

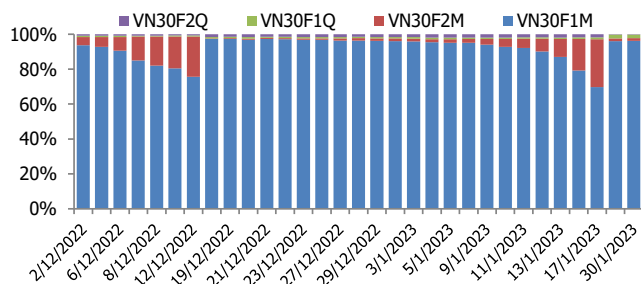
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	17	1109.80	45,130
VN30F2304	20/4/2023	80	1108.40	718
VN30F2306	15/6/2023	136	1097.10	957
VN30F2309	21/9/2023	234	1090.00	85

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	1,102.57	(1.30)	12.31	9.48
Dow Jones	33,717.09	(0.77)	19.82	1.72
S&P500	4,017.77	(1.30)	19.46	4.64
Nikkei 225	27,414.58	(0.07)	18.33	5.06
Shanghai	3,269.32	0.14	14.82	5.83
DAX	15,126.08	(0.16)	14.11	8.64
Vàng	1,925.14	0.10		5.54
Dầu WTI	77.79	(0.14)		(3.08)

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	108.3	
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

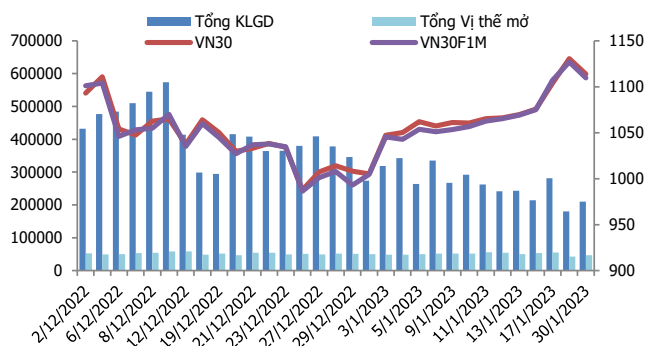
- Áp lực bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ đã khiến thị trường không thể tiếp tục duy trì mạch tăng điểm. Đóng cửa, cả 4 HDTL giảm từ 14,5 đến 21,4 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 16,7 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục giảm xuống mức -4,15 điểm, cho thấy nhà đầu tư đang duy trì một tâm lý thận trọng trước các nhịp giảm điểm có thể xuất hiện sau đà hưng phấn liên tiếp của thị trường.
- Thị trường gặp áp lực chốt lời sau chuỗi tăng 8 phiên liên tiếp là hoàn toàn bình thường. Dòng tiền đang dịch chuyển sang nhóm cổ phiếu nhỏ khi nhóm bluechips đóng vai trò lực kéo thị trường vượt đỉnh tháng 12 bị chốt lời. Về kỹ thuật, khu vực 1.120 -1.124 điểm là ngưỡng cản kỹ thuật của chỉ số Vn-Index, với việc thanh khoản lên cao ở phiên hôm nay, khả năng thị trường còn có thể gặp khó khăn ở các phiên sắp tới, vùng hỗ trợ ở 1.065 – 1.098 điểm.
- Thị trường phái sinh có một phiên điều chỉnh sau các phiên tăng điểm liên tiếp. Tuy nhiên, đây là diễn biến hoàn toàn bình thường của thị trường. Đây có thể chỉ là một nhịp điều chỉnh trong ngắn hạn để thị trường "lấy đà bút phá" và bước vào mạch tăng điểm trong dài hạn.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm điểm, tạm dừng đà leo dốc tháng 1/2023 khi nhà đầu tư chuẩn bị cho tuần bận rộn nhất của mùa báo cáo lợi nhuận và khả năng nâng lãi suất từ Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed). Kết phiên, chỉ số Dow Jones rớt 260,99 điểm (-0,77%) xuống 33.717,09 điểm. Chỉ số S&P 500 lùi 1,3% xuống 4.017,77 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite mất 1,96% còn 11.393,81 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1100-1105 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1080 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1123-1129 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1115-1120 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
VN30F2302	1109.8	38.00	209,140	16.9	45,130	
VN30F2304	1108.4	92.00	516	-19.00	718	
VN30F2306	1097.1	59.00	344	31.3	957	
VN30F2309	1090.0	78.00	48	-53.40	85	
Tổng			210,048	16.7	46,890	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HĐTL

- Áp lực chốt lời mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 14,5 đến 21,4 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 16,74% so với phiên liền trước, đạt 210.048 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 209.140 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 2 với 350 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 12.386 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1114,62 điểm (cao hơn 4,82 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1115,73 điểm (+7,33 điểm), VN30F2306 là 1119,32 điểm (+22,22 điểm) và VN30F2309 là 1123,21 điểm (+33,21 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	BUY
Hỗ trợ	1100-1105	1080-1091	1060-1066
Kháng cự	1115-1120	1123-1129	1135-1140

