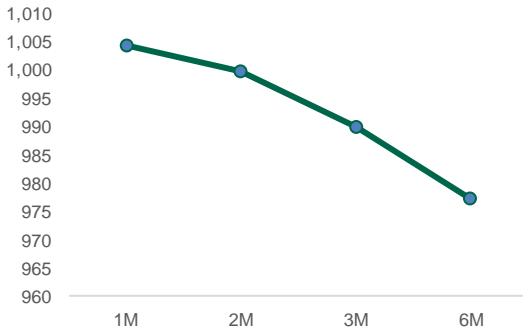
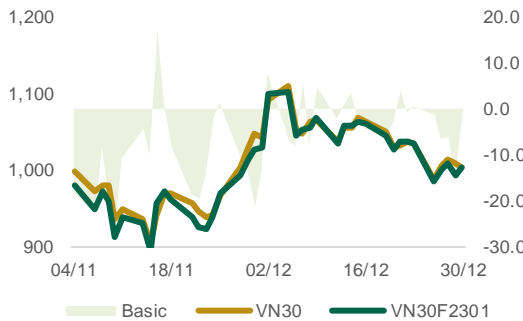


BÊN BÁN CÓ DẤU HIỆU ĐẦY GIÁ THẤT BẠI?

Đường cong giá hợp đồng tương lai

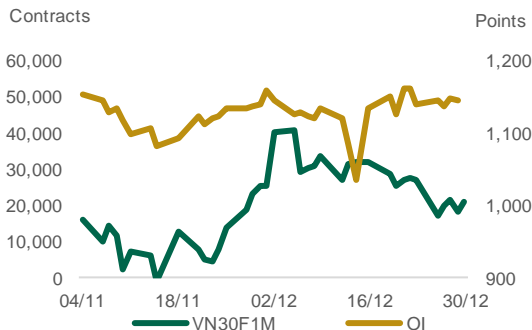


Basic*



(*) Giá HDTL VN30F1M – Giá đóng cửa VN30

Khối lượng mở (Open Interest)



NHẬN ĐỊNH CHUNG

- Trên đồ thị 15 phút, VN30F2301 tiếp tục có diễn biến giảm về cuối phiên với nền giảm dài cô đặc, tuy nhiên lại bất ngờ hồi phục tốt vào phiên ATC. Nhìn lại hai phiên gần đây, chúng tôi nhận thấy tín hiệu xuất hiện hai nền giảm dài khá đẹp nhưng giá lại không tiếp nối được đà giảm mà nhanh chóng lấy lại phần lớn số điểm. Diễn biến này cho dấu hiệu về sự đầy giá thất bại của bên bán và có thể sẽ là cơ hội để bên mua đẩy giá trong phiên đầu năm. Tuy vậy, vùng cung 1007-1010 vẫn có thể được cân nhắc cho vị thế Short khi mức stoploss không lớn (4đ).
- Nếu giá vượt qua vùng cung này thì khả năng sẽ có nhịp tăng hướng về vùng cung tiếp theo là 1025-1032 trước khi đảo chiều trở lại. Vùng này cũng trùng với cạnh trên của kênh giảm chính.

CHIẾN LƯỢC GIAO DỊCH TRONG NGÀY

- Vị thế Short vẫn nên cân nhắc được ưu tiên hơn và có thể canh tham gia nếu giá hồi về vùng cung 1007-1010 hoặc vùng cung 1025-1032.

Vị thế	Điểm vào	Chốt lời	Cắt lỗ	Lợi nhuận/ Rủi ro
Short	1007	989	>1011	18 : 4
Short	1026	1010	>1033	16 : 7



