

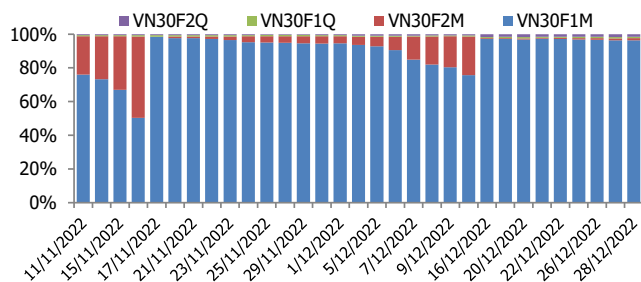
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2301	19/1/2023	22	1008.00	49,970
VN30F2302	16/2/2023	50	1003.00	696
VN30F2303	16/3/2023	78	993.20	390
VN30F2306	15/6/2023	169	983.10	789

TỶ TRỌNG VỊ THỂ MỞ GIỮA CÁC KỶ HẠN



BIẾN ĐỘNG THỊ TRƯỜNG TTCK THẾ GIỚI

Chỉ số	Điểm số	%Chg	P/E	YTD
VNIndex	1,015.66	1.10	10.60	(32.21)
Dow Jones	32,875.71	(1.10)	18.57	(9.53)
S&P500	3,783.22	(1.20)	18.25	(20.62)
Nikkei 225	26,036.69	(1.15)	17.61	(9.57)
Shanghai	3,087.40	(0.26)	13.90	(15.18)
DAX	13,925.60	(0.50)	12.88	(12.33)
Vàng	1,807.06	0.15		(1.21)
Dầu WTI	78.48	(0.61)		4.35

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Mỹ - Doanh số nhà chờ bán (T11)	28/12	-4.6%	-4.0%
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	29/12	216K	
Mỹ - Dự trữ dầu thô	29/12	-5,894M	

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

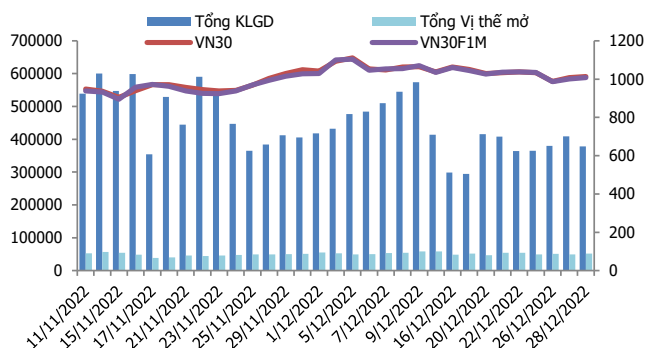
- Thị trường nói rộng đã hồi phục nhờ lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ trong phiên chiều. Đóng cửa, cả 4 HĐTL tăng từ 0,2 đến 7 điểm, trong khi chỉ số cơ sở tăng 6,59 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này cải thiện nhẹ lên mức -5,95 nhưng vẫn ở mức âm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang giữ một tâm lý khá thận trọng trong những phiên giao dịch cuối năm 2022.
- Thị trường trong nước tăng phiên thứ 2 liên tiếp sau khi đã mất ngưỡng tâm lý 1.000 điểm, qua đó giúp chỉ số Vn-index lấy lại ngưỡng kỹ thuật MA50. Dù đã phục hồi 2 phiên nhưng thị trường vẫn chưa lấy lại những gì đã mất ở phiên giảm mạnh đầu tuần. Với 2 phiên tăng liên tiếp, chỉ số Vn-Index đã quay lại cận dưới của vùng tích lũy đi ngang trước đó. Do vậy, khi chỉ số này tiến vào vùng từ 1.020 -1.030 điểm, áp lực bán sẽ gia tăng, nhà đầu tư không nên mua đuổi trong phiên.
- Sau 2 phiên bật tăng mạnh liên tiếp, cùng với mức basis vẫn đang ở trạng thái âm, nhà đầu tư nên cẩn trọng khi giao dịch và không nên mua đuổi. Theo đó, có thể mở rộng vị thế và canh Long ở các nhịp điều chỉnh trong phiên với mục tiêu giao dịch ở mức 997-1001 điểm. Ngược lại, trong trường hợp chỉ số gặp khó ở vùng 1017-1020 điểm nhà đầu tư có thể cân nhắc mở lệnh Short.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chứng khoán Mỹ giảm điểm khi nhà đầu tư hướng đến kết thúc một năm sụt giảm và chuẩn bị tinh thần cho năm mới 2023. Đóng cửa, chỉ số Dow Jones rớt 365,85 điểm (-1,1%) xuống 32.875,71 điểm. Chỉ số S&P 500 mất 1,2% còn 3.783,22 điểm, và chỉ số Nasdaq Composite lùi 1,35% xuống 10.213,29 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 997-1001 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 990 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1030-1038 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1017-1020 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

- Lực kéo mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ trong phiên chiều đã lần ất đã giảm điểm trước đó và giúp cả 4 HĐTL đóng cửa tăng từ 0,2 đến 7 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên này giảm 7,55% so với phiên liền trước, đạt 378.258 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HĐTL tháng 1 với 377.420 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HĐTL tháng 1 với 1.231 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 18.187 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2301 là 1014,74 điểm (cao hơn 6,74 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2302 là 1015,75 điểm (+12,75 điểm), VN30F2303 là 1016,75 điểm (+23,55 điểm) và VN30F2306 là 1020,03 điểm (+36,93 điểm).

DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HĐTTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2212	1008.0	1.00	377,420	-7.5	49,970	
VN30F2301	1003.0	3.00	647	-42.95	696	
VN30F2303	993.2	10.00	121	65.8	390	
VN30F2306	983.1	7.00	70	-41.67	789	
Tổng			378,258	-7.5	51,845	

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	BUY	SELL	SELL
Hỗ trợ	997-1001	983-990	960-975
Kháng cự	1017-1020	1030-1038	1047-1065

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

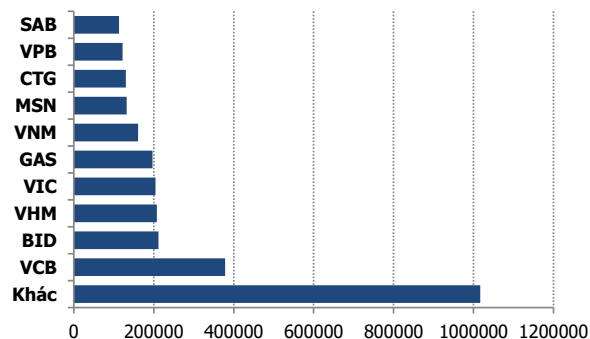


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1015.66	1013.95
Thay đổi	11.09	6.59
%Chg	1.10	0.65
YTD	-32.21	-33.98
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,055.16	2,875.23
P/E	10.60	8.69
P/B	1.63	1.61

NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay là nhân tố giúp các chỉ số chính nói rộng đà hồi phục. Số mã tăng điểm (19) áp đảo hoàn toàn so với số mã giảm điểm (9) và 2 mã đứng tham chiếu. VPB và VRE trở thành hai trụ đỡ góp tích cực nhất tới đà tăng của VN30-Index với mức đóng góp lần lượt là +1,14 điểm và +1,05 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 tăng 6,59 điểm (+0,65%) lên 1.013,95 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 173,13 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 4.111 tỷ đồng.
- Khối ngoại mua ròng phiên thứ 4 liên tiếp với 349,04 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như STB (+74 tỷ đồng), SAB (+61 tỷ đồng), DGC (+43 tỷ đồng), NVL (+35 tỷ đồng), MSN (+33 tỷ đồng).

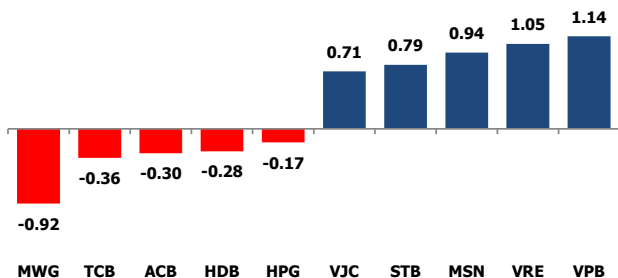
TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, VRE và MSN là những nhân tố chính duy trì đà tăng điểm của chỉ số VN30. Trong đó, VPB đóng góp +1,14 điểm cho 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	18,150	1.40	5.71%	315.814	1.14	6.06	1.29
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	76,700	0.26	1.32%	45.102	0.20	15.97	4.23
VNM	Food Products	77,000	0.52	1.83%	91.777	0.35	20.38	5.17
ACB	Banks	22,000	-0.45	2.28%	40.296	-0.30	5.61	1.33
TCB	Banks	26,150	-0.57	2.72%	86.045	-0.36	4.33	0.84
MSN	Food Products	93,000	1.53	5.38%	61.884	0.94	13.79	5.16
HPG	Metals & Mining	18,200	-0.27	3.06%	261.23	-0.17	6.84	1.08
VHM	Real Estate Management & Development	47,700	0.42	4.30%	71.03	0.23	6.61	1.53
VIC	Real Estate Management & Development	53,500	0.19	2.69%	110.197	0.10	184.58	1.80
MWG	Specialty Retail	43,000	-1.83	3.10%	59.206	-0.92	12.27	2.70
MBB	Banks	17,450	1.16	3.23%	79.72	0.52	4.50	1.09
STB	Banks	22,900	1.78	4.31%	342.405	0.79	10.41	1.17
VCB	Banks	80,000	1.14	3.14%	94.811	0.49	14.33	2.95
VJC	Airlines	110,500	2.31	4.61%	24.626	0.71	967.83	3.42
HDB	Banks	16,200	-0.92	3.13%	19.165	-0.28	5.39	1.16
VRE	Real Estate Management & Development	26,900	4.26	5.86%	47.997	1.05	29.59	1.88
VIB	#N/A	19,000	0.00	3.22%	32.254	#N/A	4.77	1.31
CTG	Banks	27,150	2.07	3.42%	50.872	0.41	8.38	1.24
SSI	Capital Markets	18,150	-0.27	3.65%	199.237	-0.05	8.06	1.23
TPB	Banks	21,400	1.66	3.87%	59.782	0.32	5.59	1.10
KDH	Real Estate Management & Development	27,050	2.66	6.07%	30.766	0.34	15.15	1.70
SAB	Food Products	176,500	2.92	2.86%	27.222	0.37	20.94	4.64
NVL	Real Estate Management & Development	14,350	-0.35	5.80%	191.096	-0.04	9.80	0.75
GAS	Gas Utilities	103,000	-0.10	1.76%	22.862	-0.01	14.78	3.48
BID	Banks	41,900	4.75	7.07%	152.18	0.40	13.09	2.20
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	10,650	0.00	1.90%	38.06	0.00	21.36	0.84
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	31,500	2.94	4.08%	23.078	0.12	42.71	1.72
PDR	Capital Markets	13,450	6.75	4.26%	180.975	0.24	4.15	1.07
BVH	Beverages	46,700	0.43	2.28%	6.887	0.02	19.80	1.56
GVR	Real Estate Management & Development	14,200	-0.35	2.85%	9.35	-0.01	13.37	1.13

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.