

Báo cáo phân tích kỹ thuật ngày 14/09/2021

Tổng quan:

Phiên giao dịch 14/09 VN-Index mở cửa tăng 2 điểm sau phiên ATO. Dòng tiền đổ mạnh vào nhóm cổ phiếu vốn hóa lớn, giúp chỉ số áp sát mốc 1,350 điểm. Mặc dù vậy, áp lực chốt lời nhanh chóng xuất hiện, khiến thị trường thu hẹp đà tăng. Sang đến phiên chiều, chỉ số có phần rung lắc mạnh hơn khi nhiều cổ phiếu đồng loạt điều chỉnh, đặc biệt ở các nhóm ngành Ngân hàng và Chứng khoán. Trong bối cảnh thị trường chung giằng co, phân hóa, VN-Index đóng cửa trong sắc đỏ dưới mốc 1,340 điểm.

Kết thúc phiên giao dịch ngày 14/09/2021, VN-Index đóng cửa tại 1,339.7 điểm, giảm 1.7 điểm (tương đương 0.1%). Thanh khoản thị trường đạt 709 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 19,442 tỷ. Thị trường nghiêng về số mã giảm với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 167/234. Nhóm Ngân hàng và Dịch vụ tài chính là tác nhân chính khiến VN-Index giảm điểm. Ngoài ra, những nhóm ngành khác có sự giảm giá đáng kể là Tài nguyên Cơ bản, Hàng & Dịch vụ Công nghiệp, Bảo hiểm. Những cổ phiếu đóng góp chủ yếu vào đà giảm của VN-Index là: CTG (-0.8, -2.0%), HPG (-0.6, -1.0%), VPB (-0.6, -1.4%), BID (-0.5, -1.2%), TCB (-0.4, -0.9%),... Trên sàn HOSE, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 753 tỷ, tập trung chủ yếu ở HPG (196 tỷ), VCB (178 tỷ), MSN (90 tỷ), STB (88 tỷ), VHM (70 tỷ). Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở VIC (51 tỷ), VND (50 tỷ), DGC (40 tỷ), SAB (28 tỷ), KDH (27 tỷ). Xét theo nhóm ngành, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng mạnh nhất ở Hóa chất, Công nghệ Thông tin, Hàng & Dịch vụ Công nghiệp và bán ròng mạnh nhất ở Ngân hàng, Tài nguyên Cơ bản, Bất động sản.

HNX-Index giảm 1.2 điểm (tương đương 0.3%). Thanh khoản sàn HNX đạt 171 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 3,288 tỷ. Độ rộng thị trường sàn HNX nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 155/93.

Ngoài ra, TCBS thống kê một số cổ phiếu có tín hiệu nổi bật trong phiên giao dịch 14/09 như sau:

+) Tín hiệu Mua: MSH, STK, GIL, FRT, LAS

+) Tín hiệu Bán: HAX, AMV

+) Sức mạnh giá cao nhất 3 phiên gần đây: HVN (98), TVN (97), DGW (97), MWG (94), FTS (94)

+) Sức mạnh giá thấp nhất 3 phiên gần đây: NVB (2), KBC (3), DNH (3), HDB (4), IPA (5)

+) Tăng giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: VIF (3.1x), MCM (3.0x), MML (2.7x), BHN (2.6x), CRE (2.4x)

+) Giảm giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: DTK (3.5x), NVB (1.6x), PPC (1.5x), CTR (1.3x), POW (1.2x)

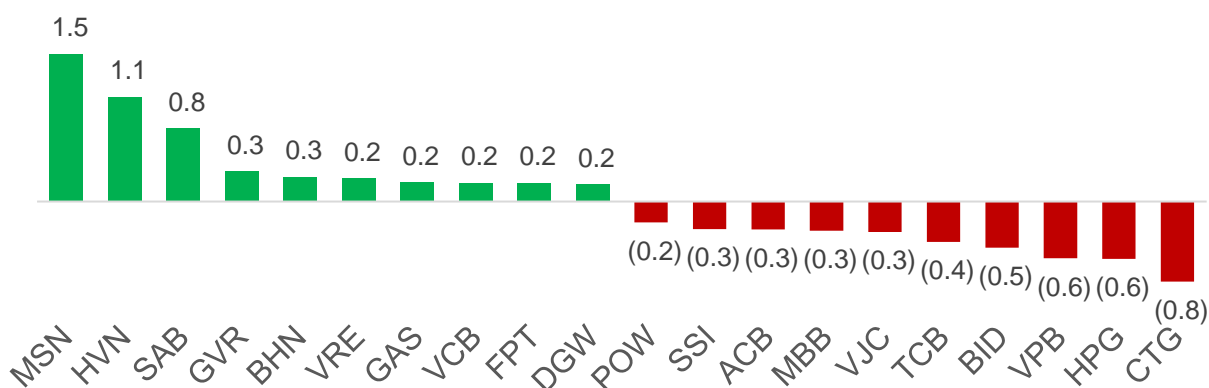
+) Tỷ trọng Cá mập mua chủ động nhiều nhất: E1VFN30 (92%), NVB (90%), FUEVFVND (77%), KDC (49%), IDC (46%)

