

Phân tích kỹ thuật : Ứng dụng của Fibonacci

Trước khi tìm hiểu về tác dụng của dãy số Fibonacci với tỷ lệ vàng của nó, chúng ta hãy tìm hiểu về Leonardo Fibonacci.

Ông là một nhà toán học nổi tiếng của Ý, sống vào khoảng thế kỷ 12 sau công nguyên. Ông đã khám phá ra một chuỗi số đơn giản nhưng lại tạo ra tỷ lệ vàng của hầu hết mọi thứ trong vũ trụ.

Dãy số này đơn giản chỉ bắt đầu bằng các con số: 0, 1, 1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55, 89, 144...

Quy tắc của dãy số này là bắt đầu bằng hai số là 0 và 1, rồi số liền kề sau sẽ được tạo ra bằng tổng 2 số liền kề trước.

Ví dụ như $1 = 0 + 1$, $2 = 1 + 1$, $3 = 2 + 1$, $5 = 3 + 2$, $8 = 5 + 3$... cứ như vậy cho đến vô cùng.

Từ các con số trên, có thể thấy một số tỷ lệ được xuất hiện khi chia các con số trong dãy như:

Tỷ lệ thường thấy và quan trọng nhất là tỷ lệ vàng 1.618 được xuất hiện bằng cách lấy số liền sau chia số liền trước (không áp dụng cho vài số đầu tiên trong dãy Fibonacci)

Ví dụ:

$$\cdot 89 / 55 = 1.61818 \sim 1.618$$

$$\cdot 144 / 89 = 1.61797 \sim 1.618$$

Bên cạnh đó là tỷ lệ 0.382:

$$\cdot 34 / 89 \sim 0.382$$

Tỷ lệ 0.5

$$\cdot 1 / 2 = 0.5$$

Tỷ lệ 0.236:

$$\cdot 8/34 = 0.236$$

Nhìn chung, có thể kết luận về dãy số Fibonacci như sau:

Fibonacci Retracement Levels – Các mức Fibonacci hồi lại

0.236, 0.382, 0.5, 0.618, 0.786 (có nơi sử dụng 0.764)

Fibonacci Extensio Levels – Các mức Fibonacci mở rộng 0, 0.382, 0.618, 1.000, 1.382, 1.618

Thực sự bạn không cần phải nắm hết cách tính ra các con số này vì phần mềm giao dịch của bạn sẽ tự làm điều đó rồi. Tuy nhiên, nắm những lý thuyết cơ bản về chỉ số này sẽ giúp bạn hiểu rõ hơn về công cụ mình đang dùng

Người giao dịch sử dụng Fibonacci retracement – Fibo hồi – như là những vùng hỗ trợ và kháng cự tiềm năng.

Nhiều người giao dịch sử dụng Fibonacci Extension – Fibo mở rộng – như là các mức chốt lời.

Để sử dụng được các Fibo này trên biểu đồ, bạn cần xác định giá thấp nhất và cao nhất

1. Fibonacci hồi lại – Fibonacci retracement

Điều đầu tiên bạn cần biết là công cụ fibonacci thường làm việc tốt nhất khi thị trường có xu hướng rõ ràng

Ý tưởng ở đây là bạn sẽ đặt lệnh mua dựa vào sự hồi lại của giá tại các mức hỗ trợ do fibonacci tạo ra khi mà thị trường đang đi lên, và sẽ đặt lệnh bán ra cũng dựa vào sự hồi lại của giá tại các mức kháng cự do Fibonacci tạo ra khi thị trường đang đi xuống

Để tìm ra các mức hồi lại này, bạn cần xác định được đỉnh và đáy gần nhất trên biểu đồ. Sau đó, đối với xu hướng giảm, bạn sẽ kéo Fibonacci retracement từ đỉnh xuống đáy, còn đối với hướng tăng thì kéo từ đáy lên đỉnh.

Bạn hãy xem các ví dụ dưới đây sẽ rõ hơn

Xu hướng tăng

Đây là biểu đồ ngày của AUDUSD



Chúng ta đặt Fibonacci retracement bằng cách bấm chọn điểm thấp nhất là 0.6955 ngày 20.04 và kéo lên điểm cao nhất là 0.8264 vào 03.06. Việc vẽ này đã có phần mềm hỗ trợ

Bạn có thể thấy trên biểu đồ là các mức hồi lại như sau:
0.7955 (23.6%), 0.7764 (38.2%), 0.7609 (50.0%), 0.7454 (61.8%) và 0.7263 (76.4%)

