

Báo cáo phân tích kỹ thuật ngày 14/01/2022

Tổng quan:

Tiếp nối đà tiêu cực, phiên giao dịch cuối tuần mở cửa tạo một khoảng trống giảm giá lên tới 19 điểm sau phiên ATO. Mặc dù vậy, lực cầu bắt đáy nhanh chóng nhập cuộc, giúp chỉ số lấy lại sắc xanh. Sang đến phiên chiều, VN-Index có những nỗ lực đáng kể để bứt phá khỏi ngưỡng 1,500 điểm, tuy nhiên không thành công. Trong bối cảnh đó, nhóm ngành Xây dựng trở thành tâm điểm với nhiều mã tăng điểm tích cực, thậm chí chạm trần.

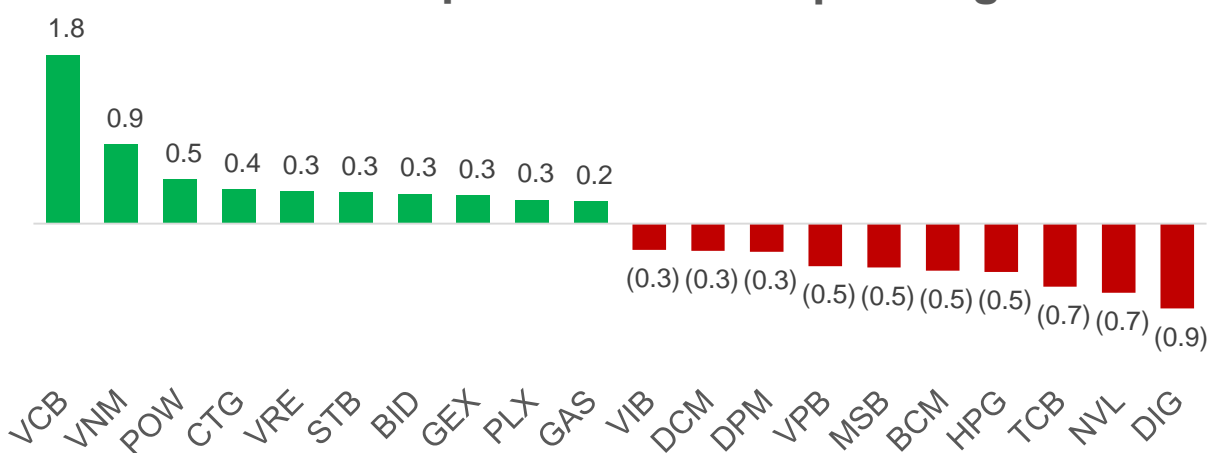
Kết thúc phiên giao dịch ngày 14/01/2022, VN-Index đóng cửa tại 1,496.0 điểm, giảm 0.1 điểm (tương đương 0.0%). Thanh khoản thị trường đạt 764 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 22,844 tỷ. Thị trường nghiêng về số mã giảm với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 174/285. Nhóm Bất động sản và Tài nguyên Cơ bản là tác nhân chính khiến VN-Index giảm điểm. Ngoài ra, những nhóm ngành khác có sự giảm giá đáng kể là Hóa chất, Dịch vụ tài chính, Công nghệ Thông tin. Những cổ phiếu đóng góp chủ yếu vào đà giảm của VN-Index là: DIG (-0.9, -6.9%), NVL (-0.7, -1.8%), TCB (-0.7, -1.5%), HPG (-0.5, -1.0%), BCM (-0.5, -2.4%),... Trên sàn HOSE, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng 768 tỷ, tập trung chủ yếu ở FUEVFVND (122 tỷ), STB (118 tỷ), VNM (81 tỷ), VCB (67 tỷ), HPG (57 tỷ). Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng nhiều nhất ở VND (34 tỷ), VCI (23 tỷ), VPB (18 tỷ), GMD (17 tỷ), VRE (16 tỷ). Xét theo nhóm ngành, nhà đầu tư nước ngoài mua ròng mạnh nhất ở Ngân hàng, Thực phẩm và đồ uống, Bất động sản và bán ròng mạnh nhất ở Dịch vụ tài chính, Hàng cá nhân & Gia dụng, Dầu khí.

HNX-Index tăng 6.1 điểm (tương đương 1.3%). Thanh khoản sàn HNX đạt 94 triệu cổ phiếu khớp lệnh, tương ứng giá trị giao dịch xấp xỉ 2,932 tỷ. Độ rộng thị trường sàn HNX nghiêng về số cổ phiếu giảm giá với tỷ lệ mã tăng giá/mã giảm giá là 123/126.