Thống kê hợp đồng tương lai

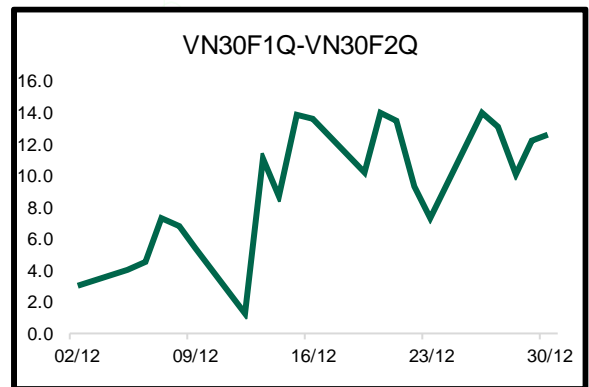
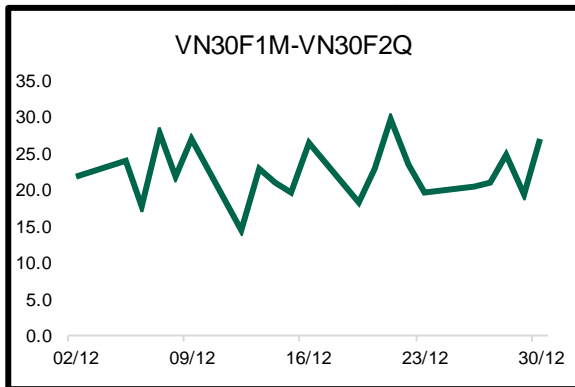
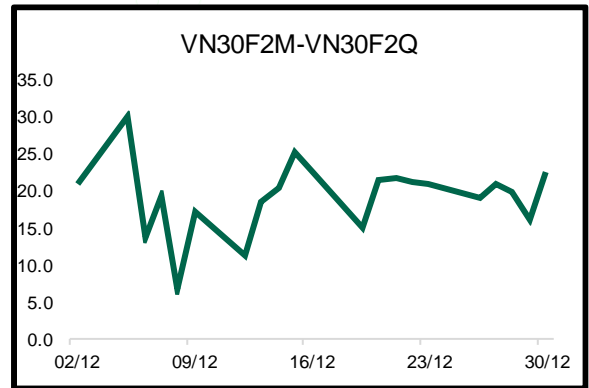
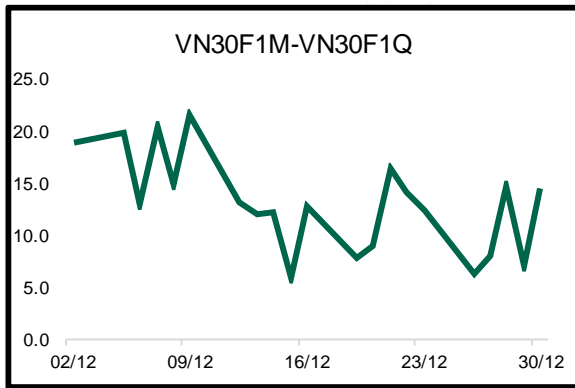
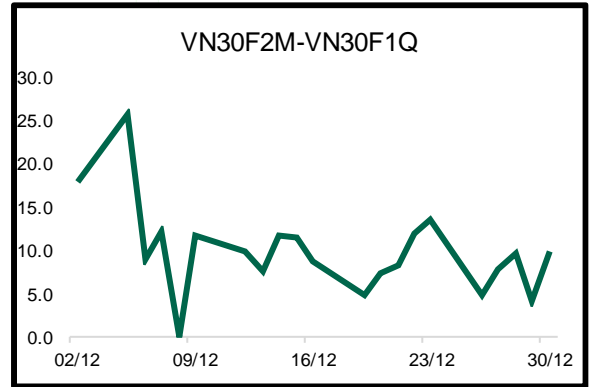
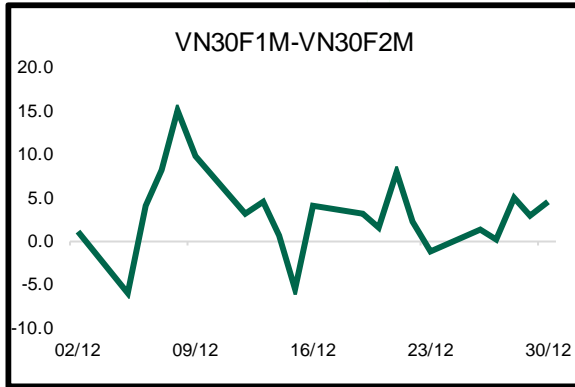
Mã hợp đồng	Giá đóng cửa	Thay đổi (điểm)	KL giao dịch	KL Mở	Giá lý thuyết	Chênh lệch**	Ngày thanh toán	Thời hạn còn lại (ngày)
VN30 Index	1,005.2	-3.11						
VN30F2301	1,004.5	11.50	273,078	49,314	1,006.0	(1.5)	19/01/2023	20
VN30F2302	1,000.0	10.00	275	761	1,007.0	(7.0)	16/02/2023	48
VN30F2303	990.0	4.10	96	403	1,008.1	(18.1)	16/03/2023	76
VN30F2306	977.4	3.70	108	790	1,011.6	(34.2)	15/06/2023	167

