xuất hiện là một dấu hiệu bình thường của thị trường do đã trải qua hơn 8 phiên đi lên liên tiếp, qua đó tạo đà bứt phá trong dài hạn.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ khởi sắc khi kết quả lợi nhuận mạnh mẽ và dữ liệu lạm phát đáng khích lệ đã hỗ trợ S&P 500 ghi nhận tháng 1 tốt nhất kể từ năm 2019. Kết phiên, chỉ số Dow Jones tăng 368,95 điểm (+1,09%) lên 34.086,04 điểm. Chỉ số S&P 500 tiến 1,46% lên 4.076,60 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite cộng 1,67% lên 11.584,55 điểm, đánh dấu tháng 1 tăng tốt nhất kể từ năm 2001.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1111-1116 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1090 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1140-1145 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1130-1136 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

- Lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã giúp cả 4 HĐTL lợi ngược dòng tăng từ 12,5 đến 15,2 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 2,76% so với phiên liền trước, đạt 215.839 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 215.071 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 2 với 1.883 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 10.503 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1125,71 điểm (cao hơn 0,71 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1128,22 điểm (+4,62 điểm), VN30F2306 là 1130,46 điểm (+20,86 điểm) và VN30F2309 là 1134,38 điểm (+31,28 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1125.0	2.00	215,071	2.8	47,488	
VN30F2303	1123.6	1.00	586	13.57	761	
VN30F2306	1109.6	1.00	91	-73.5	939	
VN30F2309	1103.1	1.00	91	89.58	102	
Tổng			215,839	2.8	49,290	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	BUY
Hỗ trợ	1111-1116	1096-1100	1065-1082
Kháng cự	1130-1136	1140-1145	1150-1160

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

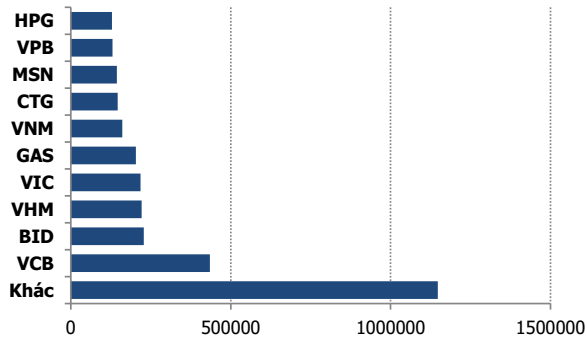


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1111.18	1125.07
Thay đổi	8.61	11.12
%Chg	0.78	1.00
YTD	10.34	11.93
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,434.79	3,164.43
P/E	12.88	10.84
P/B	1.82	1.68

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố đưa các chỉ số chính ngược dòng hồi phục. Số mã tăng điểm (20) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (10) và 0 mã đứng tham chiếu, trong đó STB và ACB trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +2,47 điểm và +1,95 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 11,12 điểm (+1%) lên 1.125,07 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 235,46 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 6.052 tỷ đồng.
- Khối ngoại quay lại bán ròng với 117,52 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như VNM (-157 tỷ đồng), ST8 (-80 tỷ đồng), DGC (-63 tỷ đồng), VHM (-36 tỷ đồng), KDH (-29 tỷ đồng).

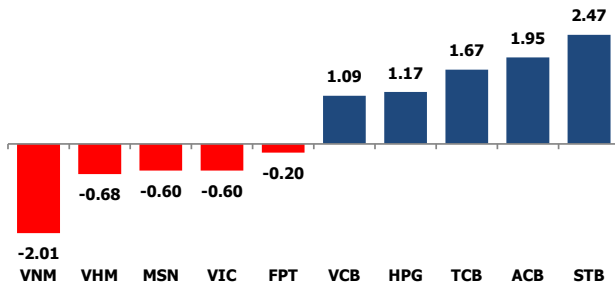
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

