

BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



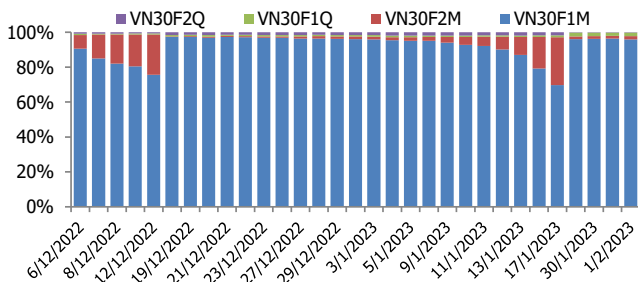
DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

- Thị trường gặp áp lực chốt lời mạnh xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 35,4 đến 38,6 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 36,98 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục cải thiện lên mức +0,41 điểm, cho thấy nhà đầu tư không rơi vào trạng thái tâm lý bi quan trước các nhịp điều chỉnh của thị trường.
- Với phiên giảm này chỉ số Vn-Index vẫn chưa thể vượt qua đỉnh tháng 12 và có thể kiểm tra lại vùng hỗ trợ 1.061 -1.063 điểm trong phiên ngày mai, trong trường hợp vùng hỗ trợ này bị xuyên thủng, nhà đầu tư cần thận trọng. Chỉ số Vn-index đã tăng hơn 14% kể từ cuối năm ngoái, tuy chỉ điều chỉnh 4,5% kể từ mức đỉnh 1.124,3 điểm nhưng mặt bằng cổ phiếu sẽ giảm nhiều hơn.
- Thị trường phái sinh có một phiên giảm điểm mạnh với áp lực bán lớn trên diện rộng. Có thể thị trường đang chiết khấu cho rủi ro nội tại hơn là ảnh hưởng từ chứng khoán thế giới. Do đó, nhà đầu tư nên thận trọng, có thể mở vị thế mua ở các nhịp điều chỉnh trong phiên với mục tiêu giao dịch ở mức 1073-1080 điểm.

THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	15	1088.50	44,155
VN30F2303	16/3/2023	43	1085.00	863
VN30F2306	15/6/2023	134	1074.20	937
VN30F2309	21/9/2023	232	1065.50	112

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	1,075.97	(3.17)	13.70	6.84
Dow Jones	34,092.96	0.02	19.12	2.85
S&P500	4,119.21	1.05	19.52	7.29
Nikkei 225	27,410.94	0.23	21.57	5.04
Shanghai	3,284.92	0.90	14.35	6.33
DAX	15,180.74	0.35	12.40	9.03
Vàng	1,955.09	0.23		7.19
Dầu WTI	76.95	0.71		(4.12)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

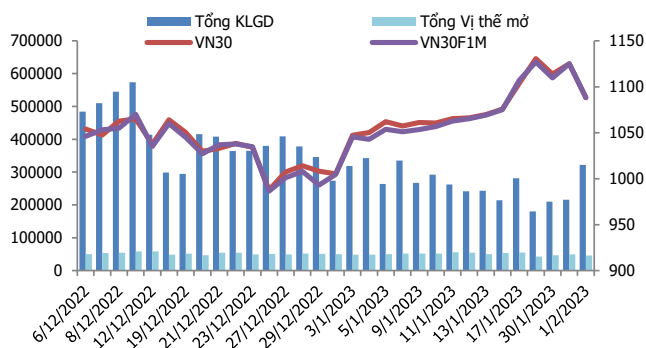
Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Đức - GDP (Quý 4)	30/1	0.5%	-0.2%
Mỹ - Niềm tin tiêu dùng của CB (T1)	31/1	109.0	107.1
Mỹ - Quyết định lãi suất	1/2	4.50%	4.75%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	2/2	186K	
Mỹ - Tỷ lệ thất nghiệp (T1)	3/2	3.5%	

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Kết phiên, chỉ số S&P 500 tiến 1,05% lên 4.119,21 điểm, đảo chiều từ mức giảm gần 1% trước đó. Chỉ số Nasdaq Composite cộng 2% lên 11.816,32 điểm, được thúc đẩy bởi đà tăng của cổ phiếu các nhà sản xuất con chip sau báo cáo lợi nhuận mạnh mẽ từ Advanced Micro Devices. Trong khi đó, chỉ số Dow Jones nhích 6,92 điểm (+0,02%) lên 34.092,96 điểm – sau khi sụt hơn 500 điểm tại mức đáy trong phiên.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1073-1080 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1066 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1111-1117 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1100-1106 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 HĐTL

- Áp lực chốt lời mạnh xuyên suốt phiên giao dịch hôm nay đã khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 35,4 đến 38,6 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 49,34% so với phiên liền trước, đạt 322.337 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 2 với 321.317 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 2 với 2.305 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 12.808 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1088,67 điểm (cao hơn 0,17 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1089,75 điểm (+4,75 điểm), VN30F2306 là 1093,26 điểm (+19,06 điểm) và VN30F2309 là 1097,06 điểm (+31,56 điểm).

