

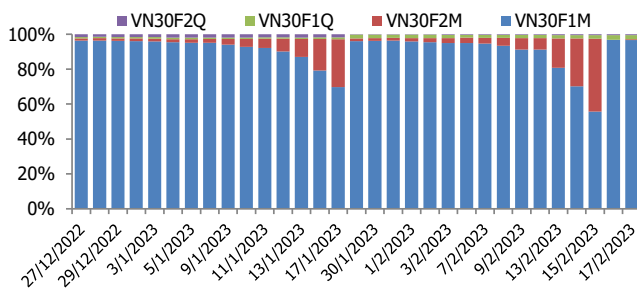
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	25	1049.00	43,651
VN30F2304	20/4/2023	60	1045.00	230
VN30F2306	15/6/2023	116	1046.80	1,052
VN30F2309	21/9/2023	214	1041.50	225

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	1,059.31	0.10	13.77	5.19
Dow Jones	33,826.69	0.39	19.97	2.05
S&P500	4,079.09	(0.28)	19.49	6.24
Nikkei 225	27,486.32	(0.10)	22.58	5.33
Shanghai	3,224.02	(0.77)	14.01	4.36
DAX	15,482.00	(0.33)	12.64	11.19
Vàng	1,841.19	(0.06)		0.94
Dầu WTI	76.18	(0.21)		(5.08)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Nhật Bản - Tổng GDP (Quý 4)	13/2	-0.3%	0.2%
Mỹ - CPI lõi (Tháng 1)	14/2	0.4%	0.4%
Mỹ - Doanh số bán lẻ lõi (Tháng 1)	15/2	-0.9%	2.3%
Mỹ - Chỉ số PPI (Tháng 1)	16/2	-0.2%	0.7%
Anh - Doanh số bán lẻ (Tháng 1)	17/2	-1.2%	0.5%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

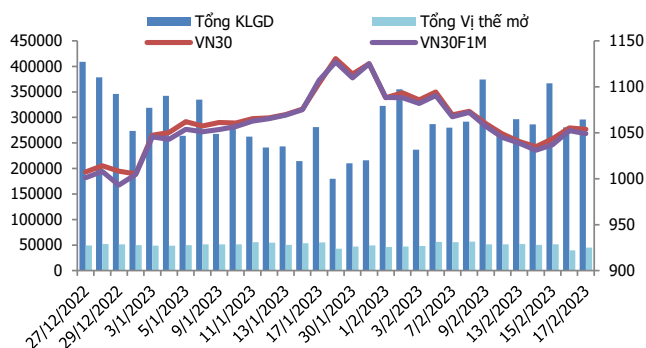
- Thị trường phái sinh hôm nay đánh mất sắc xanh do áp lực chốt lời mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ trong phiên chiều. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 1,7 đến 15 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 1,54 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này sụt giảm xuống mức âm 4,72 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái tâm lý thận trọng khi thị trường quay trở lại mạch giảm điểm chỉ sau 2 phiên hồi phục.
- Thị trường cơ sở đã có tuần hồi phục nhẹ sau nhịp điều chỉnh 2 tuần liên tiếp trong bối cảnh thanh khoản thấp và khối ngoại quay đầu bán ròng. Điểm tích cực là độ rộng thị trường ghi nhận sự hồi phục trên diện rộng ở nhiều nhóm cổ phiếu, trong đó nổi bật nhất là nhóm cổ phiếu đầu tư công, dầu khí, sản xuất điện,... Bên cạnh đó, việc thanh khoản tuần này dưới ngưỡng 10.000 tỷ đồng cũng cho thấy áp lực bán không còn mạnh, nhà đầu tư bắt đáy có lãi cũng không vội bán ngay.
- Thị trường phái sinh đánh mất đà hồi phục chỉ sau 2 phiên, cùng với việc basis hiện vẫn đang ở mức âm và không có nhiều thông tin kinh tế quan trọng hỗ trợ, nhà đầu tư cần tiếp tục thận trọng quan sát, chỉ nên giao dịch ở các ngưỡng kháng cự hoặc hỗ trợ quan trọng.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số Dow Jones cộng 129,84 điểm (+0,39%) lên 33.826,69 điểm. Trong khi, chỉ số S&P 500 lùi 0,28% xuống 4.079,09 điểm và chỉ số Nasdaq Composite mất 0,58% còn 11.787,27 điểm. Năng lượng là lĩnh vực giảm mạnh nhất. Cổ phiếu Devon Energy sụt 4,29%, khiến chỉ số S&P 500 giảm điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1034-1038 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1022 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 1056-1060 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 HĐTTL

- Áp lực bán lớn từ nhóm cổ phiếu trụ xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 1,7 đến 15 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này tăng 5,5% so với phiên liền trước, đạt 295.851 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 294.696 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 3 với 569 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 2.369 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1054,69 điểm (cao hơn 5,69 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1056 điểm (+11 điểm), VN30F2306 là 1058,09 điểm (+11,29 điểm) và VN30F2309 là 1061,77 điểm (+18,39 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1049.0	53.00	294,696	22.4	43,651	
VN30F2304	1045.0	45.00	986	-97.51	230	
VN30F2306	1046.8	15.00	120	100.0	1,052	
VN30F2309	1041.5	83.00	49	-42.35	225	
Tổng			295,851	5.5	45,158	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1034-1038	1022-1035	992-1000
Kháng cự	1056-1060	1072-1080	1100-1105