+) Tỷ trọng Cá mập bán chủ động nhiều nhất: CRE (85%), VHM (70%), HPG (69%), SHB (54%), VPI (52%)

+) Tăng liên tiếp nhiều nhất: THD (15), TGG (13), PSD (13), KHB (11), ACG (10)

+) Giảm liên tiếp nhiều nhất: NDN (6), FIT (5), VRG (5), TVB (5), HND (5)

Nhóm cổ phiếu dẫn dắt thị trường



Danh mục cổ phiếu có tín hiệu MUA

Cổ phiếu	Điểm RS (i)	KLGĐ /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
May mặc								
MSH	82	133%	80	61	55%	0%	48%	52%
STK	82	185%	80	65	66%	0%	55%	45%
GIL	92	232%	70	74	44%	24%	52%	23%
Nhóm ngành khác								
FRT	82	130%	90	<60	62%	18%	43%	39%
LAS	89	202%	70	<60	54%	8%	34%	57%

MSH tăng 3.5%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu May mặc đang suy yếu. MSH 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 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 133% trung bình 10 ngày).

STK tăng 4.2%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu May mặc đang suy yếu. STK 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 67. 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 185% trung bình 10 ngày).

GIL tăng 6.9%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu May mặc đang suy yếu. GIL 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 72. 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 232% trung bình 10 ngày).

FRT tăng 4.4%, vượt đỉnh 52 tuần, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bán lẻ đang mạnh. FRT 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 68. 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 130% trung bình 10 ngày).

LAS tăng 7.9%, vượt đỉnh 52 tuần, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Hóa chất đang suy yếu. LAS 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 68. 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 202% trung bình 10 ngày).

Danh mục cổ phiếu có tín hiệu BÁN

Cổ phiếu	Điểm RS (i)	KLGD /TB 20 phiên	Điểm kỹ thuật (ii)	Điểm cơ bản (iii)	% bán chủ động	Cơ cấu bán chủ động (iv)		
						Cá mập	Sói già	Cừu non
HAX	20	124%	0	77	75%	0%	46%	54%
AMV	31	127%	0	<60	66%	24%	27%	49%

HAX giảm 3.5%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Ô tô và Phụ tùng đang suy yếu. Chỉ báo RSI đang giảm dần và chạm ngưỡng 41. Đường MACD nằm dưới đường Signal và MACD Histogram giảm dần. Ngoài ra, tín hiệu giảm giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 124% trung bình 10 ngày).

AMV giảm 5.2%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Dược phẩm đang suy yếu. Chỉ báo RSI đang giảm dần và chạm ngưỡng 48. Đường MACD nằm dưới đường Signal và MACD Histogram giảm dần. Ngoài ra, tín hiệu giảm giá cũng được xác nhận bởi yếu tố thanh khoản (khối lượng bằng 127% 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	15	4%	19	330%	6	-6%
TGG	Tăng	13	126%	14	126%	8	-36%
PSD	Tăng	13	77%	13	77%	5	-6%
KHB	Tăng	11	228%	11	228%	6	-6%
ACG	Tăng	10	14%	10	14%	4	-6%
VKC	Tăng	9	127%	9	127%	4	-17%
VOS	Tăng	9	66%	12	107%	7	-36%
TCO	Tăng	8	66%	8	66%	6	-34%
DGW	Tăng	7	37%	11	22%	5	-23%
HVN	Tăng	7	37%	8	6%	9	-6%
GKM	Tăng	6	63%	10	12%	7	-5%
CAG	Tăng	6	61%	6	61%	11	-68%
API	Tăng	6	43%	6	56%	8	-21%
DDV	Tăng	5	59%	7	77%	6	-13%
TDG	Tăng	5	41%	5	41%	9	-34%
NDN	Giảm	6	-10%	5	17%	6	-10%
FIT	Giảm	5	-23%	12	84%	9	-45%
VRG	Giảm	5	-20%	10	34%	10	-26%
TVB	Giảm	5	-9%	10	46%	7	-31%
HND	Giảm	5	-5%	7	9%	9	-5%
UIC	Giảm	5	-4%	10	45%	6	-7%
ABB	Giảm	5	-4%	6	28%	6	-8%
SHB	Giảm	5	-4%	9	87%	6	-31%
VTP	Giảm	5	-4%	7	15%	9	-9%
CTR	Giảm	5	-3%	10	29%	7	-7%
DBT	Giảm	4	-12%	9	70%	5	-12%
APH	Giảm	4	-9%	7	22%	5	-11%
HDB	Giảm	4	-7%	11	15%	5	-20%
TIP	Giảm	4	-7%	7	18%	6	-16%
DMC	Giảm	4	-6%	7	16%	8	-21%

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.