

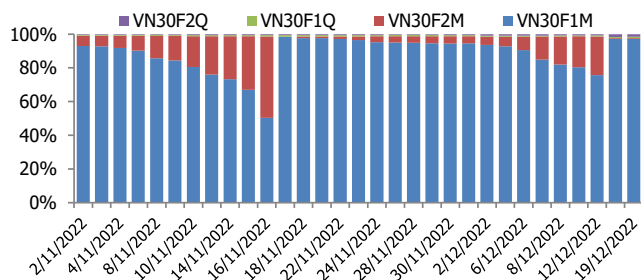
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	31	1045.00	50,424
VN30F2302	16/2/2023	59	1041.90	255
VN30F2303	16/3/2023	87	1037.10	382
VN30F2306	15/6/2023	178	1026.80	787

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	1,038.40	(1.34)	10.86	(30.69)
Dow Jones	32,757.54	(0.49)	18.85	(9.85)
S&P500	3,817.66	(0.90)	18.46	(19.90)
Nikkei 225	27,311.33	0.27	18.48	(5.14)
Shanghai	3,107.12	(1.92)	13.95	(14.63)
DAX	13,942.87	0.36	12.89	(12.23)
Vàng	1,785.58	(0.11)		(2.38)
Dầu WTI	75.84	0.86		0.84

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Đức - Chỉ số Ifo (Tháng 12)	19/12	86.4	88.6
Mỹ - Giấy phép xây dựng (Tháng 11)	20/12	1,512M	
Mỹ - Niềm tin tiêu dùng của CB (T12)	21/12	100.2	
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	22/12	211K	
Mỹ - PCE lõi (Tháng 11)	23/12	0.2%	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

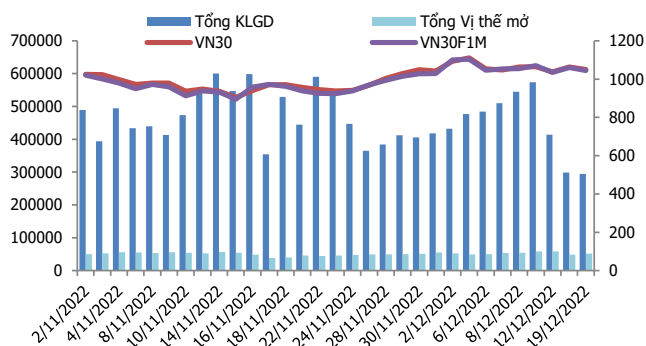
- Thị trường phiên đầu tuần gặp áp lực bán khá mạnh về cuối phiên. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 6,6 đến 15 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 13,85 điểm. Basis phiên này có cải thiện đôi chút nhưng vẫn đang ở mức âm, cho thấy tâm lý của nhà đầu tư vẫn ở trạng thái thận trọng trước các nhịp tăng giảm đan xen của thị trường. Tổng thanh khoản thị trường giảm 1,24% so với phiên liền trước, đạt 294.906 hợp đồng được khớp lệnh.
- Thị trường trong nước điều chỉnh giảm sang phiên thứ 2 liên tiếp, áp lực giảm ở phiên này đã mạnh hơn so với phiên trước đó, độ rộng thị trường cho thấy nhóm midcap và smallcap bị chốt lời mạnh sau chuỗi tăng 4 phiên liên tiếp. Khối ngoại phiên này cũng giảm đáng kể giao dịch, đây cũng là 1 phần nguyên nhân khiến thị trường không thể duy trì đà hưng phấn. Trong kịch bản thận trọng, chỉ số Vn-Index có thể kiểm tra lại ngưỡng hỗ trợ ở vùng 1.022-1.030 điểm.
- Thị trường phái sinh nhiều khả năng sẽ tiếp tục ghi nhận các nhịp dao động giằng co do các tín hiệu từ thị trường cơ sở cũng như thanh khoản thị trường đều chưa thật sự khả quan. Theo đó, nhà đầu tư có thể mở rộng vị thế và canh Long ở các nhịp điều chỉnh trong phiên với mục tiêu giao dịch ở mức 1027-1033 điểm.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ tiếp tục giảm điểm khi những lo ngại về suy thoái kinh tế ngày càng tăng và nhà đầu tư lo lắng rằng thời gian cho đã leo dốc cuối năm sắp kết thúc. Đóng cửa, chỉ số Dow Jones rớt 162,92 điểm (-0,49%) xuống 32.757,54 điểm, chỉ số S&P 500 lùi 0,9% xuống 3.817,66 điểm và chỉ số Nasdaq Composite mất 1,49% còn 10.546,03 điểm, chịu áp lực bởi đã giảm 3,35% của cổ phiếu Amazon.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1027-1033 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1021 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1063-1070 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1054-1058 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 mạnh về cuối phiên đã xóa đi đà tăng điểm trước đó trong phiên và khiến cả 4 HĐTL đóng cửa giảm từ 6,6 đến 15 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 1,24% so với phiên liền trước, đạt 294.906 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 1 với 294.108 hợp đồng. Khối ngoại mua ròng HĐTL tháng 1 với 1.608 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 17.235 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1.051,37 điểm (cao hơn 6,37 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1.052,41 điểm (+10,51 điểm), VN30F2303 là 1.053,46 điểm (+16,36 điểm) và VN30F2306 là 1.056,86 điểm (+30,06 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1045.0	54.00	294,108	-1.2	50,424	
VN30F2301	1041.9	48.00	549	-24.90	255	
VN30F2303	1037.1	29.00	114	9.6	382	
VN30F2306	1026.8	46.00	135	-17.68	787	
Tổng			294,906	-1.2	51,848	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	BUY
Hỗ trợ	1027-1033	1010-1016	995-1005
Kháng cự	1054-1058	1063-1070	1080-1086

