

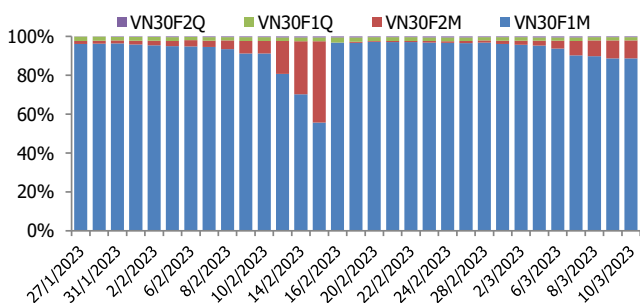
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	4	1049,80	57.817
VN30F2304	20/4/2023	39	1042,00	6.069
VN30F2306	15/6/2023	95	1040,00	1.071
VN30F2309	21/9/2023	193	1039,10	254

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	1.053,00	(0,28)	13,73	(28,20)
Dow Jones	31.909,64	(1,07)	19,18	(3,73)
S&P500	3.861,59	(1,45)	18,76	0,58
Nikkei 225	27.654,50	(1,74)	23,49	6,03
Shanghai	3.242,73	0,39	14,31	4,50
DAX	15.427,97	(1,31)	12,38	10,80
Vàng	1.876,69	0,51		(5,95)
Dầu WTI	76,58	0,01		(30,39)

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	211K
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (Tháng 2)	10/3	3,4%	3,6%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

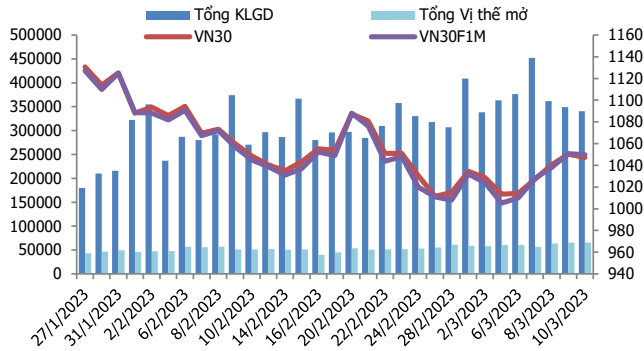
- Thị trường phái sinh có một phiên điều chỉnh nhẹ với cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 0,9 đến 6 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 3,08 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục cải thiện lên mức dương 2,6 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư đã trở nên lạc quan hơn đôi chút khi thị trường ghi nhận 1 tuần hồi phục tích cực.
- Thị trường cơ sở chốt tuần điều chỉnh nhẹ vẫn được xem là tín hiệu tích cực nếu đặt trong bối cảnh chứng khoán thế giới giảm mạnh tuần này. Bên cạnh đó, tín hiệu tích cực từ thị trường phái sinh và hoạt động mua ròng trở lại từ khối ngoại sẽ tiếp tục là nhân tố giúp thị trường chống đỡ tác động từ chứng khoán thế giới trong tuần sau.
- Thị trường phái sinh quay đầu giảm điểm trong phiên cuối tuần, tuy nhiên vẫn có một tuần tăng điểm tích cực sau nhịp giảm điểm liên tiếp trước đó. Bên cạnh đó, basis đang cải thiện dần và duy trì ở mức dương. Tuy nhiên, nhà đầu tư vẫn cần thận trọng đôi chút khi chuẩn bị đón những tin tức quốc tế quan trọng trong tuần tới.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ tiếp tục giảm điểm vào ngày thứ Sáu (10/3) khi ngân hàng Silicon Valley Bank đóng cửa vì thua lỗ trong danh mục đầu tư trái phiếu. Kết phiên, chỉ số Dow Jones giảm phiên thứ 4 liên tiếp, rớt 345,22 điểm (-1,07%) xuống 31.909,64 điểm. Chỉ số S&P 500 lùi 1,45% xuống 3.861,59 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite mất 1,76% còn 11.138,89 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1040-1045 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1034 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1072-1080 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1057-1060 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 HDTL

- Áp lực bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch đã khiến cả 4 HDTL đóng cửa giảm từ 0,9 đến 6 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 2,48% so với phiên liền trước, đạt 340.480 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 3 với 336.447 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 3 với 485 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 4.312 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1047,39 điểm (thấp hơn 2,41 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1048,68 điểm (+6,68 điểm), VN30F2306 là 1050,76 điểm (+10,76 điểm) và VN30F2309 là 1054,41 điểm (+15,31 điểm).

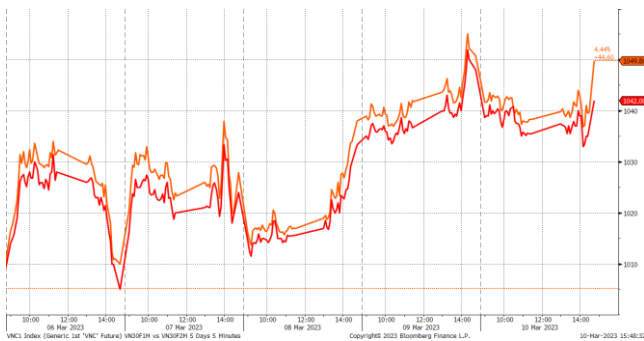
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1049,8	198,00	336.447	-2,8	57.817	
VN30F2304	1042,0	147,00	3.791	37,65	6.069	
VN30F2306	1040,0	279,00	174	-5,4	1.071	
VN30F2309	1039,1	102,00	68	-46,03	254	
Tổng			340.480	-2,5	65.211	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	SELL
Hỗ trợ	1040-1045	1020-1034	1000-1005
Kháng cự	1057-1060	1072-1080	1093-1100