(**) Giá đóng cửa HDTL – Giá lý thuyết HDTL

Nguồn: Bloomberg, PHS

Tất cả những thông tin đều được thu thập từ các nguồn đáng tin cậy. Tuy nhiên do thị trường chứng khoán còn chịu ảnh hưởng bởi nhiều nhân tố phức tạp và khó dự báo nên quý nhà đầu tư cần tự chịu trách nhiệm về các hoạt động đầu tư của mình.

Chênh lệch giá các hợp đồng tương lai (Future Spread)



Danh sách cổ phiếu trong rổ VN30

MCK	Tên doanh nghiệp	Phân ngành	Vốn hóa (Tỷ đồng)	Tỷ trọng trong VN30	Giá đóng cửa	% +/-	GTGD KL (Tỷ đồng)	Tác động đến VN30	PE	PB	Beta
ACB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Á Châu	Ngân hàng	73,966	6.46%	21,900	-0.45%	29.4	-0.03%	5.6	1.3	1.1
BID	Ngân hàng Thương mại cổ phần Đầu tư và Phát triển Việt Nam	Ngân hàng	195,259	0.80%	38,600	-3.50%	103.6	-0.03%	12.1	2.0	1.0
BVH	Tập đoàn Bảo Việt	Bảo hiểm	34,592	0.36%	46,600	0.22%	6.6	0.00%	19.8	1.6	1.0
CTG	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Công thương Việt Nam	Ngân hàng	130,957	2.02%	27,250	0.93%	37.8	0.02%	8.4	1.2	1.2
FPT	Công ty Cổ phần FPT	Công nghệ Thông tin	84,361	7.36%	76,900	0.92%	48.1	0.07%	16.0	4.2	0.9
GAS	Tổng Công ty Khí Việt Nam-CTCP	Điện, nước & xăng dầu khí đốt	194,266	1.00%	101,500	-1.07%	14.4	-0.01%	14.6	3.4	0.9
GVR	Tập đoàn Công nghiệp Cao su Việt Nam	Hóa chất	55,200	0.23%	13,800	0.00%	8.0	0.00%	13.0	1.1	1.5
HDB	Ngân hàng TMCP Phát triển T.P Hồ Chí Minh	Ngân hàng	40,118	2.88%	15,950	0.31%	24.1	0.01%	5.3	1.1	1.1
HPG	Công ty cổ phần Tập đoàn Hòa Phát	Tài nguyên Cơ bản	104,666	5.91%	18,000	0.00%	262.5	0.00%	6.8	1.1	1.3
KDH	Công ty Cổ phần Đầu tư Kinh doanh nhà Khang Điền	Bất động sản	18,996	1.27%	26,500	-5.19%	21.5	-0.07%	14.8	1.7	1.2
MBB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Quân đội	Ngân hàng	77,531	4.38%	17,100	-1.72%	71.6	-0.08%	4.4	1.1	1.3
MSN	Công ty Cổ phần Tập đoàn MaSan	Thực phẩm và đồ uống	132,406	6.12%	93,000	-1.06%	43.0	-0.07%	13.8	5.2	1.0
MWG	Công ty cổ phần Đầu tư Thế giới Di động	Bán lẻ	62,779	4.51%	42,900	0.00%	70.5	0.00%	12.2	2.7	1.0
NVL	Công ty cổ phần Tập đoàn Đầu tư Địa ốc No Va	Bất động sản	27,301	1.12%	14,000	-4.44%	151.1	-0.05%	9.6	0.7	0.9