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

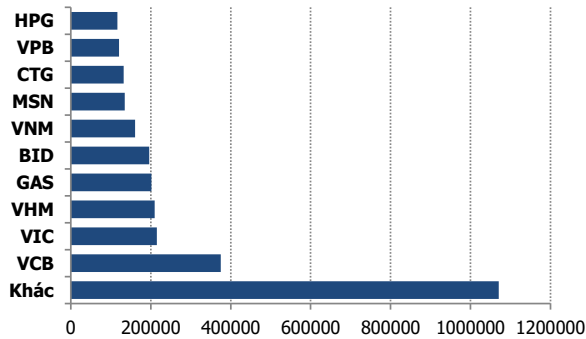


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1038.4	1050.22
Thay đổi	-14.08	-13.85
%Chg	-1.34	-1.30
YTD	-30.69	-31.61
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,142.13	2,933.47
P/E	10.86	9.00
P/B	1.66	1.66

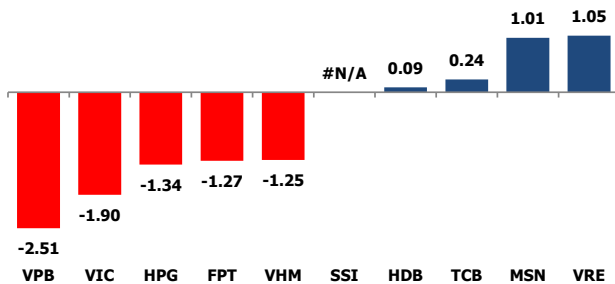
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nguyên nhân khiến các chỉ số chính tiếp tục chìm trong sắc đỏ. Số mã giảm điểm (25) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (4) và 1 mã đứng tham chiếu. VPB và VIC trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,51 điểm và -1,9 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 13,85 điểm (-1,3%) xuống 1.050,22 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 276,03 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 6.508 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 31 liên tiếp với 118,72 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như STB (+28 tỷ đồng), SHB (+27 tỷ đồng), HCM (+26 tỷ đồng), VCI (+20 tỷ đồng), BID (+16 tỷ đồng).

TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, VIC và HPG là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 tiếp tục giảm điểm. Trong đó, VPB gây ảnh hưởng -2,51 điểm tới chỉ số VN30.

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	17,950	-2.97	4.46%	541.146	-2.51	5.99	1.27
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	76,600	-1.67	2.22%	79.496	-1.27	15.95	4.22
TCB	Banks	29,250	0.34	5.51%	279.002	0.24	4.84	0.95
ACB	Banks	22,750	-1.09	2.20%	77.553	-0.75	5.80	1.38
VNM	Food Products	77,000	-1.28	1.95%	188.201	-0.87	20.38	5.17
HPG	Metals & Mining	20,000	-1.96	6.25%	996.356	-1.34	7.51	1.19
MSN	Food Products	95,000	1.60	3.03%	117.714	1.01	14.09	5.27
VIC	Real Estate Management & Development	56,500	-3.25	5.13%	165.472	-1.90	194.93	1.90
VHM	Real Estate Management & Development	48,200	-2.23	4.15%	105.661	-1.25	6.67	1.55
MWG	Specialty Retail	47,150	-1.46	3.50%	181.066	-0.80	13.46	2.96
MBB	Banks	18,350	-2.39	4.90%	271.557	-1.17	4.73	1.15
STB	Banks	22,400	-1.75	4.46%	528.887	-0.79	10.18	1.14
VCB	Banks	79,200	-0.63	2.53%	60.372	-0.27	14.18	2.92
HDB	Banks	17,350	0.29	3.17%	76.104	0.09	5.78	1.24
VJC	Airlines	111,200	-1.59	2.64%	35.76	-0.51	973.96	3.44
VRE	Real Estate Management & Development	27,300	4.20	5.90%	71.3	1.05	30.03	1.91
VIB	#N/A	20,750	-0.24	3.86%	117.026	#N/A	5.21	1.43
SSI	Capital Markets	20,500	0.00	7.37%	883.752	0.00	9.10	1.39
CTG	Banks	27,550	-1.78	3.45%	144.48	-0.38	8.51	1.26
TPB	Banks	22,500	-2.17	3.56%	164.111	-0.46	5.88	1.16
NVL	Real Estate Management & Development	17,500	-3.85	8.00%	435.415	-0.57	11.95	0.92
KDH	Real Estate Management & Development	26,700	-2.91	3.00%	64.08	-0.39	14.95	1.67
SAB	Food Products	175,000	-1.19	2.00%	28.667	-0.15	20.77	4.60
GAS	Gas Utilities	105,200	-1.13	1.52%	47.657	-0.12	15.10	3.55
BID	Banks	38,800	-0.26	4.38%	76.216	-0.02	12.12	2.04
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	11,100	-3.06	4.07%	106.075	-0.17	22.26	0.88
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	30,400	-1.94	2.14%	15.038	-0.08	41.22	1.66
PDR	Capital Markets	13,800	-4.83	8.36%	114.577	-0.20	4.26	1.10
BVH	Beverages	48,200	-2.82	2.49%	31.318	-0.11	20.43	1.61
GVR	Real Estate Management & Development	15,300	-3.16	5.56%	37.496	-0.08	14.40	1.21

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.