

Báo cáo phân tích kỹ thuật ngày 16/09/2021

Tổng quan:

Phiên giao dịch 16/09 mở cửa với tâm lý tương đối tích cực, VN-Index tăng 6 điểm sau phiên ATO. Mặc dù vậy, áp lực chốt lời quanh mốc 1,350 điểm nhanh chóng dâng cao, khiến thị trường thu hẹp đà tăng. Sang đến phiên chiều, thị trường bắt ngờ rung lắc với sự điều chỉnh ở nhiều cổ phiếu vốn hóa lớn, khiến VN-Index có thời điểm giảm 5 điểm từ mốc tham chiếu. Bước vào ATC, chỉ số không có sự biến động đáng kể, VN-Index đóng cửa trong sắc xanh nhẹ trong phiên đảo hạn phái sinh tháng 9.

Kết thúc phiên giao dịch ngày 16/09/2021, VN-Index đóng cửa tại 1,345.9 điểm, tăng 0.1 điểm (tương đương 0.0%). Thanh khoản thị trường đạt 578 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 18,007 tỷ. Thị trường nghiêng về số mã tăng với tỷ lệ mã tăng/giảm giá là 213/186. Nhóm Ngân hàng và Điện, nước & xăng dầu khí đốt đóng vai trò dẫn dắt đà tăng điểm của VN-Index. Ngoài ra, những nhóm ngành khác có sự tăng giá đáng kể là Thực phẩm và đồ uống, Hàng & Dịch vụ Công nghiệp, Bảo hiểm. Những cổ phiếu đóng góp chủ yếu vào đà tăng của VN-Index là: MSN (+1.5, +3.4%), VCB (+1.0, +1.0%), VRE (+0.9, +5.1%), VPB (+0.7, +1.7%), TCB (+0.7, +1.5%),... Trên sàn HOSE, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 1,270 tỷ, tập trung chủ yếu ở VIC (1,144 tỷ), DGW (83 tỷ), DGC (43 tỷ), VNM (40 tỷ), DPM (32 tỷ). Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở VRE (78 tỷ), MSN (47 tỷ), MBB (35 tỷ), GMD (33 tỷ), KDH (30 tỷ). Xét theo nhóm ngành, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng mạnh nhất ở Ngân hàng, Dịch vụ tài chính, Điện, nước & xăng dầu khí đốt và bán ròng mạnh nhất ở Bất động sản, Hóa chất, Thực phẩm và đồ uống.

HNX-Index tăng 2.4 điểm (tương đương 0.7%). Thanh khoản sàn HNX đạt 167 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 3,363 tỷ. Độ rộng thị trường sàn HNX nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng/giảm giá là 113/100.

Ngoài ra, TCBS thống kê một số cổ phiếu có tín hiệu nổi bật trong phiên giao dịch 16/09 như sau:

+) Tín hiệu Mua: BMI, TNG, KDH, MSN

+) Tín hiệu Bán: VIC, DGW

+) Sức mạnh giá cao nhất 3 phiên gần đây: DDV (100), VNR (99), DGW (96), BHN (94), HVN (94)

+) Sức mạnh giá thấp nhất 3 phiên gần đây: NVB (1), APH (6), GEX (6), HDB (7), VGC (7)

+) Tăng giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: KSV (5.0x), PGB (3.4x), VRE (2.8x), QNS (2.3x), KDH (2.2x)

+) Giảm giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: VIC (4.8x), MCM (2.3x), DGW (2.2x), VEF (1.8x), EIB (1.6x)

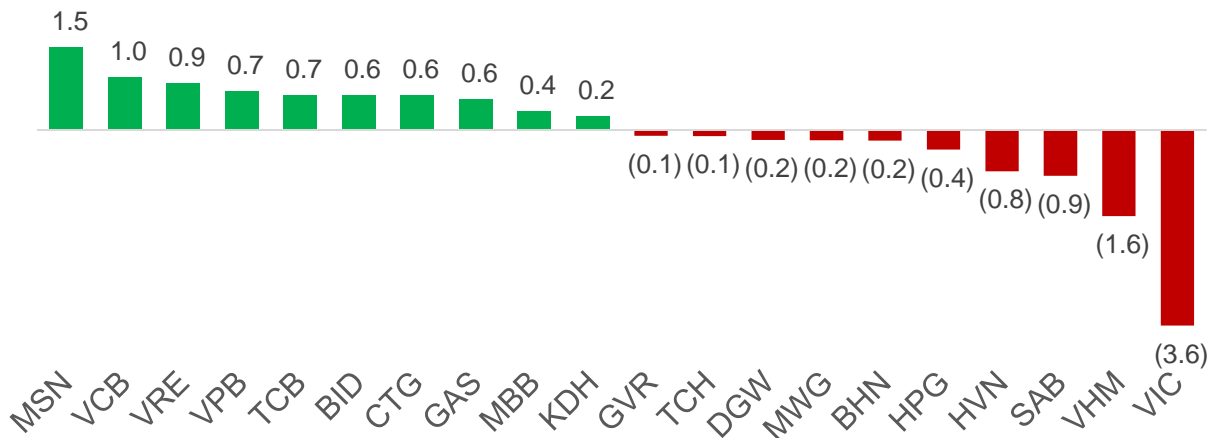
+) Tỷ trọng Cá mập mua chủ động nhiều nhất: E1VFN30 (94%), FUEVFN30 (71%), HPG (71%), KDC (57%), NVL (54%)