PDR	Công ty cổ phần Phát triển Bất động sản Phát Đạt	Bất động sản	9,134	0.38%	13,600	1.49%	117.0	0.01%	4.2	1.1	0.9
PLX	Tập đoàn Xăng dầu Việt Nam	Dầu khí	40,278	0.41%	31,700	1.12%	16.3	0.00%	43.0	1.7	1.0
POW	Tổng Công ty Điện lực Dầu khí Việt Nam - CTCP	Điện, nước & xăng dầu khí đốt	24,941	0.64%	10,650	1.43%	37.8	0.01%	21.4	0.8	1.1
SAB	Tổng CTCP Bia - Rượu - Nước giải khát Sài Gòn	Thực phẩm và đồ uống	107,030	1.21%	166,900	-3.47%	28.5	-0.04%	19.8	4.4	0.6
SSI	Công ty cổ phần Chứng khoán SSI	Dịch vụ tài chính	26,358	1.89%	17,700	0.57%	114.8	0.01%	7.9	1.2	1.4
STB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Sài Gòn Thương Tín	Ngân hàng	42,417	4.36%	22,500	0.67%	238.8	0.03%	10.2	1.1	1.3
TCB	Ngân hàng TMCP Kỹ Thương Việt Nam (Techcombank)	Ngân hàng	90,921	6.07%	25,850	-0.39%	56.6	-0.02%	4.3	0.8	1.3
TPB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Tiên Phong	Ngân hàng	33,296	1.71%	21,050	-1.64%	69.4	-0.03%	5.5	1.1	1.1
VCB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Ngoại thương Việt Nam	Ngân hàng	378,601	4.28%	80,000	-0.87%	123.5	-0.04%	14.3	3.0	0.9
VHM	Công ty cổ phần Vinhomes	Bất động sản	209,010	6.44%	48,000	0.42%	57.8	0.03%	6.6	1.5	0.9
VIB	Ngân hàng Thương mại cổ phần Quốc tế Việt Nam	Ngân hàng	40,046	2.26%	19,000	0.53%	27.2	0.01%	4.8	1.3	1.2
VIC	Tập đoàn Vingroup - Công ty Cổ phần	Bất động sản	205,190	5.27%	53,800	0.37%	131.9	0.02%	185.6	1.8	0.6
VJC	Công ty cổ phần Hàng không VietJet	Du lịch và Giải trí	59,306	3.05%	109,500	0.27%	14.7	0.01%	959.1	3.4	0.5
VNM	Công ty Cổ phần Sữa Việt Nam	Thực phẩm và đồ uống	159,046	6.53%	76,100	-1.17%	92.3	-0.08%	20.1	5.1	0.6
VPB	Ngân hàng Thương mại Cổ phần Việt Nam Thịnh Vượng	Ngân hàng	120,166	8.64%	17,900	0.56%	179.3	0.05%	6.0	1.3	1.2
VRE	Công ty Cổ phần Vincom Retail	Bất động sản	59,762	2.45%	26,300	-0.75%	48.1	-0.02%	28.9	1.8	1.1

Nguồn: Bloomberg, PHS

Tất cả những thông tin đều được thu thập từ các nguồn đáng tin cậy. Tuy nhiên do thị trường chứng khoán còn chịu ảnh hưởng bởi nhiều nhân tố phức tạp và khó dự báo nên quý nhà đầu tư cần tự chịu trách nhiệm về các hoạt động đầu tư của mình.