Ngoài ra, TCBS thống kê một số cổ phiếu có tín hiệu nổi bật trong phiên giao dịch 14/01 như sau:

- + Tín hiệu Bán: DIG, DPM
- + Sức mạnh giá cao nhất 3 phiên gần đây: L14 (97), TID (96), AGG (95), BCM (94), SGB (94)
- + Sức mạnh giá thấp nhất 3 phiên gần đây: EVF (0), ROS (4), AAA (5), TVS (6), FLC (8)
- + Tăng giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: SJS (3.4x), NTP (1.8x), DHC (1.5x), GEX (1.4x), L14 (1.3x)
- + Giảm giá, đi kèm với khối lượng tăng đột biến so với trung bình 10 phiên: KOS (2.4x), DIG (2.0x), LDG (1.6x), FCN (1.6x), HNG (1.6x)
- + Tỷ trọng Cá mập mua chủ động nhiều nhất: E1VFN30 (92%), GEX (64%), DIG (63%), PDR (63%), HAG (62%)
- + Tỷ trọng Cá mập bán chủ động nhiều nhất: NVL (78%), VPB (58%), TCB (54%), VHM (53%), SIP (53%)
- + Tăng liên tiếp nhiều nhất: LHC (6), BID (4), DBD (4), TSC (3), FRT (3)
- + Giảm liên tiếp nhiều nhất: TGG (7), DCM (7), VNA (7), PAN (7), ANV (7)

Nhóm cổ phiếu dẫn dắt thị trường



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
DIG	72	195%	0	<60	27%	58%	29%	13%
DPM	22	127%	0	82	75%	52%	32%	16%

DIG giảm 6.9%, 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 51. 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 195% trung bình 10 ngày).

DPM giảm 6.9%, trong bối cảnh tín hiệu kỹ thuật chung của nhóm cổ phiếu Hóa chất 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 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
LHC	Tăng	6	44%	7	33%	5	-4%
BID	Tăng	4	14%	7	12%	7	-9%
DBD	Tăng	4	6%	7	5%	7	-6%
TSC	Tăng	3	12%	8	41%	10	-11%
FRT	Tăng	3	10%	8	60%	8	-17%
MSH	Tăng	3	8%	8	6%	8	-19%
CTG	Tăng	3	7%	8	37%	8	-13%
SHB	Tăng	3	7%	9	87%	6	-31%
SSB	Tăng	3	7%	7	40%	5	-14%
VCB	Tăng	3	5%	9	10%	8	-11%
DQC	Tăng	3	4%	7	14%	6	-14%
DGW	Tăng	3	2%	11	22%	5	-23%
SDA	Tăng	2	20%	11	127%	10	-59%
KSF	Tăng	2	20%	6	63%	4	-9%
SCG	Tăng	2	8%	10	265%	7	-10%
TGG	Giảm	7	-28%	19	220%	14	-62%
DCM	Giảm	7	-22%	7	28%	8	-20%
VNA	Giảm	7	-20%	18	160%	9	-31%
PAN	Giảm	7	-17%	8	34%	10	-11%
ANV	Giảm	7	-15%	6	36%	7	-17%
TCI	Giảm	7	-15%	10	172%	7	-15%
NAF	Giảm	7	-12%	10	24%	7	-12%
SBS	Giảm	7	-11%	12	231%	7	-11%
PVM	Giảm	7	-7%	9	33%	7	-8%
DAG	Giảm	6	-27%	23	175%	6	-27%
VEC	Giảm	6	-23%	10	100%	8	-11%
TVS	Giảm	6	-23%	7	44%	6	-23%
DDV	Giảm	6	-22%	7	77%	6	-22%
AMS	Giảm	6	-17%	9	39%	7	-19%
NDN	Giảm	6	-13%	6	14%	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 33,397 tỷ và số lượng cổ phiếu khớp lệnh bình quân đạt 1,079 triệu cổ phiếu, tăng lần lượt 4% và 9% so với tuần trước. VN-Index giảm 32.5 điểm, tương đương 2.1%. Số mã giảm áp đảo số mã tăng với tỷ lệ 312/80. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP tuần thứ 7 liên tiếp. HNX-Index giảm 26.9 điểm, tương đương 5.5%. Chỉ báo RSI ở mức TRUNG LẬP.

Nhà đầu tư nước ngoài mua ròng 817 tỷ tuần qua trên cả 2 sàn, tập trung vào các cổ phiếu VHM (252 tỷ), KDH (203 tỷ), DXG (202 tỷ), VIC (177 tỷ), VCB (169 tỷ),... Ở chiều ngược lại, nhà đầu tư nước ngoài bán ròng nhiều nhất ở VRE (256 tỷ), CII (240 tỷ), NVL (161 tỷ), VND (104 tỷ), VCI (103 tỷ). Thị trường giảm điểm do tác động của nhóm Bất động sản, Hóa chất, Dịch vụ tài chính, Thực phẩm và đồ uống, Xây dựng và Vật liệu,...

Các nhóm cổ phiếu giảm điểm mạnh tuần qua:

- Chứng khoán: VCI (-14%), VND (-10%), FTS (-9%), SHS (-8%), MBS (-8%)
- Hóa chất: LAS (-19%), DCM (-18%), DPM (-14%), BFC (-10%), CSV (-9%)
- Tiện ích: POW (-12%), GEX (-10%), NT2 (-10%), PC1 (-7%), QTP (-7%)
- Cảng biển: GMD (-11%), SGP (-10%), VSC (-8%), PHP (-7%), HAH (-7%)
- Xây dựng: DPG (-12%), HBC (-11%), VCG (-9%), CTD (-6%), CTR (-5%)
- May mặc: VGT (-11%), TNG (-9%), STK (-7%)
- Nông nghiệp: CMX (-13%), ASM (-10%), VHC (-6%), TAR (-4%), LTG (-4%)
- Vật liệu: VGC (-11%), BCC (-6%), VCS (-5%), HT1 (-4%)