

Báo cáo phân tích kỹ thuật ngày 10/09/2021

Tổng quan:

Phiên giao dịch cuối tuần mở cửa với tâm lý tương đối tích cực, VN-Index tăng 5 điểm sau ATO. Mặc dù vậy, áp lực chốt lời nhanh chóng dâng cao khiến thị trường thu hẹp đà tăng. Trong phiên giao dịch, chỉ số nhiều lần nỗ lực bứt phá khỏi mốc 1,350 điểm nhưng không thành công. Về cuối phiên chiều, áp lực điều chỉnh của nhiều cổ phiếu Ngân hàng khiến VN-Index lùi về sát mốc tham chiếu. Ở chiều ngược lại, nhóm ngành Hàng không tiếp tục bứt phá với nhiều cổ phiếu tăng điểm tích cực.

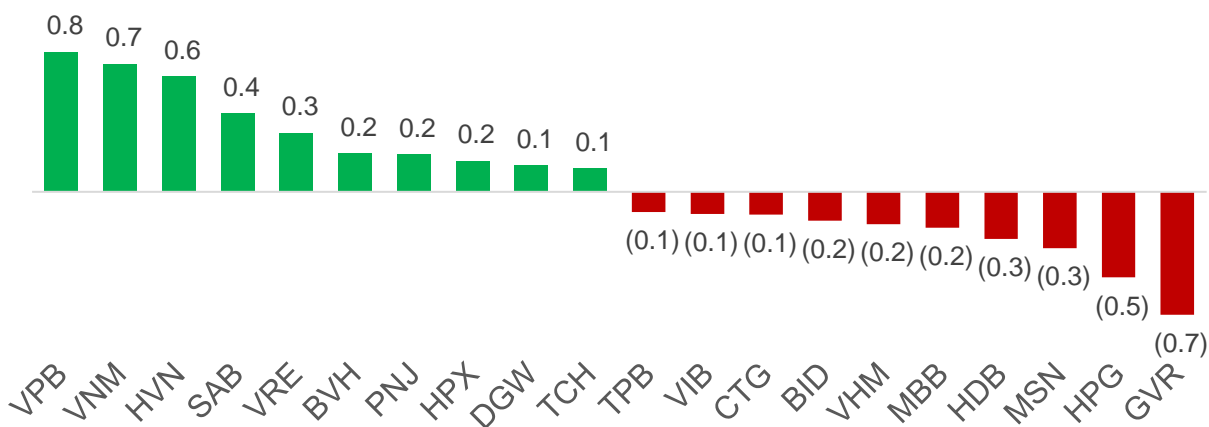
Kết thúc phiên giao dịch ngày 10/09/2021, VN-Index đóng cửa tại 1,345.3 điểm, tăng 1.3 điểm (tương đương 0.1%). Thanh khoản thị trường đạt 568 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 18,957 tỷ. Thị trường giằng co với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 212/195. Nhóm Thực phẩm và đồ uống và Du lịch và Giải trí đóng vai trò dẫn dắt đà tăng điểm của VN-Index. Ngoài ra, những nhóm ngành khác có sự tăng giá đáng kể là Hàng cá nhân & Gia dụng, Bảo hiểm, Dịch vụ tài chính. Những cổ phiếu đóng góp chủ yếu vào đà tăng của VN-Index là: VPB (+0.8, +1.9%), VNM (+0.7, +1.5%), HVN (+0.6, +4.6%), SAB (+0.4, +1.8%), VRE (+0.3, +2.0%),... Trên sàn HOSE, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 751 tỷ, tập trung chủ yếu ở VHM (563 tỷ), DPM (60 tỷ), VNM (55 tỷ), VIC (44 tỷ), KBC (41 tỷ). Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở CTG (65 tỷ), PNJ (48 tỷ), HPG (43 tỷ), VND (41 tỷ), VCI (32 tỷ). Xét theo nhóm ngành, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng mạnh nhất ở Ngân hàng, Hàng cá nhân & Gia dụng, Du lịch và Giải trí và bán ròng mạnh nhất ở Bất động sản, Thực phẩm và đồ uống, Hóa chất.

HNX-Index giảm 0.3 điểm (tương đương 0.1%). Thanh khoản sàn HNX đạt 146 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 2,992 tỷ. Độ rộng thị trường sàn HNX nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 138/86.

