

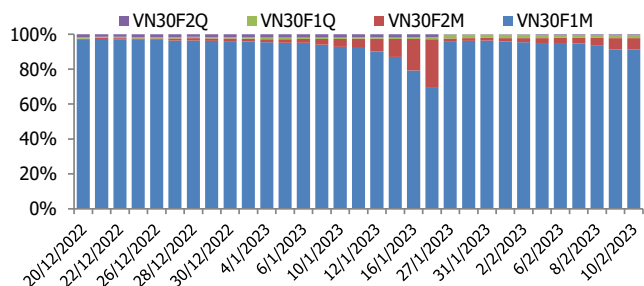
BIỂU ĐỒ VN30F1M TRONG NGÀY



THÔNG TIN MÃ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

MÃ	Ngày đáo hạn	Số ngày	Đóng cửa	OI
VN30F2302	16/2/2023	4	1045.00	46,724
VN30F2303	16/3/2023	32	1043.60	3,352
VN30F2306	15/6/2023	123	1035.40	960
VN30F2309	21/9/2023	221	1038.20	217

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	1,055.30	(0.82)	13.73	4.79
Dow Jones	33,869.27	0.50	19.99	2.18
S&P500	4,090.46	0.22	19.38	6.54
Nikkei 225	27,486.26	(0.67)	22.83	5.33
Shanghai	3,260.67	(0.30)	14.25	5.55
DAX	15,307.98	(1.39)	12.50	9.94
Vàng	1,862.03	(0.19)		2.08
Dầu WTI	79.25	(0.59)		(1.26)

LỊCH THÔNG TIN KINH TẾ THẾ GIỚI

Sự kiện	Ngày	Kỳ trước	Thực tế
Anh - PMI xây dựng (T1)	6/2	48.8	48.4
Úc - Quyết định lãi suất (T2)	7/2	3.10%	3.35%
Mỹ - Dự trữ dầu thô	8/2	4,140M	2,423M
Mỹ - Trợ cấp thất nghiệp lần đầu	9/2	183K	196K
Anh - Sản lượng sản xuất	10/2	-0.6%	0.0%

DIỄN BIẾN THỊ TRƯỜNG

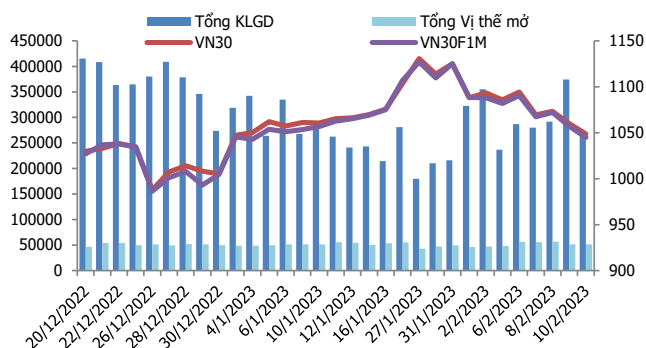
- Thị trường phái sinh hôm nay gặp áp lực bán khá lớn từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên. Đóng cửa, cả 4 HĐTL giảm từ 8,7 đến 13,5 điểm, trong khi chỉ số cơ sở giảm 11,17 điểm. Basis hợp đồng tương lai kỳ hạn 1 tháng phiên này tiếp tục giảm xuống mức âm 3,74 điểm, cho thấy nhà đầu tư vẫn đang trong trạng thái tâm lý thận trọng trước các nhịp tăng giảm đan xen của thị trường.
- Chỉ số Vn-index đang có vùng hỗ trợ 1.049 -1.052 điểm, trong kịch bản vùng hỗ trợ này bị xuyên thủng sẽ kích hoạt lực bán từ hoạt động cắt lỗ. Thanh khoản xuống thấp cho thấy nhà đầu tư đang thận trọng, thị trường có thể chiết khấu rủi ro phía trước trong bối cảnh không có thông tin hỗ trợ ở thời điểm hiện tại. Nhà đầu tư nên tập trung vào cổ phiếu cụ thể để thu gọn danh mục, hạn chế lướt sóng trong bối cảnh dòng tiền xuống khá thấp.
- Thị trường phái sinh tiếp tục ghi nhận một phiên giảm điểm mạnh, kết thúc tuần giảm điểm thứ 2. Nhịp điều chỉnh của thị trường vẫn đang hiện hữu, do vậy nhà đầu tư cần tiếp tục thận trọng trước các nhịp dao động giằng co, cùng với việc basis hiện vẫn đang ở mức âm.