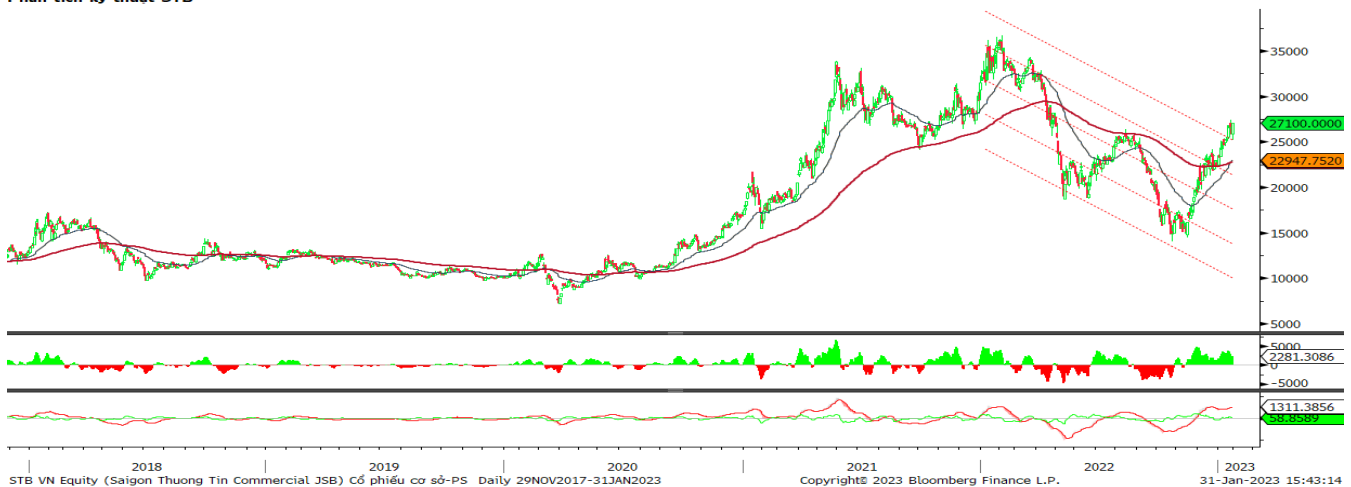
- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 STB, ACB và TCB là những nhân tố chính giúp chỉ số VN30 quay lại đà tăng điểm. Trong đó, STB đóng góp +2,47 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT STB

Phân tích kỹ thuật STB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	19,450	1.04	2.36%	482.509	0.91	7.11	1.38
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	83,500	-0.24	2.45%	126.525	-0.20	17.39	4.60
ACB	Banks	26,050	2.56	4.20%	88.405	1.95	6.64	1.58
HPG	Metals & Mining	22,100	1.61	1.84%	616.158	1.17	8.30	1.31
TCB	Banks	29,400	2.44	4.81%	174.766	1.67	4.87	0.95
MSN	Food Products	101,100	-0.88	1.90%	35.754	-0.60	14.99	5.61
VNM	Food Products	77,100	-2.90	3.38%	372.847	-2.01	20.41	5.17
VHM	Real Estate Management & Development	50,900	-1.17	2.78%	66.536	-0.68	7.05	1.63
VIC	Real Estate Management & Development	57,100	-1.04	3.54%	78.856	-0.60	197.00	1.92
STB	Banks	27,100	4.84	7.75%	656.887	2.47	12.32	1.38
MWG	Specialty Retail	46,500	0.65	2.54%	124.766	0.34	13.27	2.92
MBB	Banks	19,550	1.56	4.27%	285.501	0.78	5.04	1.22
VCB	Banks	91,900	2.22	4.67%	129.02	1.09	16.46	3.39
HDB	Banks	18,650	2.19	3.32%	64.871	0.74	6.21	1.33
VJC	Airlines	116,300	2.92	3.84%	33.56	0.93	#####	3.60
VIB	#N/A	23,550	2.17	4.20%	166.935	#N/A	5.91	1.63
VRE	Real Estate Management & Development	29,700	-0.34	3.08%	32.68	-0.10	32.67	2.07
SSI	Capital Markets	21,600	2.86	3.84%	379	0.65	9.59	1.46
CTG	Banks	30,500	2.52	3.39%	102.81	0.57	9.42	1.39
TPB	Banks	25,000	4.60	6.61%	402.346	1.00	6.53	1.29
SAB	Food Products	189,000	-0.53	2.31%	10.491	-0.07	22.43	4.97
KDH	Real Estate Management & Development	28,000	0.90	1.44%	67.944	0.12	15.68	1.76
NVL	Real Estate Management & Development	14,200	1.79	2.49%	149.543	0.20	9.70	0.74
GAS	Gas Utilities	106,300	-0.28	1.80%	30.14	-0.03	15.26	3.59
BID	Banks	45,100	1.35	3.56%	72.614	0.13	14.09	2.37
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,400	0.40	2.04%	93.12	0.02	24.86	0.98
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	36,800	-0.67	2.19%	27.302	-0.03	49.89	2.01
BVH	Beverages	50,400	-0.20	1.81%	33.499	-0.01	21.36	1.68
PDR	Capital Markets	13,850	1.09	1.83%	48.378	0.04	4.28	1.10
GVR	Real Estate Management & Development	16,700	1.21	5.66%	57.684	0.03	15.72	1.33

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.