Ngoài ra, TCBS thống kê một số cổ phiếu có tín hiệu nổi bật trong phiên giao dịch 10/09 như sau:

- + Tín hiệu Mua: FTS, AST, DGW, FMC
- + Sức mạnh giá cao nhất 3 phiên gần đây: TMS (96), NVB (96), TVN (94), VCR (94), VND (91)
- + Sức mạnh giá thấp nhất 3 phiên gần đây: HPX (2), LGC (4), DHG (8), PVI (10)
- + Tăng giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: VGI (4.6x), BHN (3.6x), HVN (2.8x), TVN (2.5x), PAN (2.4x)
- + Giảm giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: BAB (2.1x), BCM (1.8x), SNZ (1.6x), PGB (1.5x), TPB (1.4x)
- + Tỷ trọng Cá mập mua chủ động nhiều nhất: FUEVFNVD (87%), KDC (81%), VPB (56%), CTR (54%), VND (54%)
- + Tỷ trọng Cá mập bán chủ động nhiều nhất: VHM (88%), TCH (68%), HPG (64%), DPM (61%), STB (59%)
- + Tăng liên tiếp nhiều nhất: THD (13), TGG (11), PSD (11), KHB (9), ACG (8)
- + Giảm liên tiếp nhiều nhất: DHG (6), PVM (6), VMD (5), HSV (4), STG (4)

Nhóm cổ phiếu dẫn dắt thị trường



Danh mục cổ phiếu có tín hiệu MUA

Cổ phiếu	Điểm RS (i)	KLGD /TB 20 phiên	Điểm kỹ thuật (ii)	Điểm cơ bản (iii)	% mua chủ động	Cơ cấu mua chủ động (iv)		
						Cá mập	Sói già	Cừu non
FTS	93	130%	80	69	61%	4%	45%	51%
AST	65	245%	70	<60	34%	0%	0%	100%
DGW	96	202%	80	60	73%	29%	40%	31%
FMC	71	131%	80	<60	69%	18%	38%	44%

FTS tăng 5.3%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Chứng khoán đang suy yếu. FTS vượt trội bình quân thị trường trong hầu hết các khung thời gian từ 1 tuần đến 12 tháng. Giá cổ phiếu cắt trên các đường MA, trong đó các đường ngắn hạn xếp trên các đường dài hạn. Chỉ báo RSI đang tăng dần và chạm ngưỡng 75. Đường MACD nằm dưới đường Signal và MACD Histogram tăng dần. Ngoài ra, tín hiệu tăng giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 130% trung bình 10 ngày).

AST tăng 7.0%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Hàng không đang mạnh. AST vượt trội bình quân thị trường trong hầu hết các khung thời gian từ 1 tuần đến 12 tháng. Chỉ báo RSI đang tăng dần và chạm ngưỡng 77. Đường MACD nằm trên đường Signal và MACD Histogram tăng dần. Ngoài ra, tín hiệu tăng giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 245% trung bình 10 ngày).

DGW tăng 6.6%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bán lẻ đang ở trạng thái trung lập. DGW vượt trội bình quân thị trường trong hầu hết các khung thời gian từ 1 tuần đến 12 tháng. Giá cổ phiếu cắt trên các đường MA, trong đó các đường ngắn hạn xếp trên các đường dài hạn. Chỉ báo RSI đang tăng dần và chạm ngưỡng 84. Đường MACD nằm trên đường Signal và MACD Histogram tăng dần. Ngoài ra, tín hiệu tăng giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 202% trung bình 10 ngày).

FMC tăng 4.0%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Nông nghiệp đang ở trạng thái trung lập. FMC vượt trội bình quân thị trường trong hầu hết các khung thời gian từ 1 tuần đến 12 tháng. Giá cổ phiếu cắt trên các đường MA, trong đó các đường ngắn hạn xếp trên các đường dài hạn. Chỉ báo RSI đang tăng dần và chạm ngưỡng 71. Đường MACD nằm trên đường Signal và MACD Histogram tăng dần. Ngoài ra, tín hiệu tăng giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 131% trung bình 10 ngày).

(i) Điểm RS (chỉ số sức mạnh giá) được tính bằng cách so sánh sự thay đổi giá của mỗi cổ phiếu với những cổ phiếu khác trên thị trường, được xếp hạng từ 1 đến 100. Cổ phiếu có điểm càng cao càng thể hiện sức mạnh giá vượt trội so với thị trường.

(ii) Điểm phân tích kỹ thuật được đánh giá và tổng hợp từ nhiều chỉ báo kỹ thuật về giá và khối lượng giao dịch. Cổ phiếu đang có xu hướng tăng giá mạnh khi điểm phân tích kỹ thuật ≥ 70 (trên thang điểm 100).

(iii) Điểm phân tích cơ bản được tổng hợp từ mô hình định lượng (Quantitative model), tập trung vào những chỉ tiêu về hiệu quả sinh lời, định giá, ... Cổ phiếu có điểm phân tích cơ bản ≥ 60 (trên thang điểm 100) có nền tảng cơ bản tốt.

(iv) Cá mập là nhà đầu tư tay to, tổ chức, đầu tư lớn, dẫn dắt thị trường (giá trị 1 lệnh đặt > 1 tỷ đồng/lệnh). Sói già là nhà đầu tư kinh nghiệm, giá trị lệnh đặt cao (giá trị 1 lệnh đặt từ 200 triệu đến 1 tỷ đồng/lệnh). Cừu non là nhà đầu tư nhỏ lẻ, giá trị giao dịch và mua bán chủ động thấp (giá trị 1 lệnh đặt < 200 triệu đồng/lệnh).