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

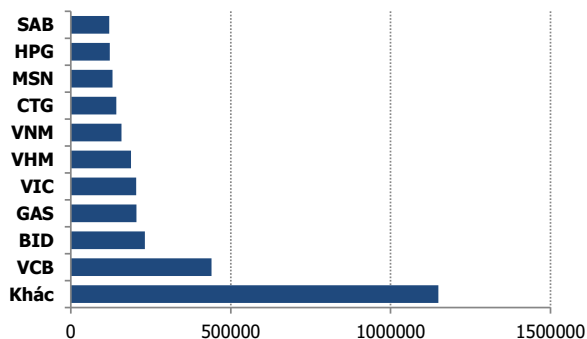


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1059.31	1053.72
Thay đổi	1.02	-1.54
%Chg	0.10	-0.15
YTD	5.19	4.83
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,228.00	3,092.28
P/E	13.77	11.07
P/B	1.68	1.63

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính đánh mất sắc xanh. Số mã giảm điểm (18) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (9) và 3 mã đứng tham chiếu, trong đó MSN và HPG trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -1,07 điểm và -1 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 1,54 điểm (-0,15%) xuống 1.053,72 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 140,7 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.179 tỷ đồng.
- Khối ngoại bán ròng phiên thứ 3 liên tiếp với 2,17 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như STB (-36 tỷ đồng), HPG (-27 tỷ đồng), DXG (-21 tỷ đồng), CTG (-17 tỷ đồng), SHB (-16 tỷ đồng).

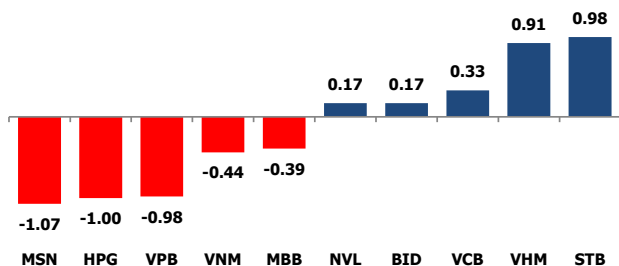
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 MSN, HPG và VPB là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, MSN gây ảnh hưởng -1,07 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐÒ THỊ KỸ THUẬT MSN

Phân tích kỹ thuật MSN



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	17,300	-1.14	1.74%	186.559	-0.98	6.32	1.23
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	81,600	0.00	0.74%	37.965	0.00	16.99	4.50
ACB	Banks	24,800	0.00	1.63%	42.497	0.00	6.32	1.50
HPG	Metals & Mining	21,000	-1.41	1.67%	259.668	-1.00	7.89	1.25
TCB	Banks	27,800	-0.36	1.09%	49.367	-0.24	4.60	0.90
VNM	Food Products	76,000	-0.65	1.46%	59.017	-0.44	20.12	5.10
MSN	Food Products	91,300	-1.72	2.09%	25.636	-1.07	13.54	5.07
VIC	Real Estate Management & Development	53,500	0.19	2.49%	99.354	0.10	184.58	1.80
VCB	Banks	93,000	0.65	1.41%	85.367	0.33	16.65	3.43
MWG	Specialty Retail	43,250	-0.12	1.05%	41.274	-0.06	12.34	2.72
VHM	Real Estate Management & Development	43,300	1.88	2.59%	89.194	0.91	6.00	1.39
STB	Banks	24,400	2.09	2.26%	441.998	0.98	11.09	1.25
MBB	Banks	18,100	-0.82	1.66%	87.554	-0.39	4.67	1.13
HDB	Banks	18,450	-0.27	1.93%	36.538	-0.09	6.14	1.32
VJC	Airlines	102,600	-0.19	1.68%	21.893	-0.06	898.64	3.17
VRE	Real Estate Management & Development	28,400	0.00	2.32%	36.367	0.00	31.24	1.98
VIB	#N/A	21,500	2.87	2.38%	80.633	#N/A	5.36	1.39
TPB	Banks	23,850	-0.63	1.69%	106.315	-0.15	6.23	1.23
CTG	Banks	29,650	-0.17	1.70%	66.296	-0.04	9.15	1.35
SSI	Capital Markets	19,450	-0.26	2.34%	156.377	-0.05	8.63	1.32
SAB	Food Products	187,100	-1.37	1.82%	8.498	-0.19	22.20	4.92
NVL	Real Estate Management & Development	11,650	1.30	9.38%	275.969	0.17	7.96	0.61
GAS	Gas Utilities	107,200	-0.65	1.12%	19.978	-0.07	15.38	3.62
BID	Banks	45,800	1.78	1.89%	67.988	0.17	14.31	2.41
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,400	0.40	2.46%	99.158	0.03	24.86	0.98
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,600	-1.03	1.81%	16.197	-0.05	52.33	2.11
BVH	Beverages	50,400	0.60	2.50%	38.583	0.02	21.36	1.68
BCM	#N/A	84,900	-0.12	1.31%	6.422	#N/A	51.32	5.02
PDR	Capital Markets	10,950	-0.45	4.59%	75.542	-0.02	3.38	0.87
GVR	Real Estate Management & Development	14,700	-0.34	2.74%	17.002	-0.01	13.84	1.17

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.