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

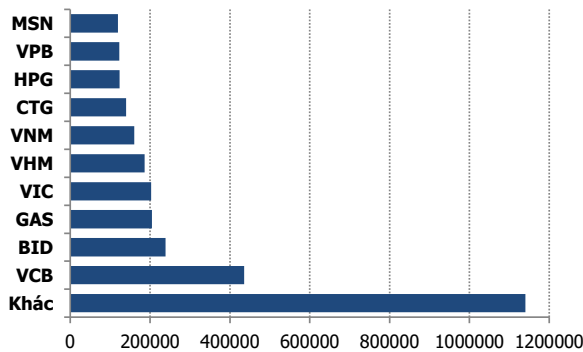


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1053	1047,2
Thay đổi	-2,95	-3,08
%Chg	-0,28	-0,29
YTD	-28,20	-29,11
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4.212,73	3.084,41
P/E	13,73	11,03
P/B	1,67	1,62

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính điều chỉnh nhẹ. Số mã giảm điểm (20) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (8) và 2 mã đứng tham chiếu, trong đó TCB và ACB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -1,55 điểm và -1,35 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 3,08 điểm (-0,29%) xuống 1.047,2 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 133,91 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.272 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 4 liên tiếp với 418,42 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+71 tỷ đồng), VND (+58 tỷ đồng), HSG (+56 tỷ đồng), SSI (+54 tỷ đồng), VHM (+48 tỷ đồng).

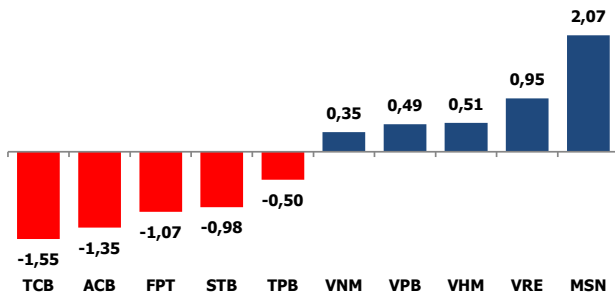
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 TCB, ACB và FPT là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, TCB gây ảnh hưởng -1,55 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT TCB

Phân tích kỹ thuật TCB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18.300	0,55	2,23%	268,074	0,49	6,69	1,30
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	79.500	-1,36	1,77%	50,918	-1,07	16,55	4,38
ACB	Banks	24.900	-1,78	1,82%	60,435	-1,35	6,14	1,44
HPG	Metals & Mining	21.300	0,47	2,14%	476,277	0,33	8,00	1,26
VNM	Food Products	76.900	0,52	1,45%	109,646	0,35	21,17	5,38
TCB	Banks	27.150	-2,34	2,22%	58,084	-1,55	4,49	0,88
MSN	Food Products	83.900	3,84	4,97%	116,554	2,07	33,36	4,57
VIC	Real Estate Management & Development	53.100	0,19	1,52%	47,505	0,10	183,20	1,79
STB	Banks	26.000	-1,89	3,47%	618,896	-0,98	11,82	1,33
VCB	Banks	92.100	-0,97	1,09%	65,143	-0,49	16,49	3,40
VHM	Real Estate Management & Development	42.850	1,06	2,38%	108,403	0,51	5,93	1,37
MBB	Banks	17.750	-0,28	1,14%	93,566	-0,13	4,58	1,11
MWG	Specialty Retail	39.750	-0,63	1,78%	62,425	-0,29	11,35	2,50
HDB	Banks	18.500	0,00	2,49%	27,049	0,00	6,16	1,32
VJC	Airlines	100.600	-1,18	4,26%	30,554	-0,34	881,12	3,11
VRE	Real Estate Management & Development	28.000	3,70	4,28%	63,428	0,95	22,92	1,91
TPB	Banks	24.000	-2,04	2,30%	65,395	-0,50	6,27	1,24
VIB	#N/A	20.950	-1,18	1,93%	48,808	#N/A	5,22	1,35
CTG	Banks	29.200	-0,68	1,92%	46,743	-0,15	9,02	1,33
SSI	Capital Markets	19.800	0,00	2,06%	262,796	0,00	8,79	1,34
SAB	Food Products	185.600	-0,48	1,30%	49,763	-0,07	22,02	4,88
NVL	Real Estate Management & Development	10.650	-2,74	2,83%	82,996	-0,34	7,27	0,56
GAS	Gas Utilities	107.000	0,19	1,71%	24,502	0,02	13,95	3,42
BID	Banks	47.150	-1,05	1,06%	40,609	-0,11	14,73	2,48
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12.950	-0,38	1,95%	115,76	-0,03	25,97	1,02
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38.150	-2,18	2,63%	25,035	-0,11	51,72	2,08
BVH	Beverages	49.200	-0,51	1,23%	5,495	-0,02	20,86	1,64
PDR	Capital Markets	11.750	-2,08	2,59%	40,546	-0,08	3,63	0,94
BCM	#N/A	83.800	-0,24	2,07%	12,282	#N/A	50,66	4,96
GVR	Real Estate Management & Development	15.000	-0,99	2,68%	40,333	-0,03	14,12	1,19

STT	Thông tin cơ bản HĐTL VN30	
1	Mã hợp đồng	VN30F-yy-mm
2	Tài sản cơ sở	Chi 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 cửa của chi 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.