Top những cổ phiếu có chuỗi tăng/giảm dài nhất

Mã	Xu hướng hiện tại			Chuỗi tăng dài nhất trong lịch sử		Chuỗi giảm dài nhất trong lịch sử	
	Xu hướng	Số phiên liên tiếp	% Thay đổi giá	Số phiên tăng	% tăng giá	Số phiên giảm	% giảm giá
THD	Tăng	13	3%	19	330%	6	-6%
TGG	Tăng	11	97%	14	126%	8	-36%
PSD	Tăng	11	51%	11	51%	5	-6%
KHB	Tăng	9	149%	9	149%	6	-6%
ACG	Tăng	8	12%	8	12%	4	-6%
VKC	Tăng	7	88%	7	88%	4	-17%
VOS	Tăng	7	45%	12	107%	7	-36%
TCO	Tăng	6	49%	8	50%	6	-34%
VNL	Tăng	6	41%	6	41%	4	-24%
DGW	Tăng	5	20%	11	22%	5	-23%
HVN	Tăng	5	20%	8	6%	9	-6%
GKM	Tăng	4	37%	10	12%	7	-5%
CAG	Tăng	4	34%	5	60%	11	-68%
API	Tăng	4	24%	6	56%	8	-21%
CLX	Tăng	4	12%	9	28%	14	-15%
DHG	Giảm	6	-10%	7	24%	7	-9%
PVM	Giảm	6	-7%	9	33%	6	-11%
VMD	Giảm	5	-30%	18	234%	5	-30%
HSV	Giảm	4	-8%	7	163%	5	-47%
STG	Giảm	4	-7%	5	40%	5	-22%
KHG	Giảm	4	-7%	2	21%	4	-31%
NDN	Giảm	4	-6%	5	17%	5	-22%
PVD	Giảm	4	-5%	12	50%	8	-27%
VRG	Giảm	3	-17%	10	34%	10	-26%
FIT	Giảm	3	-11%	12	84%	9	-45%
NED	Giảm	3	-6%	6	10%	11	-22%
TVB	Giảm	3	-6%	10	46%	7	-31%
HND	Giảm	3	-4%	7	9%	9	-5%
HDA	Giảm	3	-2%	6	54%	6	-14%
UIC	Giảm	3	-2%	10	45%	6	-7%

Bảng trên tổng hợp những cổ phiếu có chuỗi tăng/giảm dài nhất ở thời điểm hiện tại, với thanh khoản bình quân 10 phiên trên 2 tỷ đồng. Nhà đầu tư có thể tham khảo chuỗi tăng dài nhất trong lịch sử để đánh giá tiềm năng tăng giá của cổ phiếu trong những phiên tiếp theo hoặc tham khảo chuỗi giảm dài nhất trong lịch sử để cân nhắc cơ hội bắt đáy. Lưu ý: Dữ liệu này mang tính chất thống kê, **không** phản ánh khuyến nghị mua/bán của TCBS.

Thị trường tuần qua

Giá trị giao dịch bình quân/phiên tuần qua đạt 22,414 tỷ và số lượng cổ phiếu khớp lệnh bình quân đạt 713 triệu cổ phiếu, giảm 1% và tăng 3% so với tuần trước. VN-Index tăng 10.6 điểm, tương đương 0.8%. Độ rộng thị trường nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 224/157. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP tuần thứ 10 liên tiếp. HNX-Index tăng 6.7 điểm, tương đương 1.9%. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP tuần thứ 10 liên tiếp.

Nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 3,197 tỷ tuần qua trên cả 2 sàn, tập trung vào các cổ phiếu VHM (1822 tỷ), SSI (459 tỷ), VIC (440 tỷ), VNM (352 tỷ), API (287 tỷ),... Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở CTG (195 tỷ), MBB (191 tỷ), HSG (169 tỷ), VCB (157 tỷ), VND (137 tỷ). Thị trường tăng điểm do tác động của nhóm Ngân hàng, Tài nguyên Cơ bản, Dịch vụ tài chính, Du lịch và Giải trí, Bán lẻ,...

Các nhóm cổ phiếu tăng vượt trội tuần qua:

- Ngân hàng: TPB (+9%), VPB (+5%), EIB (+3%), TCB (+2%), BID (+2%)
- Chứng khoán: VCI (+6%), VND (+6%), FTS (+6%), SSI (+4%), SHS (+3%)
- Thép: HSG (+12%), NKG (+5%), HPG (+5%)
- Bán lẻ: DGW (+20%), PNJ (+10%), MWG (+8%)
- Hàng không: HVN (+20%), AST (+12%), ACV (+8%), SGN (+5%), VJC (+3%)
- Nông nghiệp: LTG (+5%), VHC (+4%), VHC (+4%), TAR (+3%)