

Báo cáo phân tích kỹ thuật ngày 17/09/2021

Tổng quan:

Phiên giao dịch cuối tuần mở cửa tăng 2 điểm sau ATO. Mặc dù áp lực chốt lời gia tăng khi chỉ số cán mốc 1,350 điểm, lực cầu đã nhanh chóng nhập cuộc, đẩy chỉ số bật tăng trở lại. Sang đến phiên chiều, VN-Index liên tục tăng tốc và có thời điểm tăng tới 11 điểm từ mốc tham chiếu. Dù phiên ATC có nhiều biến động đáng kể do hoạt động tái cấu trúc danh mục của các quỹ ETF, chỉ số vẫn trụ vững và đóng cửa trong sắc xanh. Tâm điểm của phiên giao dịch là các nhóm ngành Ngân hàng và Chứng khoán, với nhiều mã cổ phiếu đồng loạt tăng điểm tích cực.

Kết thúc phiên giao dịch ngày 17/09/2021, VN-Index đóng cửa tại 1,352.6 điểm, tăng 6.7 điểm (tương đương 0.5%). Thanh khoản thị trường đạt 823 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 25,742 tỷ. Thị trường nghiêng về số mã tăng với tỷ lệ mã tăng/giảm giá là 277/125. Nhóm Ngân hàng và Tài nguyên Cơ bản đóng vai trò dẫn dắt đà tăng điểm của VN-Index. Ngoài ra, những nhóm ngành khác có sự tăng giá đáng kể là Dịch vụ tài chính, Hóa chất, Du lịch và Giải trí. Những cổ phiếu đóng góp chủ yếu vào đà tăng của VN-Index là: VPB (+1.3, +3.1%), VHM (+1.3, +1.4%), HVN (+0.7, +4.9%), BID (+0.6, +1.5%), TPB (+0.6, +5.6%),... Trên sàn HOSE, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 1,240 tỷ, tập trung chủ yếu ở FUEVFNVD (261 tỷ), VIC (260 tỷ), SSI (174 tỷ), NVL (127 tỷ), VRE (126 tỷ). Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở VHM (193 tỷ), DIG (71 tỷ), VND (62 tỷ), DGC (35 tỷ), KDC (34 tỷ). Xét theo nhóm ngành, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng mạnh nhất ở Xây dựng và Vật liệu, Thực phẩm và đồ uống, Hóa chất và bán ròng mạnh nhất ở Bất động sản, Dịch vụ tài chính, Bán lẻ.

HNX-Index tăng 4.8 điểm (tương đương 1.3%). Thanh khoản sàn HNX đạt 173 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 4,046 tỷ. Độ rộng thị trường sàn HNX nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng/giảm giá là 139/97.

Ngoài ra, TCBS thống kê một số cổ phiếu có tín hiệu nổi bật trong phiên giao dịch 17/09 như sau:

+) Tín hiệu Mua: TPB, VND, PTB, DBC

+) Tín hiệu Bán: NBC

+) Sức mạnh giá cao nhất 3 phiên gần đây: SEA (99), VNR (98), DGC (89), MSN (88), MCM (83)

+) Sức mạnh giá thấp nhất 3 phiên gần đây: APH (4), NVB (4), MVN (5), SIP (12), DVN (14)

+) Tăng giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: SGB (6.3x), FUEVFVND (3.8x), HNG (3.3x), KLB (3.2x), VBB (3.0x)

+) Giảm giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: BVH (2.2x), VRE (1.9x), SBH (1.9x), KDH (1.7x), SJS (1.6x)

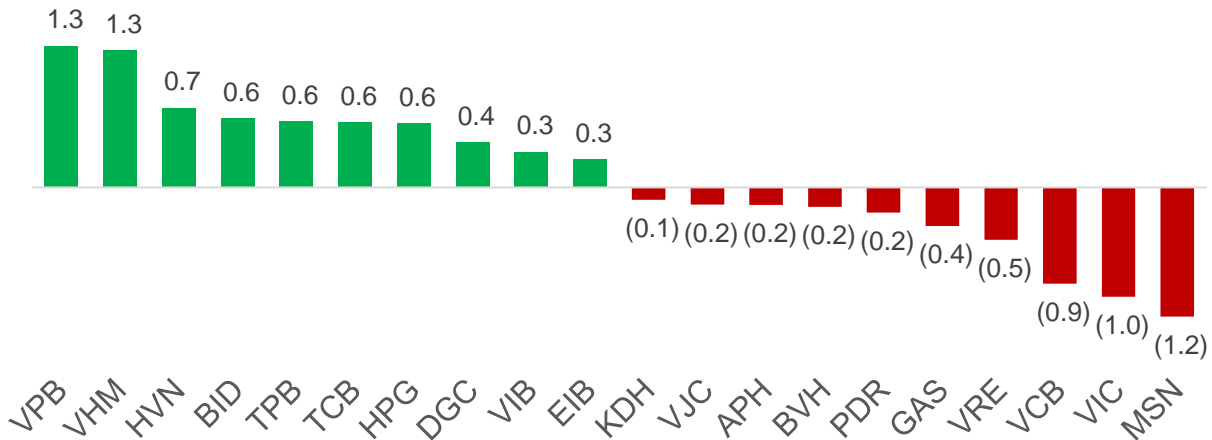
+) Tỷ trọng Cá mập mua chủ động nhiều nhất: FUEVFVND (94%), E1VFN30 (70%), TPB (68%), VPB (61%), KDC (61%)