NHẬN ĐỊNH TTCK THẾ GIỚI

- Chỉ số S&P 500 tăng nhẹ vào ngày thứ Sáu (10/02), nhưng vẫn ghi nhận tuần tồi tệ nhất trong gần 2 tháng. Kết phiên, chỉ số S&P 500 tiến 0,2% lên 4.090,46 điểm. Chỉ số Dow Jones cộng 169,39 điểm (+0,5%) lên 33.869,27 điểm. Trong khi, chỉ số Nasdaq Composite lùi 0,61% xuống 11.718,12 điểm.

CHIẾN LƯỢC ĐẦU TƯ

Chiến lược giao dịch trong ngày	Nhà đầu tư có thể xem xét rải lệnh Mua quanh khu vực 1034-1040 điểm trong các pha điều chỉnh. Điểm quản trị rủi ro là mốc hỗ trợ 1021 điểm, hướng đến mức giá mục tiêu 1069-1075 điểm. Chiến lược Short sẽ được kích hoạt nếu chỉ số gặp khó ở vùng kháng cự gần 1054-1060 điểm.
Chiến lược giao dịch ngắn hạn	Hoạt động nắm giữ vị thế qua đêm tạm thời chưa được khuyến khích.



DIỄN BIẾN CHỈ SỐ HDTL CÁC KỲ HẠN

Hợp đồng	Giá	% Chg	KLGD	% Chg	OI	% Chg
VN30F2302	1045.0	212.00	267,210	-28.2	46,724	
VN30F2303	1043.6	304.00	3,214	54.52	3,352	
VN30F2306	1035.4	293.00	45	32.4	960	
VN30F2309	1038.2	143.00	30	-69.70	217	
Tổng			270,499	-27.7	51,253	

DIỄN BIẾN GIÁ HỢP ĐỒNG VN30F1M VÀ VN30F2M



NHẬN ĐỊNH DIỄN BIẾN GIAO DỊCH HDTL

- Áp lực bán khá mạnh từ nhóm cổ phiếu trụ về cuối phiên đã khiến cả 4 HDTL đóng cửa giảm từ 8,7 đến 13,5 điểm.
- Tổng thanh khoản thị trường phiên nay giảm 27,7% so với phiên liền trước, đạt 270.499 hợp đồng được khớp lệnh, trong đó thanh khoản tập trung tại HDTL tháng 2 với 267.210 hợp đồng. Khối ngoại bán ròng HDTL tháng 2 với 1.377 hợp đồng, lũy kế mua ròng khoảng 13.073 hợp đồng.
- Giá lý thuyết (FV) MBS tính toán tham khảo phiên giao dịch tới cho hợp đồng VN30F2302 là 1048,96 điểm (cao hơn 3,96 điểm so với giá thị trường). Tương tự, giá lý thuyết tham khảo cho hợp đồng VN30F2303 là 1050 điểm (+6,4 điểm), VN30F2306 là 1053,39 điểm (+17,99 điểm) và VN30F2309 là 1057,05 điểm (+18,85 điểm).

XU HƯỚNG CHỈ SỐ VN30F1M

Khung thời gian	15m	1h	Daily
Tổng kết	SELL	SELL	SELL
Hỗ trợ	1034-1040	1020-1025	1004-1015
Kháng cự	1054-1060	1069-1075	1084-1094

