

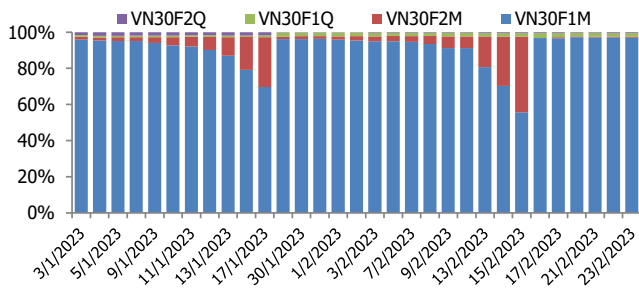
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2303	16/3/2023	21	1048.00	50,450
VN30F2304	20/4/2023	56	1045.00	371
VN30F2306	15/6/2023	112	1044.20	1,008
VN30F2309	21/9/2023	210	1040.10	248

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	1,053.66	(0.06)	13.67	4.62
Dow Jones	33,153.91	0.33	19.52	0.02
S&P500	4,012.32	0.53	19.21	4.50
Nikkei 225	27,432.59	1.21	22.25	5.13
Shanghai	3,287.48	(0.11)	14.36	6.42
DAX	15,475.69	0.49	12.51	11.15
Vàng	1,824.36	0.11		0.02
Dầu WTI	76.06	0.89		(5.23)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Trung Quốc - Lãi suất cho vay PBoC	20/2	3.65%	3.65%
Mỹ - Doanh số bán nhà hiện tại (T1)	21/2	4,03M	4,00M
Đức - CPI (năm/năm) (Tháng 2)	22/2	8.1%	8.7%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	23/2	195K	192K
Mỹ - Chỉ số giá PCE lõi (Tháng 1)	24/2	0.3%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

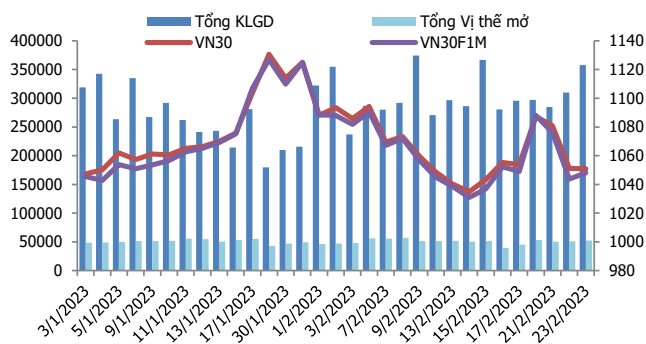
- Thị trường phái sinh hôm nay ngược dòng hồi phục về cuối phiên. Đóng cửa, 3/4 HĐTL tăng từ 1,3 đến 4,4 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 0,13 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này cải thiện nhưng vẫn ở mức âm 2,95 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang duy trì trạng thái tâm lý thận trọng khi thị trường có vẻ như vẫn chưa ra khỏi vùng điều chỉnh.
- Thị trường cơ sở tuy chưa có phiên ngược dòng trọn vẹn nhưng cũng đã tạo được hiệu ứng khá tích cực nhờ sự dẫn dắt từ nhóm cổ phiếu bluechips, trong đó nổi bật là nhóm cổ phiếu ngân hàng. Đà hồi phục khả năng còn tiếp diễn trong phiên ngày mai và các nhóm cổ phiếu được đẩy lên cuối phiên sẽ là nhóm cổ phiếu dẫn dắt.
- Thị trường phái sinh tạm hồi phục về cuối phiên nhờ lực kéo từ nhóm cổ phiếu trụ, tuy nhiên áp lực bán vẫn bao trùm chỉ số, cùng với việc basis vẫn ở mức âm cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái phòng thủ trước các nhịp dao động giảm co của thị trường trong giai đoạn này.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ khởi sắc khi nhà đầu tư vẫn lo ngại về lộ trình nâng lãi suất của Cục Dự trữ Liên bang Mỹ (Fed). Kết phiên, chỉ số S&P 500 tiến 0,53% lên 4.012,32 điểm, chấm dứt chuỗi 4 phiên giảm liên tiếp. Chỉ số Dow Jones tăng 108,82 điểm (+0,33%) lên 33.153,91 điểm. Chỉ số Nasdaq Composite cộng 0,72% lên 11.590,40 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1036-1040 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1021 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1080-1090 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1060-1074 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 mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã giúp 3/4 HDTL đóng cửa tăng từ 1,3 đến 4,4 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay tăng 15,44% so với phiên liền trước, đạt 357.579 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 3 với 356.692 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HDTL tháng 3 với 1.337 hợp đồng, lũy kế bán ròng khoảng 4.011 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2303 là 1051,73 điểm (cao hơn 3,73 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2304 là 1053,03 điểm (+8,03 điểm), VN30F2306 là 1055,12 điểm (+10,92 điểm) và VN30F2309 là 1058,79 điểm (+18,69 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2303	1048.0	6.00	356.692	15.4	50,450	
VN30F2304	1045.0	9.00	706	55.85	371	
VN30F2306	1044.2	16.00	87	20.8	1,008	
VN30F2309	1040.1	6.00	94	1.08	248	
Tổng			357,579	15.4	52,077	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	SELL
Hỗ trợ	1036-1040	1010-1022	991-1000
Kháng cự	1060-1074	1080-1090	1104-1120

