

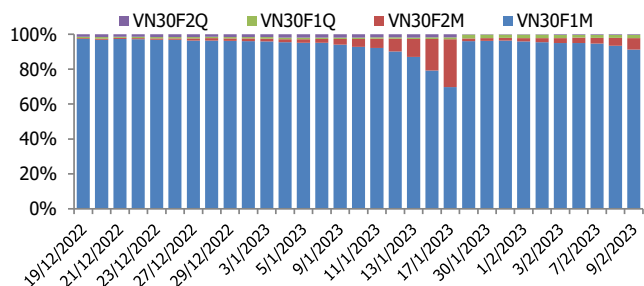
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	7	1057.00	46,724
VN30F2303	16/3/2023	35	1055.00	3,352
VN30F2306	15/6/2023	126	1048.90	960
VN30F2309	21/9/2023	224	1046.90	217

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	1,064.03	(0.76)	13.77	5.65
Dow Jones	33,699.88	(0.73)	20.10	1.67
S&P500	4,081.50	(0.88)	19.34	6.30
Nikkei 225	27,775.49	0.69	21.76	6.44
Shanghai	3,270.38	1.18	14.29	5.86
DAX	15,523.42	0.72	12.68	11.49
Vàng	1,864.67	0.16		2.23
Dầu WTI	77.75	(0.40)		(3.13)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Anh - PMI xây dựng (T1)	6/2	48.8	48.4
Úc - Quyết định lãi suất (T2)	7/2	3.10%	3.35%
Mỹ - Dự trữ dầu thô	8/2	4,140M	2,423M
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	9/2	183K	196K
Anh - Sản lượng sản xuất	10/2	-0.5%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

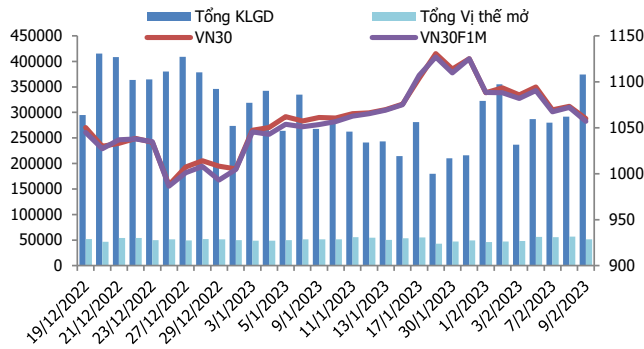
- Thị trường phái sinh hôm nay ghi nhận các nhịp dao động giằng co xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay, và sau đó gặp áp lực bán khá lớn từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 8,3 đến 15,7 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 13,47 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này giảm xuống mức âm 2,91 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái tâm lý thận trọng.
- Thanh khoản xuống thấp là nguyên nhân chính khiến thị trường trượt dốc về cuối phiên dưới áp lực giảm từ nhóm cổ phiếu bluechips, trong đó nổi bật là cổ phiếu ngân hàng, thép,... Bên cạnh đó, đà giảm của thị trường còn xuất phát từ hoạt động bán ròng của khối ngoại trong phiên chiều. Khả năng nhóm bluechips sẽ “trả điểm” ở phiên ngày mai khi trong nước không có thông tin bất lợi và chứng khoán thế giới đang phục hồi trở lại.
- Thị trường phái sinh tiếp tục ghi nhận một phiên giảm điểm ngay sau một phiên tăng điểm. Mặc dù đây chỉ là diễn biến đi ngang khá bình thường của thị trường, cùng với việc không có thông tin gì bất lợi trong nước cũng như quốc tế, nhà đầu tư vẫn cần tiếp tục thận trọng trước các nhịp dao động giằng co, cùng với việc basis hiện vẫn đang ở mức âm.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số Dow Jones lùi 249,13 điểm (-0,73%) xuống 33.699,88 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 36,36 điểm (-0,9%) còn 4.081,50 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite giảm mạnh nhất trong 3 chỉ số, rớt 120,94 điểm (-1,02%) xuống 11.789,58 điểm. Cả 3 chỉ số chính đều ghi nhận mức thấp nhất của phiên trong giờ giao dịch cuối cùng.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1048-1055 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1042 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1080-1085 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1068-1072 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 khá mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã khiến cả 4 HDTL đóng cửa giảm từ 8,3 đến 15,7 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 28,16% so với phiên liền trước, đạt 374.113 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 2 với 371.900 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 2 với 71 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 14.450 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1060,17 điểm (cao hơn 3,17 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1061,22 điểm (+6,22 điểm), VN30F2306 là 1064,65 điểm (+15,75 điểm) và VN30F2309 là 1068,34 điểm (+21,44 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1057.0	1.00	371,900	28.3	46,724	
VN30F2303	1055.0	6.00	2,080	11.05	3,352	
VN30F2306	1048.9	10.00	34	-57.5	960	
VN30F2309	1046.9	1.00	99	39.44	217	
Tổng			374,113	28.2	51,253	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1048-1055	1030-1040	1013-1020
Kháng cự	1068-1072	1080-1085	1090-1104