+) Tỷ trọng Cá mập bán chủ động nhiều nhất: SHB (64%), HPG (63%), STB (63%), DHC (58%), THD (57%)

+) Tăng liên tiếp nhiều nhất: SMT (20), THD (18), TGG (16), KHB (14), VKC (12)

+) Giảm liên tiếp nhiều nhất: SCG (5), GIC (4), CAG (3), RDP (3), PSP (3)

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
TPB	78	148%	80	65	74%	68%	21%	11%
VND	75	144%	70	73	63%	56%	30%	14%
PTB	71	472%	80	60	65%	25%	51%	23%
DBC	59	213%	80	<60	63%	34%	40%	26%

TPB tăng 5.6%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Ngân hàng đang suy yếu. TPB 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 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 148% trung bình 10 ngày).

VND tăng 3.0%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Chứng khoán đang suy yếu. VND 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 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 144% trung bình 10 ngày).

PTB tăng 7.0%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Vật liệu đang ở trạng thái trung lập. PTB 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 472% trung bình 10 ngày).

DBC tăng 3.5%, vượt đỉnh lịch sử, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Nông nghiệp đang ở trạng thái trung lập. DBC 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 213% 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
NBC	99	123%	30	78	56%	0%	30%	70%

NBC giảm 7.0%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Khoáng sản đang ở trạng thái trung lập. Chỉ báo RSI đang giảm dần và chạm ngưỡng 71. 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 123% 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	20	413%	20	413%	4	-21%
THD	Tăng	18	5%	19	330%	6	-6%
TGG	Tăng	16	176%	16	176%	8	-36%
KHB	Tăng	14	332%	14	332%	6	-6%
VKC	Tăng	12	200%	12	200%	4	-17%
KOS	Tăng	8	10%	16	12%	10	-15%
DHC	Tăng	8	5%	8	5%	9	-16%
PXT	Tăng	7	82%	11	104%	7	-36%
VNR	Tăng	7	57%	7	57%	4	-4%
ELC	Tăng	7	20%	8	17%	8	-22%
HTN	Tăng	7	12%	8	22%	6	-4%
FMC	Tăng	7	8%	7	12%	6	-15%
TC6	Tăng	6	65%	9	63%	5	-13%
TDH	Tăng	6	48%	8	34%	10	-27%
DGT	Tăng	6	42%	6	74%	7	-37%
SCG	Giảm	5	-16%	10	265%	7	-10%
GIC	Giảm	4	-3%	7	35%	5	-17%
CAG	Giảm	3	-27%	6	61%	11	-68%
RDP	Giảm	3	-14%	9	64%	5	-21%
PSP	Giảm	3	-12%	8	40%	6	-18%
VPH	Giảm	3	-6%	8	32%	8	-8%
VIC	Giảm	3	-6%	8	13%	7	-9%
TNH	Giảm	3	-4%	6	10%	6	-19%
PSH	Giảm	3	-3%	8	35%	5	-25%
DC4	Giảm	3	-3%	8	46%	7	-11%
DLG	Giảm	3	-2%	10	84%	8	-16%
DPR	Giảm	3	-2%	7	13%	8	-6%
SSH	Giảm	3	-2%	10	297%	3	-19%
PGT	Giảm	2	-19%	13	220%	5	-35%
DDV	Giảm	2	-17%	7	77%	6	-13%

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 21,022 tỷ và số lượng cổ phiếu khớp lệnh bình quân đạt 706 triệu cổ phiếu, giảm lần lượt 6% và 1% so với tuần trước. VN-Index tăng 7.3 điểm, tương đương 0.5%. Độ rộng thị trường nghiêng về số cổ phiếu tăng giá với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 250/131. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP tuần thứ 11 liên tiếp. HNX-Index tăng 7.9 điểm, tương đương 2.3%. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP tuần thứ 11 liên tiếp.

Nhà đầu tư nước ngoài bán ròng 3,021 tỷ tuần qua trên cả 2 sàn, tập trung vào các cổ phiếu VIC (1553 tỷ), HPG (231 tỷ), VCB (216 tỷ), STB (112 tỷ),... Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng nhiều nhất ở THD (600 tỷ), VND (184 tỷ), SAB (110 tỷ), KDH (96 tỷ), PVS (91 tỷ). Thị trường tăng điểm do tác động của nhóm Thực phẩm và đồ uống, Điện, nước & xăng dầu khí đốt, Bán lẻ, Tài nguyên Cơ bản, Công nghệ Thông tin,...

Các nhóm cổ phiếu tăng vượt trội tuần qua:

- *Thực phẩm: MSN (+12%), SAB (+6%), GTN (+5%)*
- *Dầu khí: PVD (+12%), PVS (+11%), BSR (+6%), OIL (+4%), GAS (+4%)*
- *Bán lẻ: FRT (+15%), DGW (+13%), MWG (+3%)*
- *Hóa chất: CSV (+23%), DGC (+21%), LAS (+7%), PLC (+3%)*
- *May mặc: GIL (+10%), MSH (+6%), TNG (+5%), STK (+5%), VGT (+5%)*
- *Vật liệu: BCC (+7%), PTB (+6%), HT1 (+6%), VCS (+4%), NNC (+3%)*