

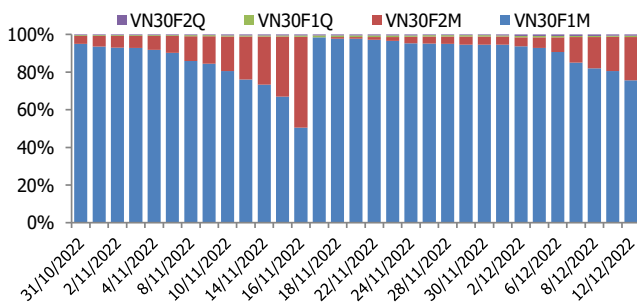
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2212	15/12/2022	2	1058,00	37.331
VN30F2301	19/1/2023	37	1053,60	18.644
VN30F2303	16/3/2023	93	1046,00	339
VN30F2306	15/6/2023	184	1034,90	418

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	1.047,45	1,49	10,80	(29,48)
Dow Jones	34.108,64	0,30	19,57	(6,14)
S&P500	4.019,65	0,73	19,28	(15,66)
Nikkei 225	28.079,50	0,28	18,93	(2,68)
Shanghai	3.174,53	(0,06)	14,27	(12,73)
DAX	14.497,89	1,34	13,36	(8,73)
Vàng	1.810,98	1,70		0,10
Dầu WTI	75,39	3,00		1,76

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Anh - Thay đổi GDP (3T/3T)	12/12	-0,2%	-0,3%
Mỹ - CPI lõi (tháng/tháng) (T11)	13/12	0,3%	0,2%
Mỹ - Quyết định lãi suất	14/12	4,00%	
Mỹ - Chi số Fed Philadelphia (T12)	15/12	-19,4	
Châu Âu - CPI (năm/năm) (T11)	16/12	10,0%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

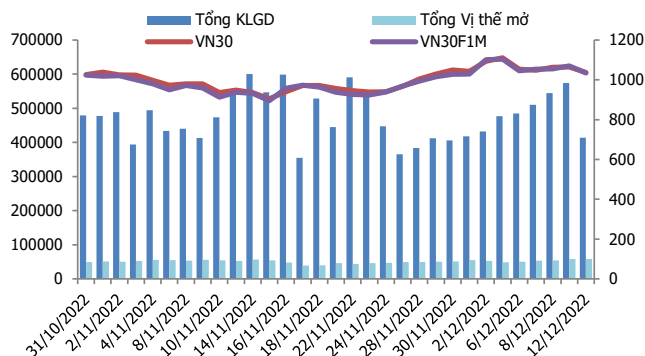
- Lực kéo khá mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã giúp thị trường lội ngược dòng ngoạn mục. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 14,2 đến 24 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 19,01 điểm. Basis của các HĐTL phiên này cải thiện hơn và ghi nhận mức từ -16,72 đến -2,22 điểm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư đã thay đổi tích cực hơn trước một phiên tăng điểm khả quan.
- Thị trường trong nước có phiên ngược dòng thành công và nổi lại đà hồi phục sau 3 phiên điều chỉnh liên tiếp. Thanh khoản thị trường tiếp tục ở mức thấp dù thị trường có những nhịp rung lắc mạnh cho thấy lực cầu thận trọng trong khi người bán cũng không muốn hạ giá thêm. Nhóm cổ phiếu ngân hàng, chứng khoán, bất động sản nhỏ, ... xuất hiện nhiều mã tăng trần cho thấy dòng tiền đầu cơ tiếp tục gia tăng, đây có thể là tín hiệu đáng chú ý nhất giúp thị trường duy trì đà hồi phục.
- Thị trường lội ngược dòng ngoạn mục về cuối phiên và duy trì đà hồi phục, tuy nhiên ưu thế vẫn chưa nghiêng hẳn về bên mua hay bên bán. Theo đó, nên ưu tiên quan sát và chỉ nên hành động khi chạm ngưỡng kháng cự và hỗ trợ quan trọng.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Đóng cửa, chỉ số Dow Jones tăng 103,6 điểm (+0,3%) lên 34.108,64 điểm, S&P 500 tiến 0,73% lên 4.019,65 điểm, còn Nasdaq Composite cộng 1,01% lên 11.256,81 điểm. Đầu phiên, 3 chỉ số này tăng rất mạnh, với Dow Jones tăng 707 điểm trước khi hạ nhiệt trở lại, trong khi S&P 500 có lúc vọt 2,77% và Nasdaq tăng 3,84%.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1043-1050 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1040 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1074-1077 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1063-1066 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

- Lực kéo khá mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã giúp cả 4 HDTL lợi ngược dòng và đóng cửa tăng từ 14,2 đến 24 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 10,22% so với phiên liền trước, đạt 456.463 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 12 với 440.197 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 12 với 1.474 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 489 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2212 là 1.037,53 điểm (cao hơn 2,33 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2301 là 1.038,82 điểm (+6,82 điểm), VN30F2303 là 1.040,88 điểm (+18,88 điểm) và VN30F2306 là 1.044,23 điểm (+23,53 điểm).

