

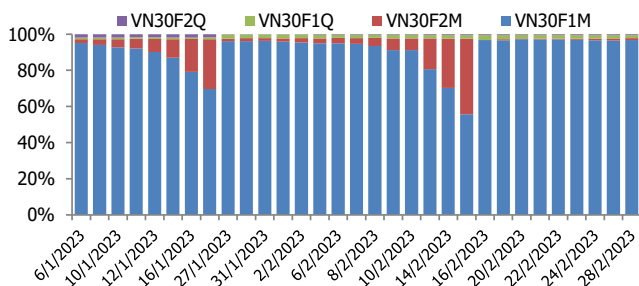
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	16	1008.00	58,783
VN30F2304	20/4/2023	51	1006.60	634
VN30F2306	15/6/2023	107	1003.70	1,025
VN30F2309	21/9/2023	205	1003.00	273

TỶ TRỌNG VỊ THỂ MỞ GIỮA CÁC KỲ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	%Chg	P/E	YTD
VNIndex	1,024.68	0.34	13.32	1.75
Dow Jones	32,656.70	(0.71)	19.14	(1.48)
S&P500	3,970.15	(0.30)	18.97	3.40
Nikkei 225	27,386.39	(0.22)	22.53	4.95
Shanghai	3,275.33	(0.13)	14.32	6.02
DAX	15,365.14	(0.11)	12.42	10.35
Vàng	1,826.47	(0.02)		0.13
Dầu WTI	76.89	(0.21)		(4.20)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - Đơn đặt hàng hoá lâu bền lõi	27/2	-0.4%	0.7%
Mỹ - Niềm tin tiêu dùng của CB (T2)	28/2	106.0	102.9
Mỹ - PMI sản xuất của ISM (T2)	1/3	47.4	
Châu Âu - CPI (Tháng 2)	2/3	8.6%	
Mỹ - PMI phi sản xuất của ISM (T2)	3/3	55.2	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

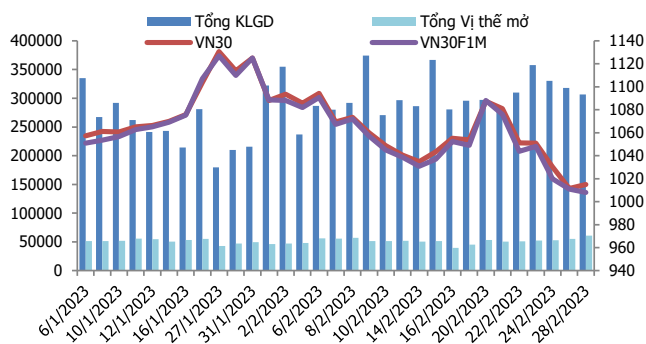
- Thị trường phái sinh bật tăng ngay từ khi mở cửa, tuy nhiên sau đó đã gặp áp lực bán mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên, với các HĐTL dao động từ -6,2 đến +2 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 3,5 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này sụt giảm mạnh xuống mức âm 6,96 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang ở trong trạng thái tâm lý thận trọng khi thị trường có vẻ như vẫn chưa ra khỏi vùng điều chỉnh.
- Nhịp giảm của thị trường cơ sở bị chặn ngang nhưng dòng tiền không hào hứng, phiên sáng chỉ số tăng thì thanh khoản thấp, sang phiên chiều thị trường chịu áp lực bán cắt lỗ thanh khoản mới tăng, về tổng thể thì đây vẫn là phiên có mức thanh khoản thấp nhất kể từ đầu năm cho thấy nhịp giảm ngắn hạn của thị trường vẫn có thể tiếp diễn để tìm lực cầu bắt đáy. Do vậy, nhà đầu tư tránh mua đuổi trong các nhịp tăng, trading với tỷ trọng cổ phiếu thấp khi thanh khoản đang ở mức thấp.
- Thị trường phái sinh tiếp tục có thêm một phiên điều chỉnh, cùng với việc basis vẫn ở mức âm, cho thấy nhà đầu tư đang duy trì trạng thái tâm lý thận trọng trước các nhịp giảm điểm liên tiếp của thị trường. Nhà đầu tư cần cẩn trọng quan sát, có thể cân nhắc mở vị thế mua ở các nhịp điều chỉnh trong phiên.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm điểm để khép lại một tháng đầy khó khăn đối với thị trường chứng khoán. Kết phiên, chỉ số Dow Jones rớt 232,39 điểm (-0,7%) xuống 32.656,70 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 0,3% còn 3.970,15 điểm và chỉ số Nasdaq Composite lùi 0,1% xuống 11.455,54 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1000-1003 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 973 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1044-1050 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1030-1033 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 về cuối phiên giao dịch hôm nay đã khiến các HĐTL đóng cửa dao động từ -6,2 đến +2 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 3,51% so với phiên liền trước, đạt 306.702 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 3 với 306.067 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 3 với 1.066 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 456 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1015,5 điểm (cao hơn 7,5 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1016,76 điểm (+10,16 điểm), VN30F2306 là 1018,77 điểm (+15,07 điểm) và VN30F2309 là 1022,31 điểm (+19,31 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1008.0	16.00	306,067	-3.4	58,783	
VN30F2304	1006.6	47.00	451	-28.64	634	
VN30F2306	1003.7	41.00	92	-58.0	1,025	
VN30F2309	1003.0	26.00	92	-26.98	273	
Tổng			306,702	-3.5	60,715	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1000-1003	980-990	960-975
Kháng cự	1030-1033	1044-1050	1060-1075