ĐỒ THỊ KỸ THUẬT VN30F1M

Đồ thị kỹ thuật VN30F1M

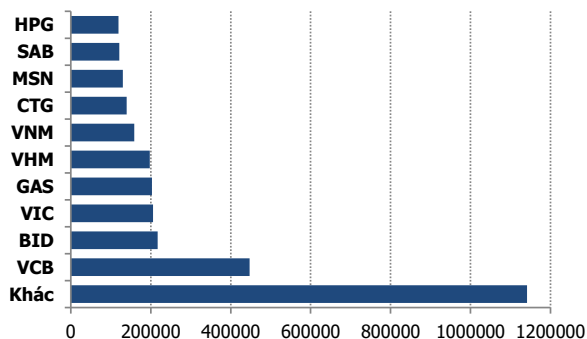


	VNIndex	VN30
Đóng cửa	1055.3	1048.74
Thay đổi	-8.73	-11.17
%Chg	-0.82	-1.05
YTD	4.79	4.33
Vốn hóa (ngh.tỷ đồng)	4,211.70	3,081.36
P/E	13.73	11.02
P/B	1.69	1.62

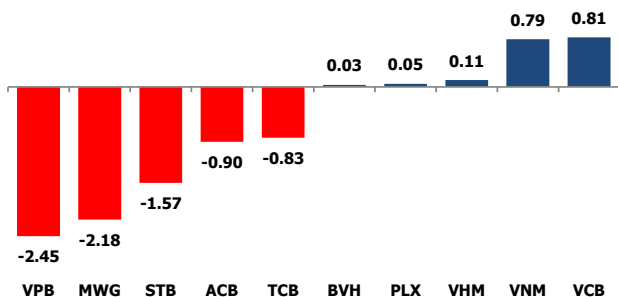
NHẬN ĐỊNH CHỈ SỐ VN30

- Nhóm vốn hóa lớn hôm nay tiếp tục khiến các chỉ số chính chìm trong sắc đỏ. Số mã giảm điểm (20) áp đảo hoàn toàn so với số mã tăng điểm (6) và 4 mã đứng tham chiếu, trong đó VPB và MWG trở thành hai trụ tác động tiêu cực nhất tới đà giảm của VN30-Index với mức ảnh hưởng lần lượt là -2,45 điểm và -2,18 điểm.
- Chốt phiên, chỉ số VN30 giảm 11,17 điểm (-1,05%) xuống 1.048,74 điểm. Khối lượng giao dịch đạt 155,04 triệu cổ phiếu, tương ứng giá trị 3.772 tỷ đồng.
- Khỏi ngoại quay lại mua ròng với 60,33 tỷ đồng trên toàn thị trường. Trong đó, lực mua tập trung ở các mã như HPG (+43 tỷ đồng), GEX (+28 tỷ đồng), VCB (+26 tỷ đồng), POW (+19 tỷ đồng), MSN (+13 tỷ đồng).

