

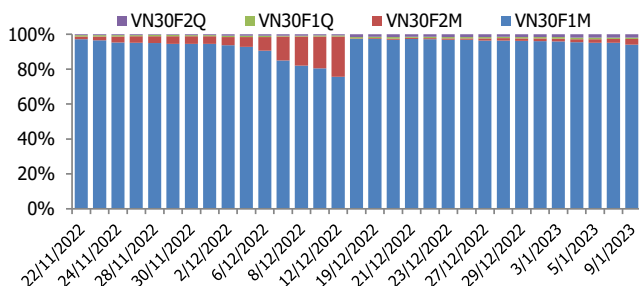
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	10	1053.60	48,350
VN30F2302	16/2/2023	38	1046.70	1,668
VN30F2306	15/6/2023	157	1040.20	442
VN30F2309	21/9/2023	255	1031.00	969

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	1,054.21	0.26	10.99	4.68
Dow Jones	33,517.65	(0.34)	19.34	1.12
S&P500	3,892.09	(0.08)	18.84	1.37
Nikkei 225	26,204.28	0.89	17.73	0.42
Shanghai	3,172.68	(0.11)	14.35	2.70
DAX	14,792.83	1.25	13.68	6.24
Vàng	1,874.99	0.17		2.79
Dầu WTI	74.65	0.03		(6.99)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Úc - Doanh số bán lẻ (T11)	11/1	-0.2%	
Mỹ - Dự trữ dầu thô	11/1	1.694M	
Mỹ - CPI lõi (T12)	12/1	0.2%	
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	12/1	204K	
Anh - Sản lượng sản xuất (T11)	13/1	0.7%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

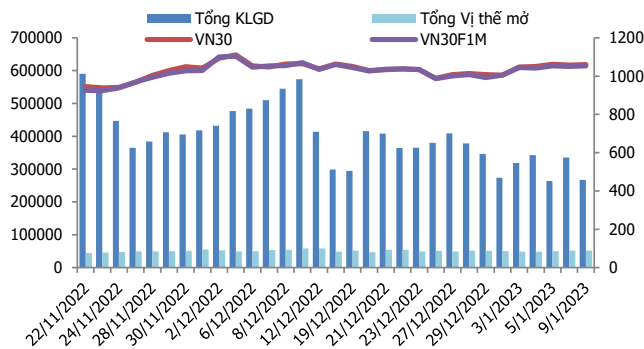
- Thị trường phái sinh hồi phục nhờ ưu thế nghiêng về bên mua xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 0,7 đến 5,1 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 3,74 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này sụt giảm xuống mức -7,54, cho thấy tâm lý nhà đầu tư hiện vẫn đang khá thận trọng trước các diễn biến của thị trường khi chưa thực sự xác định được một xu hướng đi lên rõ ràng.
- Chỉ số VNI đã có 3 phiên đi ngang và được neo giữ bởi nhóm bluechips, trong đó nổi bật là nhóm ngân hàng. Thị trường đi vào phân hóa chủ yếu tập trung ở nhóm midcap và smallcap, cả 2 nhóm này đã điều chỉnh giảm sang phiên thứ 2 liên tiếp. Do vậy, nhà đầu tư nên tập trung ở nhóm cổ phiếu trụ khi báo cáo kết quả kinh doanh quý 4/2022 được công bố nhiều hơn trong tuần này.
- Thị trường phái sinh tiếp tục duy trì sắc xanh tích cực sau tuần tăng điểm đầu năm, với tín hiệu khả quan nằm ở việc thanh khoản giảm thấp. Tuy nhiên, nhà đầu tư vẫn nên thận trọng đôi chút khi các tín hiệu xác nhận một xu hướng tăng điểm chắc chắn vẫn chưa thực sự rõ ràng.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chỉ số Nasdaq Composite tiến 66,36 điểm (+0,6%) lên 10.635,65 điểm. Trong khi đó, chỉ số Dow Jones mất 112,96 điểm (-0,3%) còn 33.517,65 điểm, khi các cổ phiếu dược như Merck và Johnson & Johnson gây áp lực lên chỉ số này. Chỉ số S&P 500 lùi 2,99 điểm (-0,1%) xuống 3.892,09 điểm, nhưng đã tăng 1,1% của lĩnh vực công nghệ thông tin đã giúp xoá bớt mức giảm của chỉ số này.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

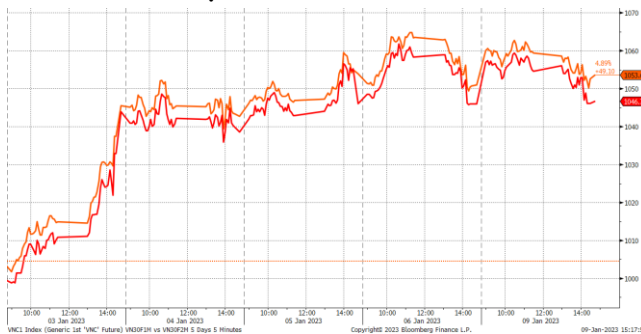
Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1042-1047 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1031 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1068-1071 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1058-1064 điểm.
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
VN30F2212	1053.6	75.00	266,050	-20.3	48,350	
VN30F2301	1046.7	133.00	1,269	36.31	1,668	
VN30F2303	1040.2	34.00	97	-4.9	442	
VN30F2306	1031.0	45.00	112	53.42	969	
Tổng			267,528	-20.1	51,429	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HĐTL