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

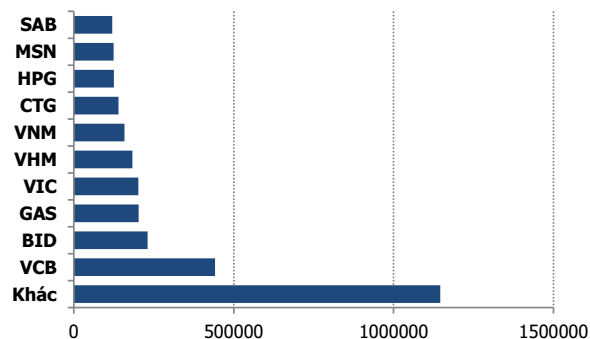


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1053.66	1050.95
Thay đổi	-0.62	-0.13
%Chg	-0.06	-0.01
YTD	4.62	4.55
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,202.94	3,072.96
P/E	13.67	11.04
P/B	1.67	1.62

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính khép phiên dưới mức tham chiếu đôi chút. Tuy nhiên, số mã tăng điểm (17) lại áp đảo so với số mã giảm điểm (11), trong đó MSN và VRE trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,27 điểm và -1,52 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 0,13 điểm (-0,01%) xuống 1.050,95 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 197,64 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 5.227 tỷ đồng.
- Khối ngoại bán ròng phiên thứ 7 liên tiếp với 674,66 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực bán tập trung ở các mã như FUEVFNVD (-83 tỷ đồng), VHM (-80 tỷ đồng), VRE (-79 tỷ đồng), VND (-39 tỷ đồng), HPG (-38 tỷ đồng).

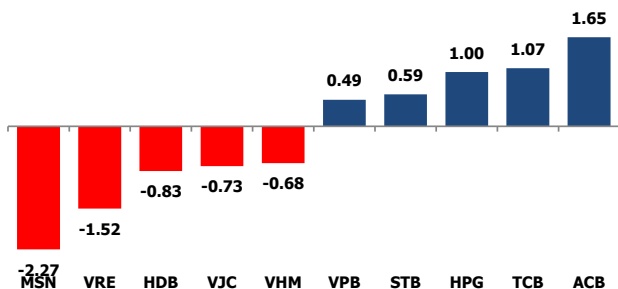
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 MSN, VRE và HDB là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 tiếp tục nằm trong đà giảm điểm. Trong đó, MSN gây ảnh hưởng -2,27 điểm tới chỉ số VN30.

CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



ĐỒ 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	17,550	0.57	2.63%	224.456	0.49	6.42	1.25
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	81,400	-0.49	1.36%	94.109	-0.39	16.95	4.49
ACB	Banks	25,400	2.21	5.15%	95.233	1.65	6.48	1.54
HPG	Metals & Mining	21,500	1.42	5.39%	701.036	1.00	8.08	1.28
TCB	Banks	27,950	1.64	3.52%	98.077	1.07	4.63	0.90
VNM	Food Products	75,700	0.26	3.36%	175.119	0.17	20.04	5.08
MSN	Food Products	87,600	-3.74	5.17%	60.15	-2.27	12.99	4.86
VIC	Real Estate Management & Development	53,000	0.00	3.91%	124.742	0.00	182.85	1.78
VCB	Banks	93,300	0.32	3.07%	94.951	0.16	16.71	3.44
MWG	Specialty Retail	43,000	0.00	2.38%	55.705	0.00	12.27	2.70
STB	Banks	25,000	1.21	3.95%	347.858	0.59	11.36	1.28
VHM	Real Estate Management & Development	42,000	-1.41	5.54%	191.605	-0.68	5.82	1.35
MBB	Banks	18,150	-0.55	2.82%	293.313	-0.26	4.68	1.13
HDB	Banks	18,050	-2.43	4.26%	53.617	-0.83	6.01	1.29
VJC	Airlines	98,200	-2.58	4.39%	58.898	-0.73	860.10	3.04
VRE	Real Estate Management & Development	26,500	-5.69	7.17%	127.874	-1.52	29.15	1.85
TPB	Banks	24,000	1.91	3.00%	107.203	0.45	6.27	1.24
VIB	#N/A	21,500	2.38	3.86%	64.859	#N/A	5.36	1.39
CTG	Banks	29,000	0.35	2.47%	116.679	0.08	8.95	1.32
SSI	Capital Markets	19,700	2.07	4.79%	344.08	0.44	8.75	1.33
SAB	Food Products	187,100	0.05	2.22%	14.465	0.01	22.20	4.92
NVL	Real Estate Management & Development	11,800	-1.67	6.25%	186.513	-0.22	8.06	0.62
GAS	Gas Utilities	105,800	-1.12	2.67%	18.514	-0.12	15.18	3.58
BID	Banks	45,550	1.22	4.23%	56.781	0.12	14.23	2.39
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,200	1.67	2.52%	90.771	0.12	24.46	0.96
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,350	0.39	3.20%	51.885	0.02	51.99	2.09
BVH	Beverages	49,600	-0.80	2.04%	22.888	-0.03	21.02	1.65
BCM	#N/A	84,600	0.12	2.66%	10.403	#N/A	51.14	5.00
PDR	Capital Markets	10,900	-0.91	6.22%	65.055	-0.03	3.37	0.87
GVR	Real Estate Management & Development	14,800	1.72	4.23%	36.194	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 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.