Đảm bảo phân tích

Báo cáo được thực hiện bởi **Đinh Quang Minh, Chuyên viên phân tích – Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng**. Mỗi nhân viên phụ trách về phân tích, chiến lược hay nghiên cứu chịu trách nhiệm cho sự chuẩn bị và nội dung của tất cả các phần có trong bản báo cáo nghiên cứu này đảm bảo rằng, tất cả các ý kiến của những người phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đều phản ánh trung thực và chính xác ý kiến cá nhân của họ về những vấn đề trong bản báo cáo. Mỗi nhân viên phân tích, chiến lược hay nghiên cứu đảm bảo rằng họ không được hưởng bất cứ khoản chi trả nào trong quá khứ, hiện tại cũng như tương lai liên quan đến các khuyến cáo hay ý kiến thể hiện trong bản báo cáo này.

Miễn trách nhiệm

Thông tin này được tổng hợp từ các nguồn mà chúng tôi cho rằng đáng tin cậy, nhưng chúng tôi không chịu trách nhiệm về sự hoàn chỉnh hay tính chính xác của nó. Đây không phải là bản chào hàng hay sự nài khẩn mua của bất cứ cổ phiếu nào. Chứng khoán Phú Hưng và các chi nhánh và văn phòng và nhân viên của mình có thể có hoặc không có vị trí liên quan đến các cổ phiếu được nhắc tới ở đây. Chứng khoán Phú Hưng (hoặc chi nhánh) đôi khi có thể có đầu tư hoặc các dịch vụ khác hay thu hút đầu tư hoặc các hoạt động kinh doanh khác cho bất kỳ công ty nào được nhắc đến trong báo cáo này. Tất cả các ý kiến và dự đoán có trong báo cáo này được tạo thành từ các đánh giá của chúng tôi vào ngày này và có thể thay đổi không cần báo trước.

© Công ty Cổ phần Chứng khoán Phú Hưng (PHS)

Tầng 21, Tòa nhà Phú Mỹ Hưng, 08 Hoàng Văn Thái, Phường Tân Phú, Quận 7, Tp. HCM

Điện thoại: (84-28) 5 413 5479

Fax: (84-28) 5 413 5472

Customer Service: (84-28) 5 411 8855

Call Center: (84-28) 5 413 5488

E-mail: info@phs.vn / support@phs.vn Web: www.phs.vn

PGD Phú Mỹ Hưng

Tòa nhà CR2-08, 107 Tôn Dật Tiên,
Phường Tân Phú, Quận 7,
Tp. HCM

Điện thoại: (84-28) 5 413 5478

Fax: (84-28) 5 413 5473

Chi nhánh Quận 3

Tầng 2, Tòa nhà Phương Nam,
157 Võ Thị Sáu, Phường 6,
Quận 3, Tp. HCM

Điện thoại: (84-28) 3 820 8068

Fax: (84-28) 3 820 8206

Chi Nhánh Thanh Xuân

Tầng 5, Tòa nhà UDIC Complex,
N04 Hoàng Đạo Thúy, Phường
Trung Hòa, Quận Cầu Giấy, Hà Nội.

Điện thoại: (84-24) 6 250 9999

Fax: (84-24) 6 250 6666

Chi nhánh Tân Bình

Tòa nhà Park Legend, 251 Hoàng
Văn Thụ, Phường 2, Quận Tân Bình,
Tp. HCM.

Điện thoại: (84-28) 3 813 2401

Fax: (84-28) 3 813 2415

Chi Nhánh Hà Nội

Tầng 5, Tòa nhà Vinafor,
127 Lò Đúc, Quận Hai Bà
Trung, Hà Nội

Điện thoại: (84-24) 3 933 4566

Fax: (84-24) 3 933 4820

Chi nhánh Hải Phòng

Tầng 2, Tòa nhà Eliteco, 18 Trần
Hưng Đạo, Quận Hồng Bàng, Hải
Phòng

Điện thoại: (84-225) 384 1810

Fax: (84-225) 384 1801

Chi nhánh Quận 1

Phòng 1003A, Tầng 10, Tòa nhà
Ruby, 81-83-83B-85 Hàm Nghi,
Phường Nguyễn Thái Bình, Quận 1,
Tp. HCM

Điện thoại: (84-28) 3 535 6060

Fax: (84-28) 3 535 2912