

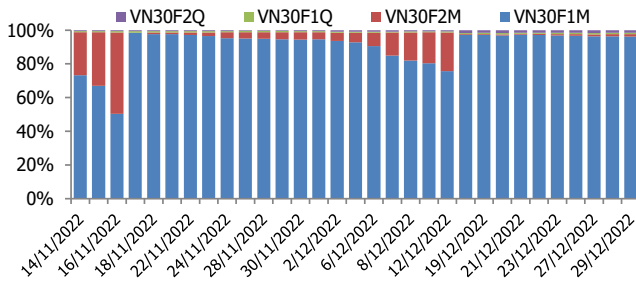
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	21	993.00	49,314
VN30F2302	16/2/2023	49	990.00	761
VN30F2303	16/3/2023	77	985.90	403
VN30F2306	15/6/2023	168	973.70	790

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	1,009.29	(0.63)	10.55	(32.64)
Dow Jones	33,220.80	1.05	18.77	(8.58)
S&P500	3,849.28	1.75	18.57	(19.24)
Nikkei 225	26,164.78	0.27	17.70	(9.12)
Shanghai	3,073.70	(0.44)	13.84	(15.55)
DAX	14,071.72	1.05	13.01	(11.41)
Vàng	1,817.07	0.12		(0.66)
Dầu WTI	78.75	0.45		4.71

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - Doanh số nhà chờ bán (T11)	28/12	-4.6%	-4.0%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	29/12	216K	225K
Mỹ - Dự trữ dầu thô	29/12	-5,894M	0,718M

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

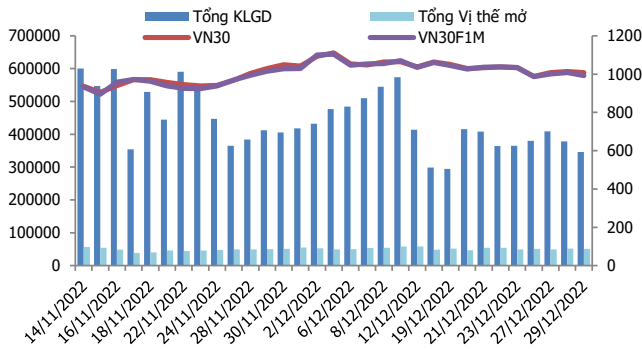
- Áp lực bán mạnh về cuối phiên đã lấn át đà tăng điểm trước đó trong phiên và khiến thị trường giảm điểm. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 7,3 đến 15 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 5,65 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này giảm mạnh xuống mức -15,3, cho thấy tâm lý nhà đầu tư đã trở nên bi quan trước xu hướng chưa rõ ràng của thị trường.
- Thị trường trong nước hụt hơi sau 2 phiên tăng liên tiếp khi dòng tiền nội co lại. Lượng hàng bắt đáy ở phiên đầu tuần và phiên T+2,5 đang có lãi trong khi người mua hôm nay phải nắm giữ qua kỳ nghỉ lễ nên lực bán trong phiên chiều khiến thị trường trượt dốc trước phiên ATC. Dòng tiền ngoại mặc dù vẫn mua đều ở phiên chiều trong những phiên gần đây dù có thể giúp chỉ số tăng/giảm dao động trong biên độ hẹp nhưng mặt bằng cổ phiếu vẫn bị thiệt hại.
- Thị trường phái sinh nhiều khả năng sẽ ghi nhận các nhịp dao động trong biên độ hẹp do các tín hiệu từ thị trường cơ sở cũng như thanh khoản thị trường đều chưa thật sự khả quan. Nhà đầu tư nên cẩn trọng khi giao dịch và không nên mua đuổi. Theo đó, có thể mở rộng vị thế và canh Long ở các nhịp điều chỉnh trong phiên với mục tiêu giao dịch ở mức 980-983 điểm.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ khởi sắc khi nhà đầu tư bước vào những phiên giao dịch cuối cùng của năm 2022. Đóng cửa, chỉ số Dow Jones tăng 345,09 điểm (+1,05%) lên 33.220,80 điểm, phục hồi gần như toàn bộ mức giảm trong phiên trước đó. Chỉ số S&P 500 tiến 1,75% lên 3.849,28 điểm, và chỉ số Nasdaq Composite cộng 2,59% lên 10.478,09 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 980-983 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 970 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1014-1017 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1000-1007 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
VN30F2212	993.0	0.00	345,408	-8.5	49,314	
VN30F2301	990.0	1.00	550	-14.99	761	
VN30F2303	985.9	30.00	71	-41.3	403	
VN30F2306	973.7	6.00	132	88.57	790	
Tổng			346,161	-8.5	51,268	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HĐTL

- Áp lực bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 7,3 đến 15 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 8,51% so với phiên liền trước, đạt 346.161 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 1 với 345.408 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 1 với 945 hợp đồng, lụy kế mua ròng khoảng 17.242 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1009,05 điểm (cao hơn 16,05 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1010,05 điểm (+20,05 điểm), VN30F2303 là 1011,05 điểm (+25,15 điểm) và VN30F2306 là 1014,31 điểm (+40,61 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	980-983	965-970	950-959
Kháng cự	1000-1007	1014-1017	1023-1030