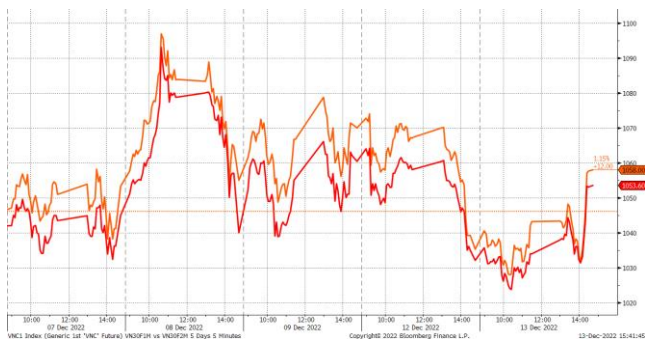
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGĐ	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1058,0	2,20	440.197	8,6	37.331	
VN30F2301	1053,6	2,10	15.813	88,77	18.644	
VN30F2303	1046,0	2,30	207	-10,4	339	
VN30F2306	1034,9	1,40	246	106,72	418	
Tổng			456.463	-20,5	56.732	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	BUY
Hỗ trợ	1052-1055	1049-1052	1043-1050
Kháng cự	1063-1066	1068-1070	1074-1077

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

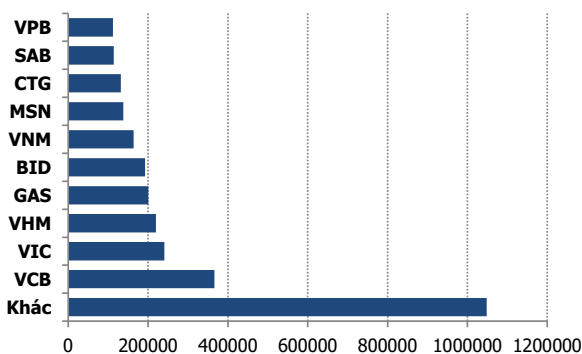


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1047,45	1056,43
Thay đổi	15,38	19,01
%Chg	1,49	1,83
YTD	-29,48	-31,72
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4.119,47	2.928,78
P/E	10,80	8,89
P/B	1,65	1,64

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính hồi phục tích cực. Số mã tăng điểm (24) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (4) và 2 mã đứng tham chiếu. TCB và VHM trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +3,97 điểm và +2,93 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 19,01 điểm (+1,83%) lên 1.056,43 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 256,58 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 6.038 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 27 liên tiếp với 933,98 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như NVL (+159 tỷ đồng), VHM (+109 tỷ đồng), VND (+86 tỷ đồng), SSI (+63 tỷ đồng), HPG (+63 tỷ đồng).

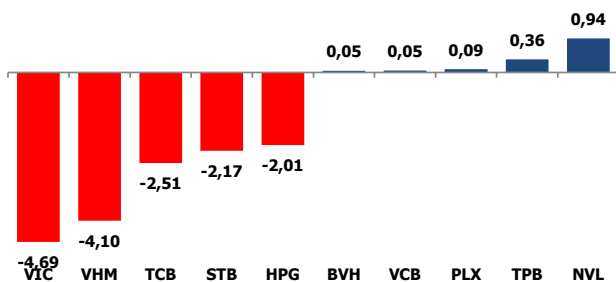
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 TCB, VHM và STB là những nhân tố chính đưa chỉ số VN30 quay lại đà tăng điểm. Trong đó, TCB đóng góp +3,97 điểm cho 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	16.650	-1,48	4,80%	396,224	-1,14	5,56	1,18
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	77.000	-1,28	2,36%	93,842	-0,98	16,03	4,25
VNM	Food Products	78.500	-1,88	4,46%	248,809	-1,31	20,78	5,27
ACB	Banks	22.500	-2,39	3,56%	72,887	-1,65	5,74	1,36
MSN	Food Products	97.000	0,00	4,17%	88,483	0,00	14,38	5,38
TCB	Banks	27.200	-3,72	4,96%	173,387	-2,51	4,50	0,88
VIC	Real Estate Management & Development	63.100	-6,93	7,77%	187,792	-4,69	217,70	2,12
HPG	Metals & Mining	18.600	-3,13	5,11%	684,278	-2,01	6,99	1,10
VHM	Real Estate Management & Development	50.500	-6,65	7,33%	201,932	-4,10	6,99	1,62
MWG	Specialty Retail	45.900	-0,65	5,11%	161,252	-0,34	13,10	2,88
MBB	Banks	17.700	-2,75	4,25%	225,9	-1,30	4,57	1,11
VCB	Banks	77.400	0,13	4,01%	166,543	0,05	13,86	2,86
STB	Banks	21.300	-4,91	6,10%	459,045	-2,17	9,68	1,09
VJC	Airlines	111.400	-0,09	3,10%	52,002	-0,03	975,71	3,45
HDB	Banks	16.200	-3,57	5,86%	63,981	-1,11	5,39	1,16
VRE	Real Estate Management & Development	27.050	-6,40	10,72%	91,062	-1,76	29,76	1,89
VIB	#N/A	20.350	-2,86	4,93%	97,157	#N/A	5,11	1,41
SSI	Capital Markets	19.150	-5,43	8,64%	530,732	-1,20	8,50	1,30
TPB	Banks	22.900	1,78	4,04%	331,247	0,36	5,98	1,18
CTG	Banks	27.450	-2,14	2,73%	107,007	-0,45	8,48	1,25
NVL	Real Estate Management & Development	17.800	6,91	0,00%	124,402	0,94	12,15	0,93
KDH	Real Estate Management & Development	27.950	-6,99	7,33%	106,205	-1,02	15,65	1,75
SAB	Food Products	178.300	0,17	1,07%	42,172	0,02	21,16	4,69
GAS	Gas Utilities	105.000	-0,94	3,24%	37,398	-0,10	15,07	3,55
BID	Banks	38.100	-2,81	4,72%	77,296	-0,23	11,90	2,00
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11.150	-0,45	3,59%	108,416	-0,02	22,36	0,88
PDR	Capital Markets	15.500	-6,06	11,94%	275,856	-0,28	4,79	1,24
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31.100	2,30	3,62%	26,768	0,09	42,16	1,70
BVH	Beverages	48.500	1,25	2,83%	36,874	0,05	20,56	1,62
GVR	Real Estate Management & Development	14.800	-1,66	6,42%	39,829	-0,04	13,93	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 cửa 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.