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

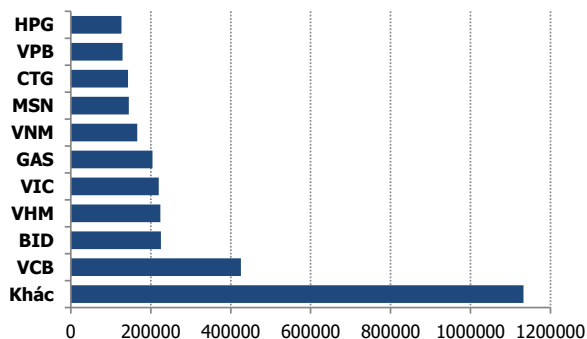


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1102.57	1113.95
Thay đổi	-14.53	-16.70
%Chg	-1.30	-1.48
YTD	9.48	10.82
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,400.44	3,141.01
P/E	12.31	10.32
P/B	1.75	1.74

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính điều chỉnh. Số mã giảm điểm (22) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (6) và 2 mã đứng tham chiếu, trong đó ACB và VPB trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,85 điểm và -2,05 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 16,7 điểm (-1,48%) xuống 1.113,95 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 207,46 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 4.951 tỷ đồng.
- Khối ngoại tiếp tục mua ròng với 789,03 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như FUEVFNVD (+280 tỷ đồng), HPG (+248 tỷ đồng), SSI (+71 tỷ đồng), VND (+50 tỷ đồng), HDB (+47 tỷ đồng).

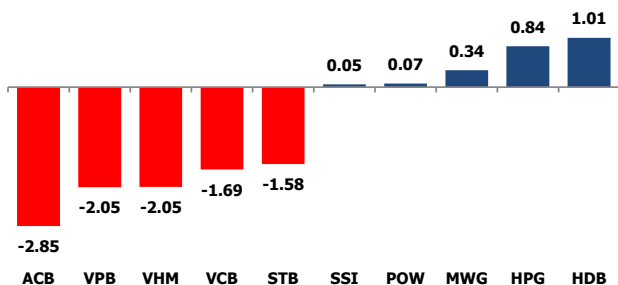
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 ACB, VPB và VHM là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, ACB gây ảnh hưởng -2,85 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



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	19,250	-2.28	2.60%	464.435	-2.05	7.04	1.37
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	83,700	-0.36	0.84%	74.827	-0.29	17.43	4.62
ACB	Banks	25,400	-3.61	3.74%	138.383	-2.85	6.48	1.54
HPG	Metals & Mining	21,750	1.16	3.98%	929.518	0.84	8.17	1.29
VNM	Food Products	79,400	-0.75	0.76%	128.47	-0.52	21.02	5.33
TCB	Banks	28,700	-1.20	1.75%	170.229	-0.84	4.75	0.93
MSN	Food Products	102,000	-1.64	3.33%	33.954	-1.14	15.13	5.66
VHM	Real Estate Management & Development	51,500	-3.38	3.88%	70.159	-2.05	7.13	1.65
VIC	Real Estate Management & Development	57,700	-2.53	3.48%	65.528	-1.50	199.07	1.94
MWG	Specialty Retail	46,200	0.65	3.08%	147.228	0.34	13.19	2.90
STB	Banks	25,850	-3.00	3.09%	485.01	-1.58	11.75	1.32
MBB	Banks	19,250	-2.28	2.86%	246.734	-1.17	4.97	1.20
VCB	Banks	89,900	-3.33	3.01%	95.316	-1.69	16.10	3.32
HDB	Banks	18,250	3.11	3.39%	67.933	1.01	6.07	1.30
VJC	Airlines	113,000	-2.75	3.63%	38.879	-0.91	989.73	3.50
VRE	Real Estate Management & Development	29,800	-1.65	3.07%	47.891	-0.48	32.78	2.08
VIB	#N/A	23,050	-1.28	2.17%	103.809	#N/A	5.79	1.59
SSI	Capital Markets	21,000	0.24	4.83%	406.952	0.05	9.32	1.42
CTG	Banks	29,750	-1.98	1.52%	111.849	-0.45	9.19	1.36
TPB	Banks	23,900	-2.45	2.94%	202.5	-0.55	6.24	1.23
SAB	Food Products	190,000	-1.61	1.90%	33.832	-0.23	22.54	5.00
KDH	Real Estate Management & Development	27,750	0.36	4.40%	36.129	0.05	15.54	1.74
NVL	Real Estate Management & Development	13,950	0.00	5.86%	196.182	0.00	9.53	0.73
GAS	Gas Utilities	106,600	-1.48	2.35%	28.882	-0.16	15.30	3.60
BID	Banks	44,500	-0.11	2.05%	53.861	-0.01	13.90	2.34
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,350	1.23	4.13%	138.937	0.07	24.76	0.97
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	37,050	-2.76	2.97%	25.72	-0.14	50.23	2.02
BVH	Beverages	50,500	-0.98	2.59%	32.254	-0.04	21.41	1.68
PDR	Capital Markets	13,700	0.00	5.20%	88.604	0.00	4.23	1.09
GVR	Real Estate Management & Development	16,500	-2.08	4.24%	56.316	-0.06	15.53	1.31

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.