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

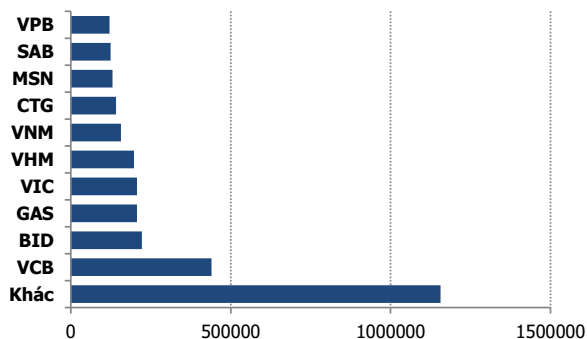


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1064.03	1059.91
Thay đổi	-8.19	-13.47
%Chg	-0.76	-1.25
YTD	5.65	5.44
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,246.54	3,103.27
P/E	13.77	11.14
P/B	1.71	1.64

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 (23) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (7) và 0 mã đứng tham chiếu, trong đó VJC và VHM trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -1,72 điểm và -1,48 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 13,47 điểm (-1,25%) xuống 1.059,91 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 159,6 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 4.350 tỷ đồng.
- Khỏi ngoại quay lại bán ròng sau 6 phiên mua ròng liên tiếp với 31,78 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như BCM (-86 tỷ đồng), VHM (-61 tỷ đồng), VNM (-56 tỷ đồng), VIC (-38 tỷ đồng), MSN (-24 tỷ đồng).

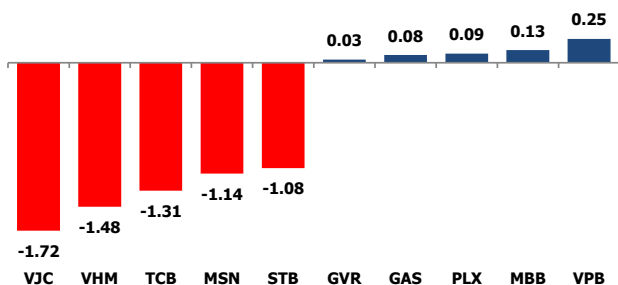
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VJC, VHM và TCB là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, VJC gây ảnh hưởng -1,72 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VJC

Phân tích kỹ thuật VJC



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18,000	0.28	3.63%	275.723	0.25	6.58	1.28
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,700	-0.62	1.12%	60.274	-0.49	16.80	4.45
ACB	Banks	24,500	-0.61	2.45%	79.91	-0.45	6.25	1.48
HPG	Metals & Mining	20,600	-1.20	3.16%	340.152	-0.83	7.74	1.22
VNM	Food Products	75,000	-1.06	1.33%	119.858	-0.70	19.85	5.03
TCB	Banks	27,300	-1.97	2.01%	76.216	-1.31	4.52	0.88
MSN	Food Products	91,800	-1.82	2.94%	71.792	-1.14	13.61	5.10
VIC	Real Estate Management & Development	54,200	-0.37	4.01%	160.191	-0.20	186.99	1.82
VHM	Real Estate Management & Development	45,300	-2.79	3.09%	142.05	-1.48	6.27	1.45
VCB	Banks	93,000	-1.27	2.15%	71.474	-0.65	16.65	3.43
MWG	Specialty Retail	44,000	-1.12	3.30%	65.502	-0.57	12.56	2.76
STB	Banks	24,450	-2.20	6.20%	933.661	-1.08	11.11	1.25
MBB	Banks	18,450	0.27	1.91%	117.239	0.13	4.76	1.15
HDB	Banks	18,200	-0.55	3.65%	31.294	-0.18	6.06	1.30
VJC	Airlines	101,900	-5.65	6.97%	23.071	-1.72	892.51	3.15
VRE	Real Estate Management & Development	28,200	-1.05	2.84%	34.297	-0.28	31.02	1.97
VIB	#N/A	22,000	-0.90	2.05%	39.343	#N/A	5.52	1.52
TPB	Banks	24,250	-1.42	3.71%	257.648	-0.35	6.33	1.25
CTG	Banks	29,400	-1.67	2.72%	80.437	-0.38	9.08	1.34
SSI	Capital Markets	19,350	-0.77	2.33%	145.165	-0.16	8.59	1.31
NVL	Real Estate Management & Development	14,150	-1.05	3.57%	121.197	-0.17	9.66	0.74
SAB	Food Products	193,800	-1.72	3.65%	9.761	-0.25	23.00	5.10
GAS	Gas Utilities	108,100	0.75	1.40%	34.07	0.08	15.51	3.65
BID	Banks	44,000	-1.12	2.27%	52.797	-0.11	13.75	2.31
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,000	-2.04	2.50%	46.991	-0.15	24.06	0.95
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	37,900	1.88	3.08%	17.327	0.09	51.38	2.07
BVH	Beverages	49,350	0.20	1.52%	7.576	0.01	20.92	1.64
PDR	Capital Markets	12,050	-2.43	4.56%	46.332	-0.09	3.72	0.96
BCM	#N/A	84,700	0.24	1.68%	4.804	#N/A	51.20	5.01
GVR	Real Estate Management & Development	14,950	1.36	2.70%	19.96	0.03	14.07	1.19

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.