TOP 10 CỔ PHIẾU VỐN HÓA TRONG VN30



CÁC MÃ ẢNH HƯỞNG LỚN NHẤT TỚI VN30-INDEX

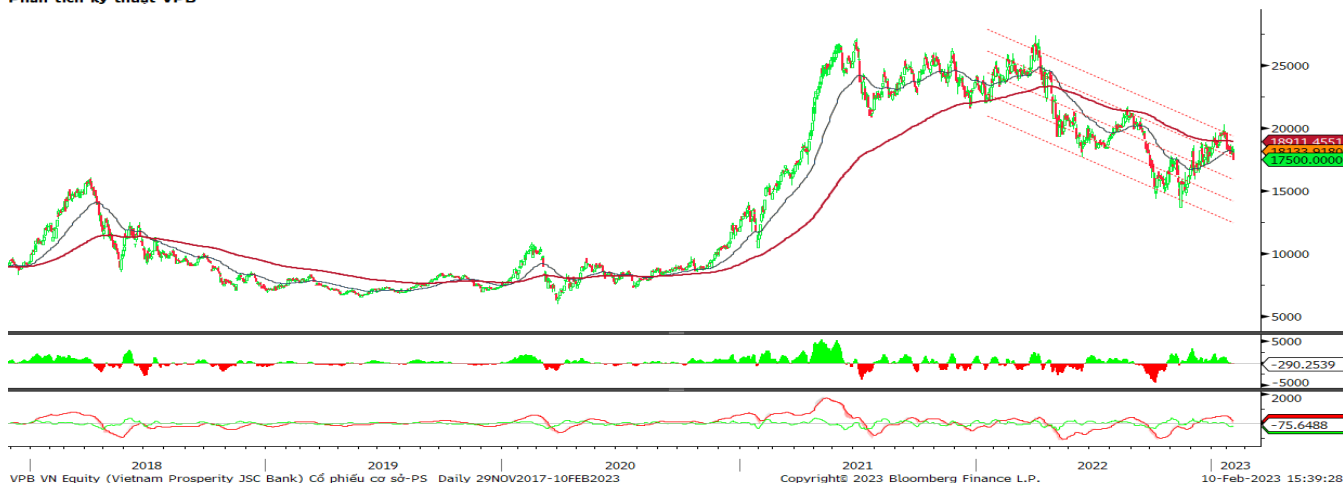


NHẬN ĐỊNH CỔ PHIẾU BIẾN ĐỘNG MẠNH TRONG VN30

- Xét về mức độ ảnh hưởng, bộ 3 VPB, MWG và STB là những nguyên nhân chính khiến chỉ số VN30 tiếp tục nằm trong đà giảm điểm. Trong đó, VPB gây ảnh hưởng -2,45 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	17,500	-2.78	4.57%	234.106	-2.45	6.40	1.24
FPT	Electronic Equipment, Instruments & Components	80,700	0.00	0.87%	58.563	0.00	16.80	4.45
ACB	Banks	24,200	-1.22	2.27%	49.03	-0.90	6.17	1.47
HPG	Metals & Mining	20,500	-0.49	3.23%	324.393	-0.33	7.70	1.22
VNM	Food Products	75,900	1.20	1.20%	92.966	0.79	20.09	5.09
TCB	Banks	26,950	-1.28	2.23%	71.283	-0.83	4.46	0.87
MSN	Food Products	91,200	-0.65	2.79%	61.936	-0.40	13.52	5.06
VIC	Real Estate Management & Development	54,000	-0.37	3.23%	90.607	-0.20	186.30	1.82
VHM	Real Estate Management & Development	45,400	0.22	1.67%	72.705	0.11	6.29	1.46
VCB	Banks	94,500	1.61	1.83%	60.783	0.81	16.92	3.49
MWG	Specialty Retail	42,100	-4.32	5.58%	87.766	-2.18	12.02	2.64
MBB	Banks	18,300	-0.81	1.64%	110.408	-0.39	4.72	1.14
STB	Banks	23,650	-3.27	4.86%	390.271	-1.57	10.75	1.21
HDB	Banks	18,150	-0.27	2.23%	28.905	-0.09	6.04	1.30
VJC	Airlines	102,000	0.10	4.63%	15.411	0.03	893.38	3.16
VRE	Real Estate Management & Development	28,200	0.00	2.16%	20.35	0.00	31.02	1.97
TPB	Banks	23,550	-2.89	4.03%	98.291	-0.69	6.15	1.22
VIB	#N/A	21,000	-4.55	5.98%	71.497	#N/A	5.27	1.45
CTG	Banks	29,100	-1.02	2.41%	61.802	-0.23	8.98	1.33
SSI	Capital Markets	19,000	-1.81	3.98%	182.583	-0.38	8.43	1.29
NVL	Real Estate Management & Development	13,750	-2.83	3.65%	152.588	-0.45	9.39	0.72
SAB	Food Products	189,400	-2.27	3.59%	13.612	-0.32	22.47	4.98
GAS	Gas Utilities	106,100	-1.85	1.89%	21.585	-0.20	15.23	3.59
BID	Banks	42,950	-2.39	3.73%	61.209	-0.22	13.42	2.26
POW	Independent Power and Renewable Electricity Producers	12,000	0.00	2.93%	91.89	0.00	24.06	0.95
PLX	Oil, Gas & Consumable Fuels	38,300	1.06	4.29%	32.341	0.05	51.93	2.09
BVH	Beverages	49,800	0.91	2.34%	27.787	0.03	21.11	1.66
PDR	Capital Markets	12,050	0.00	2.94%	46.079	0.00	3.72	0.96
BCM	#N/A	84,500	-0.24	1.44%	7.249	#N/A	51.08	5.00
GVR	Real Estate Management & Development	14,650	-2.01	2.74%	21.038	-0.05	13.79	1.16

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.