+) Tỷ trọng Cá mập bán chủ động nhiều nhất: NVB (89%), VHM (65%), VIC (63%), ACB (63%), MBB (59%)

+) Tăng liên tiếp nhiều nhất: SMT (19), THD (17), TGG (15), KHB (13), VKC (11)

+) Giảm liên tiếp nhiều nhất: SIP (6), DVP (5), SCG (4), NVB (4), MHC (4)

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
BMI	61	207%	80	<60	66%	16%	39%	45%
TNG	82	157%	80	<60	63%	10%	47%	43%
KDH	70	220%	80	<60	70%	31%	44%	25%
MSN	89	142%	80	<60	75%	38%	41%	21%

BMI tăng 5.8%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bảo hiểm đang suy yếu. BMI 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 62. 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 207% trung bình 10 ngày).

TNG tăng 5.4%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu May mặc đang ở trạng thái trung lập. TNG 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 69. 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 157% trung bình 10 ngày).

KDH tăng 3.6%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bất động sản đang suy yếu. KDH 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 66. 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 220% trung bình 10 ngày).

MSN tăng 3.4%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Thực phẩm đang suy yếu. MSN 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 142% trung bình 10 ngày).

Danh mục cổ phiếu có tín hiệu BÁN

Cổ phiếu	Điểm RS (i)	KLGĐ /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
VIC	9	477%	0	<60	56%	63%	26%	11%
DGW	97	218%	20	<60	64%	24%	49%	27%

VIC giảm 3.9%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bất động sản đang suy yếu. Chỉ báo RSI đang giảm dần và chạm ngưỡng 29. 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 477% trung bình 10 ngày).

DGW giảm 6.6%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Bán lẻ đang ở trạng thái trung lập. Chỉ báo RSI đang giảm dần và chạm ngưỡng 73. Đường MACD nằm trên 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 218% 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
SMT	Tăng	19	390%	19	390%	4	-21%
THD	Tăng	17	5%	19	330%	6	-6%
TGG	Tăng	15	158%	15	158%	8	-36%
KHB	Tăng	13	283%	13	283%	6	-6%
VKC	Tăng	11	173%	11	173%	4	-17%
TDG	Tăng	7	61%	7	61%	9	-34%
SJF	Tăng	7	49%	10	76%	11	-37%
KOS	Tăng	7	7%	16	12%	10	-15%
DHC	Tăng	7	5%	7	13%	9	-16%
PXT	Tăng	6	64%	11	104%	7	-36%
THT	Tăng	6	59%	6	59%	5	-25%
TVD	Tăng	6	58%	6	58%	4	-8%
NSH	Tăng	6	50%	8	81%	7	-36%
QBS	Tăng	6	49%	6	49%	8	-26%
KSH	Tăng	6	49%	7	75%	13	-18%
SIP	Giảm	6	-7%	9	324%	11	-11%
DVP	Giảm	5	-3%	7	18%	8	-11%
SCG	Giảm	4	-14%	10	265%	7	-10%
NVB	Giảm	4	-14%	8	39%	5	-17%
MHC	Giảm	4	-6%	8	63%	8	-5%
TCW	Giảm	4	-5%	9	17%	6	-17%
BNA	Giảm	4	-5%	5	9%	6	-14%
PHR	Giảm	4	-4%	7	27%	7	-8%
KLB	Giảm	4	-1%	8	12%	6	-19%
NTC	Giảm	3	-6%	12	14%	11	-17%
CLX	Giảm	3	-6%	9	28%	14	-15%
SBV	Giảm	3	-5%	6	22%	8	-27%
DQC	Giảm	3	-3%	6	36%	6	-14%
GIC	Giảm	3	-3%	7	35%	5	-17%
CAG	Giảm	2	-19%	6	61%	11	-68%

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.