- Ưu thế nghiêng về bên mua xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã giúp cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 0,7 đến 5,1 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 20,1% so với phiên liền trước, đạt 267.528 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 1 với 266.050 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 1 với 1664 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 18.802 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1061,52 điểm (cao hơn 7,92 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1062,57 điểm (+15,87 điểm), VN30F2303 là 1067,05 điểm (+26,85 điểm) và VN30F2306 là 1070,76 điểm (+39,76 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	BUY	SELL
Hỗ trợ	1042-1047	1030-1038	1017-1024
Kháng cự	1058-1064	1068-1071	1080-1086

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

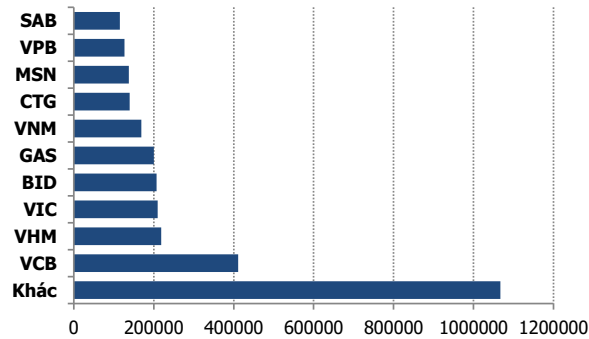


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1054.21	1061.14
Thay đổi	2.77	3.74
% Chg	0.26	0.35
YTD	4.68	5.57
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,205.09	3,001.58
P/E	10.99	9.10
P/B	1.68	1.68

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính hồi phục nhẹ. Số mã tăng điểm (16) áp đảo so với số mã giảm điểm (10) và 4 mã đứng tham chiếu, trong đó VCB và VNM trở thành hai trụ đóng góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +1,58 điểm và +0,79 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 3,74 điểm (+0,35%) lên 1.061,14 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 155,96 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.782 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 11 liên tiếp với 555,91 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+88 tỷ đồng), CTG (+47 tỷ đồng), FUEVFNVD (+43 tỷ đồng), FUESSVFL (+39 tỷ đồng), VCI (+38 tỷ đồng).

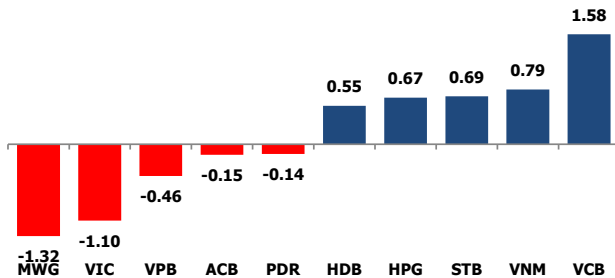
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VCB, VNM và STB là những nhân tố chính đưa chỉ số VN30 quay lại đà tăng điểm. Trong đó, VCB đóng góp +1,58 điểm cho chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VCB

Phân tích kỹ thuật VCB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18,850	-0.53	2.66%	357.355	-0.46	6.29	1.34
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,300	0.00	1.25%	41.608	0.00	16.72	4.43
VNM	Food Products	80,700	1.13	1.38%	75.949	0.79	21.36	5.42
ACB	Banks	23,100	-0.22	1.74%	40.388	-0.15	5.89	1.40
TCB	Banks	27,750	0.18	1.27%	66.329	0.12	4.59	0.90
HPG	Metals & Mining	19,600	1.03	3.08%	319.92	0.67	7.36	1.16
MSN	Food Products	96,500	0.73	1.88%	38.393	0.47	14.31	5.36
VHM	Real Estate Management & Development	50,200	0.60	1.61%	59.973	0.34	6.95	1.61
VIC	Real Estate Management & Development	55,000	-1.96	2.18%	66.948	-1.10	189.75	1.85
STB	Banks	24,650	1.44	3.31%	326.229	0.69	11.20	1.26
MWG	Specialty Retail	42,000	-2.67	3.10%	113.344	-1.32	11.99	2.64
MBB	Banks	18,250	0.00	1.65%	109.152	0.00	4.71	1.14
VCB	Banks	86,900	3.45	2.48%	142.861	1.58	15.56	3.21
VJC	Airlines	109,200	1.30	1.11%	42.202	0.40	956.44	3.38
HDB	Banks	16,750	1.82	1.81%	20.356	0.55	5.58	1.20
VRE	Real Estate Management & Development	29,400	0.51	2.07%	34.788	0.14	32.34	2.05
VIB	#N/A	21,150	2.67	4.09%	96.938	#N/A	5.31	1.46
CTG	Banks	29,100	1.75	1.39%	123.264	0.38	8.98	1.33
SSI	Capital Markets	19,000	0.53	2.65%	185.419	0.11	8.43	1.29
TPB	Banks	22,500	0.00	2.91%	94.106	0.00	5.88	1.16
KDH	Real Estate Management & Development	27,950	0.54	2.33%	73.969	0.07	15.65	1.75
SAB	Food Products	179,600	-0.61	3.53%	8.433	-0.08	21.31	4.73
NVL	Real Estate Management & Development	13,850	1.84	4.01%	139.29	0.20	9.46	0.72
GAS	Gas Utilities	104,500	-0.19	1.54%	16.033	-0.02	15.00	3.53
BID	Banks	41,000	-1.56	3.30%	54.901	-0.14	12.81	2.15
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,600	-1.28	5.26%	100.836	-0.07	23.26	0.92
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	35,500	1.14	2.88%	19.224	0.05	48.13	1.94
PDR	Capital Markets	14,250	-3.39	6.38%	127.131	-0.14	4.40	1.14
BVH	Beverages	47,900	-0.31	1.57%	9.043	-0.01	20.30	1.60
GVR	Real Estate Management & Development	14,400	0.00	3.89%	25.066	0.00	13.56	1.14

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.