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

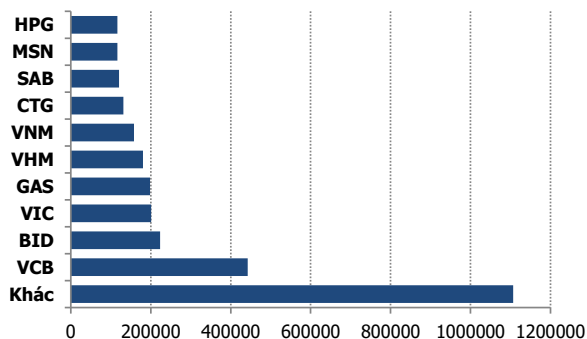


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1024.68	1014.96
Thay đổi	3.43	3.50
%Chg	0.34	0.35
YTD	1.75	0.97
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,090.95	2,994.64
P/E	13.32	10.67
P/B	1.62	1.57

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 (18) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (8) và 4 mã đứng tham chiếu, trong đó MSN và VRE trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +1,4 điểm và +0,9 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 3,5 điểm (+0,35%) lên 1.014,96 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 105,69 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 2.403 tỷ đồng.
- Khối ngoại bán ròng phiên thứ 10 liên tiếp với 431,72 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như HPG (-51 tỷ đồng), DXG (-28 tỷ đồng), E1VFN30 (-20 tỷ đồng), KDC (-14 tỷ đồng), NLG (-12 tỷ đồng).

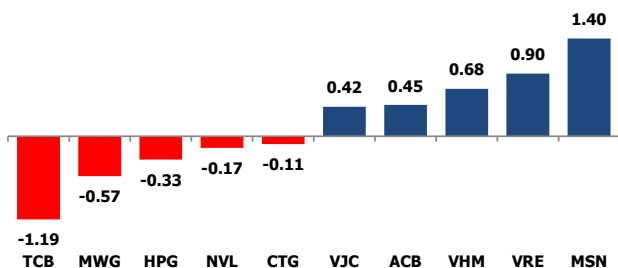
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