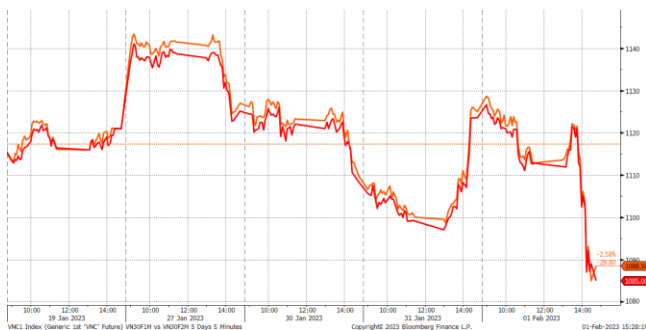
DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1088.5	15.00	321,317	49.4	44,155	
VN30F2303	1085.0	7.00	812	38.57	863	
VN30F2306	1074.2	2.00	143	57.1	937	
VN30F2309	1065.5	5.00	65	-28.57	112	
Tổng			322,337	49.3	46,067	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	BUY
Hỗ trợ	1073-1080	1055-1062	1030-1040
Kháng cự	1100-1106	1111-1117	1120-1135

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

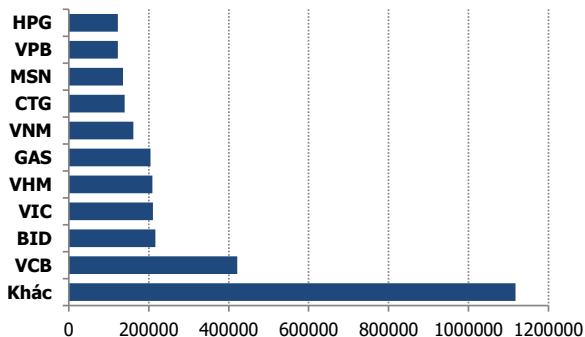


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1075.97	1088.09
Thay đổi	-35.21	-36.98
%Chg	-3.17	-3.29
YTD	6.84	8.25
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,294.31	3,061.08
P/E	13.70	11.26
P/B	1.76	1.64

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính chìm trong sắc đỏ. Số mã giảm điểm (23) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (7) và 0 mã đứng tham chiếu, trong đó VPB và MSN trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -5,25 điểm và -3,95 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 36,98 điểm (-3,29%) xuống 1.088,09 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 301,2 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 7.185 tỷ đồng.
- Khối ngoại quay lại mua ròng với 125,48 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+201 tỷ đồng), HCM (+48 tỷ đồng), HDB (+44 tỷ đồng), STB (+39 tỷ đồng), BID (+39 tỷ đồng).

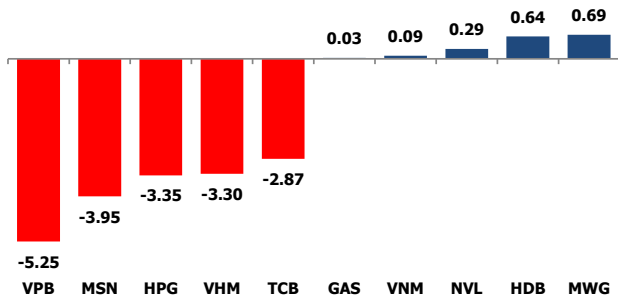
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