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

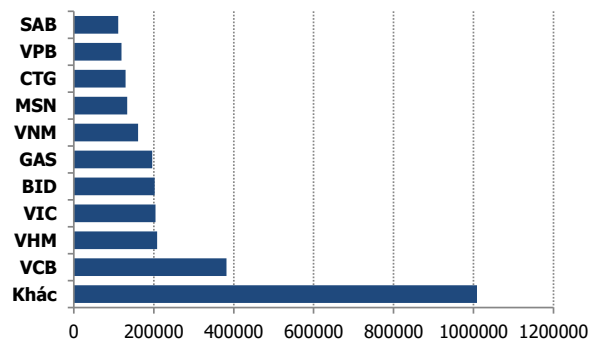


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1009.29	1008.3
Thay đổi	-6.37	-5.65
% Chg	-0.63	-0.56
YTD	-32.64	-34.34
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,026.13	2,856.71
P/E	10.55	8.64
P/B	1.62	1.60

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 (21) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (6) và 3 mã đứng tham chiếu. VPB và STB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -1,6 điểm và -1,08 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 5,65 điểm (-0,56%) xuống 1.008,3 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 183,19 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 4.521 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 5 liên tiếp với 146,17 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như VND (+61 tỷ đồng), HPG (+45 tỷ đồng), STB (+33 tỷ đồng), VNM (+28 tỷ đồng), DGC (+26 tỷ đồng).

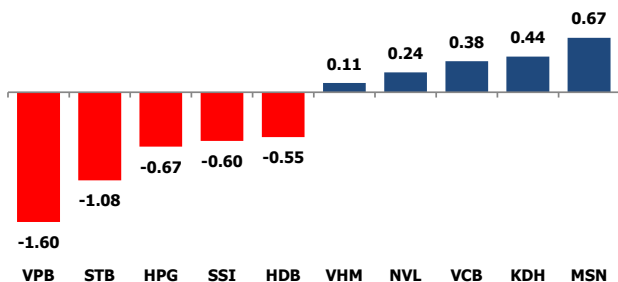
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, STB và HPG là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại với sắc đỏ. Trong đó, VPB gây ảnh hưởng -1,6 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	17,800	-1.93	3.93%	368.182	-1.60	5.94	1.26
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	76,200	-0.65	1.05%	50.245	-0.49	15.87	4.20
VNM	Food Products	77,000	0.00	1.56%	103.065	0.00	20.38	5.17
ACB	Banks	22,000	0.00	2.75%	39.946	0.00	5.61	1.33
MSN	Food Products	94,000	1.08	3.57%	59.476	0.67	13.94	5.22
TCB	Banks	25,950	-0.76	2.14%	76.384	-0.48	4.30	0.84
HPG	Metals & Mining	18,000	-1.10	3.64%	317.625	-0.67	6.76	1.07
VHM	Real Estate Management & Development	47,800	0.21	2.32%	60.352	0.11	6.62	1.53
VIC	Real Estate Management & Development	53,600	0.19	2.86%	113.732	0.10	184.92	1.80
MWG	Specialty Retail	42,900	-0.23	1.90%	51.587	-0.11	12.24	2.70
MBB	Banks	17,400	-0.29	1.73%	72.925	-0.13	4.49	1.09
STB	Banks	22,350	-2.40	2.68%	214.011	-1.08	10.16	1.14
VCB	Banks	80,700	0.88	2.48%	100.751	0.38	14.45	2.98
VJC	Airlines	109,200	-1.18	3.13%	44.308	-0.37	956.44	3.38
HDB	Banks	15,900	-1.85	3.14%	21.798	-0.55	5.29	1.14
VRE	Real Estate Management & Development	26,500	-1.49	2.45%	41.383	-0.38	29.15	1.85
VIB	#N/A	18,900	-0.53	2.40%	26.162	#N/A	4.75	1.31
CTG	Banks	27,000	-0.55	2.23%	46.788	-0.11	8.34	1.23
TPB	Banks	21,400	0.00	1.65%	67.652	0.00	5.59	1.10
SSI	Capital Markets	17,600	-3.03	3.69%	156.775	-0.60	7.81	1.19
KDH	Real Estate Management & Development	27,950	3.33	5.43%	39.085	0.44	15.65	1.75
SAB	Food Products	172,900	-2.04	1.62%	18.036	-0.27	20.52	4.55
NVL	Real Estate Management & Development	14,650	2.09	9.25%	324.527	0.24	10.00	0.77
GAS	Gas Utilities	102,600	-0.39	1.27%	10.043	-0.04	14.72	3.47
BID	Banks	40,000	-4.53	5.25%	52.143	-0.40	12.50	2.10
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	10,500	-1.41	1.90%	32.817	-0.07	21.05	0.83
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31,350	-0.48	1.91%	23.814	-0.02	42.50	1.71
PDR	Capital Markets	13,400	-0.37	7.09%	122.047	-0.01	4.14	1.07
BVH	Beverages	46,500	-0.43	1.83%	21.477	-0.02	19.71	1.55
GVR	Real Estate Management & Development	13,800	-2.82	3.26%	9.309	-0.07	12.99	1.10

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.