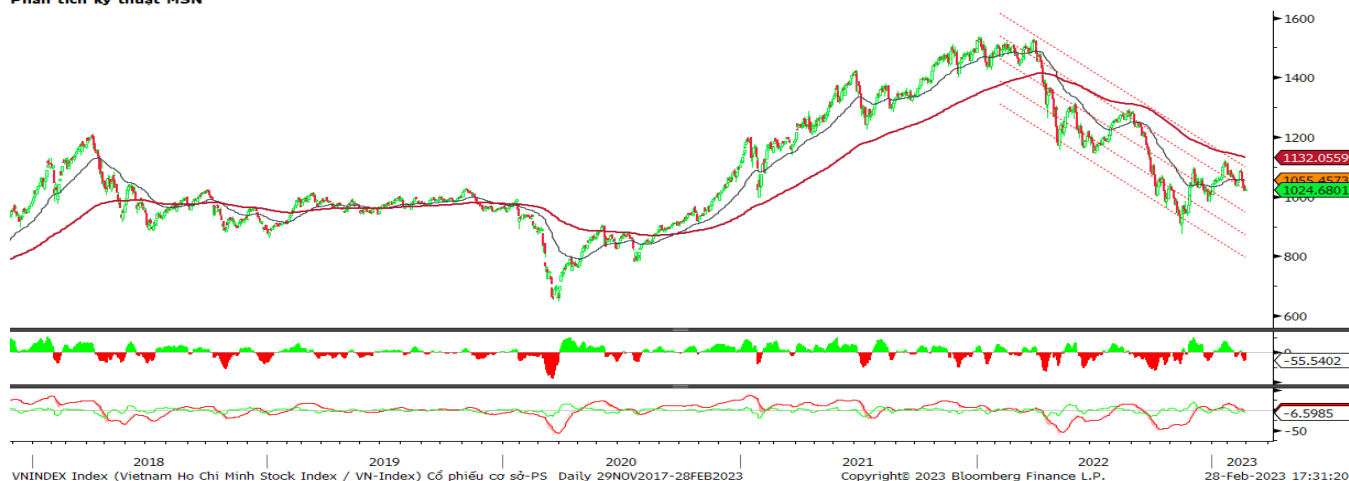
- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 MSN, VRE và VHM là những nhân tố chính đưa chỉ số VN30 quay lại đà tăng điểm. Trong đó, MSN đóng góp +1,4 điểm cho chỉ số VN30.

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	17,050	0.29	2.07%	147.511	0.25	6.23	1.21
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,500	0.25	1.51%	42.033	0.19	16.76	4.44
ACB	Banks	24,400	0.62	2.06%	149.929	0.45	6.22	1.48
HPG	Metals & Mining	20,000	-0.50	3.02%	307.31	-0.33	7.51	1.19
VNM	Food Products	75,500	0.40	1.07%	78.109	0.26	20.79	5.29
TCB	Banks	26,500	-1.85	2.64%	56.483	-1.19	4.39	0.86
MSN	Food Products	82,000	2.63	3.13%	47.743	1.40	12.16	4.55
VIC	Real Estate Management & Development	52,600	0.19	1.92%	47.939	0.10	181.47	1.77
VCB	Banks	93,500	0.75	1.19%	52.798	0.38	16.74	3.45
VHM	Real Estate Management & Development	41,500	1.47	3.84%	67.138	0.68	5.75	1.33
STB	Banks	23,750	0.64	1.69%	153.616	0.30	10.80	1.21
MWG	Specialty Retail	40,000	-1.23	3.39%	63.235	-0.57	11.42	2.51
MBB	Banks	17,250	0.00	2.92%	106.746	0.00	4.45	1.08
HDB	Banks	17,050	0.89	2.65%	21.099	0.28	5.68	1.22
VJC	Airlines	100,000	1.52	3.09%	31.408	0.42	875.86	3.09
VRE	Real Estate Management & Development	26,700	3.69	5.56%	81.069	0.90	29.37	1.86
TPB	Banks	23,300	0.22	1.29%	49.134	0.05	6.09	1.20
VIB	#N/A	20,550	0.00	2.20%	27.783	#N/A	5.12	1.33
CTG	Banks	27,400	-0.54	2.19%	35.358	-0.11	8.46	1.25
SSI	Capital Markets	18,250	0.00	3.02%	219.391	0.00	8.10	1.23
SAB	Food Products	188,000	1.46	2.59%	18.308	0.20	22.31	4.95
NVL	Real Estate Management & Development	10,600	-1.40	3.77%	76.93	-0.17	7.24	0.55
GAS	Gas Utilities	103,500	-0.48	1.93%	7.647	-0.05	14.85	3.50
BID	Banks	44,100	-0.34	1.25%	11.415	-0.03	13.78	2.32
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,100	0.83	2.08%	61.877	0.06	24.26	0.96
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	37,300	0.67	1.75%	8.992	0.03	50.57	2.03
BVH	Beverages	48,500	0.62	1.66%	7.958	0.02	20.56	1.62
BCM	#N/A	83,700	0.36	1.69%	3.325	#N/A	50.60	4.95
PDR	Capital Markets	10,100	-0.98	4.81%	28.135	-0.03	3.12	0.80
GVR	Real Estate Management & Development	13,950	0.00	3.25%	12.643	0.00	13.13	1.11

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.