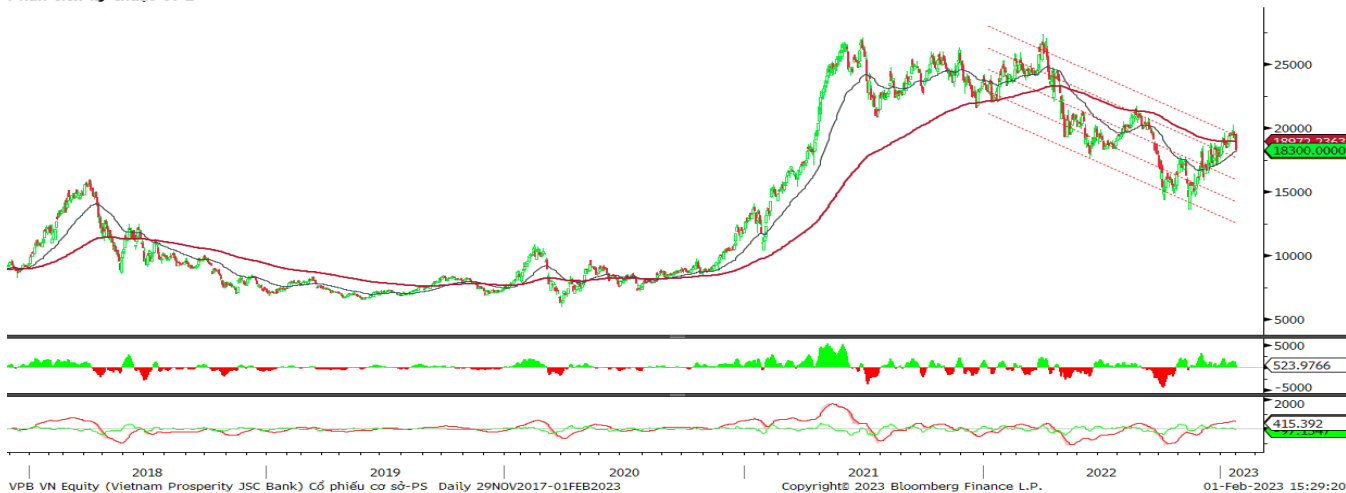
- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, MSN và HPG là những nguyên nhân chính đẩy chỉ số VN30 quay lại đà giảm điểm. Trong đó, VPB gây ảnh hưởng -5,25 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VPB

Phân tích kỹ thuật VPB



DANH MỤC CỔ PHIẾU TRONG VN30

Cổ phiếu	Ngành	Giá	% Chg	H-L	GTGD	Điểm tác động	PE	PB
VPB	Banks	18,300	-5.91	8.29%	612.86	-5.25	6.69	1.30
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	82,000	-1.80	2.69%	86.647	-1.46	17.07	4.52
ACB	Banks	25,200	-3.26	4.58%	89.436	-2.55	6.43	1.53
HPG	Metals & Mining	21,100	-4.52	7.86%	1144.677	-3.35	7.93	1.25
VNM	Food Products	77,200	0.13	1.17%	140.094	0.09	20.43	5.18
TCB	Banks	28,200	-4.08	5.36%	171.545	-2.87	4.67	0.91
MSN	Food Products	95,200	-5.84	7.05%	93.935	-3.95	14.12	5.28
VIC	Real Estate Management & Development	55,200	-3.33	5.11%	104.134	-1.90	190.44	1.86
VHM	Real Estate Management & Development	48,000	-5.70	6.04%	180.614	-3.30	6.65	1.54
MWG	Specialty Retail	47,100	1.29	3.17%	365.714	0.69	13.44	2.96
STB	Banks	25,650	-5.35	7.48%	428.592	-2.86	11.66	1.31
MBB	Banks	18,900	-3.32	5.56%	306.327	-1.70	4.88	1.18
VCB	Banks	89,100	-3.05	3.82%	103.525	-1.52	15.96	3.29
HDB	Banks	19,000	1.88	4.28%	103.981	0.64	6.32	1.36
VJC	Airlines	113,900	-2.06	4.50%	39.858	-0.68	997.61	3.52
VIB	#N/A	23,600	0.21	4.27%	201.336	#N/A	5.93	1.63
VRE	Real Estate Management & Development	28,000	-5.72	6.07%	55.173	-1.62	30.80	1.95
SSI	Capital Markets	20,150	-6.71	8.71%	560.125	-1.58	8.95	1.36
CTG	Banks	29,000	-4.92	7.54%	128.855	-1.13	8.95	1.32
TPB	Banks	23,700	-5.20	9.01%	357.897	-1.18	6.19	1.22
SAB	Food Products	187,000	-1.06	2.09%	32.202	-0.15	22.19	4.92
KDH	Real Estate Management & Development	26,500	-5.36	9.79%	79.186	-0.73	14.84	1.66
NVL	Real Estate Management & Development	14,550	2.46	5.94%	495.6	0.29	9.94	0.76
GAS	Gas Utilities	106,600	0.28	4.34%	79.379	0.03	15.30	3.60
BID	Banks	42,800	-5.10	6.81%	112.156	-0.49	13.37	2.25
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,950	-3.63	7.95%	195.425	-0.22	23.96	0.94
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	36,250	-1.49	4.72%	47.942	-0.07	49.15	1.98
PDR	Capital Markets	13,900	0.36	6.86%	274.438	0.01	4.29	1.11
BVH	Beverages	50,000	-0.79	4.44%	69.876	-0.03	21.19	1.67
GVR	Real Estate Management & Development	15,550	-6.89	8.68%	48.687	-0.19	14.64	1.23

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.