Bây giờ, chúng ta sẽ mong chờ rằng nếu giá AUDUSD giảm từ đỉnh xuống, nó sẽ gặp hỗ trợ tại các mức Fibo đã nhắc ở trên bởi vì nhiều người giao dịch sẽ đặt lệnh mua tại các mức này khi mà giá hồi lại

Chúng ta hãy xem điều gì xảy ra sau khi giá điều chỉnh giảm



Giá phá mức hỗ trợ 23.6 và tiếp tục giảm trong vài tuần sau đó. Nó đã chạm vào mức 38.2% nhưng không thể đóng cửa dưới vùng giá này

Sau đó, khoảng ngày 14.07, thị trường quay lại hướng tăng và còn phá vỡ cả đỉnh cao cũ. Rõ ràng là đặt lệnh mua ở Fibo 38.2 là một chiến lược giao dịch có lợi nhuận tốt

Xu hướng giảm

Bây giờ xem ví dụ về việc sử dụng Fibonacci retracement với xu hướng giảm, ví dụ với biểu đồ khung thời gian 4 giờ của EURUSD



Như bạn thấy, đỉnh cao nhất là 1.4195 vào ngày 26.01 và đáy thấp nhất là 1.3854 vào ngày 02.02. Các mức hồi lại là 1.3933 (23.6%), 1.3983 (38.2%), 1.4023 (50.0%), 1.4064 (61.8%), 1.4114 (76.4%)

Kỳ vọng ở đây là việc xu hướng giảm sẽ có điều chỉnh tăng nhẹ trở lại và chạm vào 1 trong các mức Fibo nói trên trước khi quay lại xu hướng giảm tiếp

Hãy xem điều gì xảy ra tiếp



Có thể thấy vùng Fibo 50% đã kháng cự tốt và chúng ta đã có lợi nhuận nếu đặt lệnh bán ở vùng này

Có thể thấy rằng trong 2 ví dụ trên, giá đã nhận được hỗ trợ hoặc kháng cự từ các mức Fibonacci retracement. Tuy nhiên, một điều cần lưu ý rằng không phải lúc nào giá cũng bật lại từ các mức Fibonacci. Đây chỉ nên được xem là các vùng cần chú ý. Chúng ta sẽ kết hợp thêm nhiều yếu tố khác cho việc giao dịch với Fibo này sau.

2.Khi Fibonacci sai

Hãy xem ví dụ bên dưới đối với biểu đồ 4H của GBPUSD

Bạn có thể thấy cặp tiền này đang ở trong xu hướng giảm, nên bạn quyết định dùng fibonacci Retracement để tìm điểm đặt lệnh bán. Bạn dùng đỉnh 1.5383 và đáy 1.4799 để kéo Fibo

Chúng ta thấy rằng giá quay lại mức Fibo 50% sau đó vài cây nến và bạn thấy rằng mức Fibo này đang kháng cự giá khá tốt. Bạn quyết định đặt lệnh bán tại đây



Hãy xem điều gì xảy ra sau đó





Giá tăng lên mạnh, phá vỡ đỉnh trước đó và thị trường bây giờ đã đi theo xu hướng tăng

Bài học rút ra ở đây là gì?

Mặc dù các mức Fibonacci có thể cho bạn khả năng thành công cao hơn nhưng nó cũng như những công cụ chỉ báo khác là không phải lúc nào cũng đúng. Bạn sẽ không biết được rằng liệu giá có dừng lại ở 38.2 hay không. Có thể nó sẽ chạm 50 hoặc 61.8 trước khi quay đầu hoặc nhiều khi nó sẽ chẳng quay đầu sau khi đã chạm các mức này.

Một vấn đề khác của việc sử dụng Fibonacci là vấn đề chọn đỉnh nào và đáy nào để vẽ Fibo.

Mỗi người đều có một cách nhìn biểu đồ khác nhau, cách dùng khung thời gian giao dịch khác nhau, quan điểm về phân tích cơ bản khác nhau. Vì vậy, đôi khi việc xác định được các điểm để vẽ Fibonacci retracement là khá phức tạp và không có một

phương pháp chuẩn nào cho việc này, đặc biệt là khi biểu đồ cũng không mấy rõ ràng. Nó tùy thuộc kinh nghiệm mỗi người và đôi khi trở thành trò chơi “phán đoán”. Vì vậy, bạn cần rèn dũa liên tục kỹ năng của bạn và kết hợp Fibonacci với những công cụ khác nhằm có thể đem lại mức độ thành công cao hơn

Chúng ta sẽ học phương pháp kết hợp Fibonacci với những thứ khác như Hỗ trợ và Kháng cự hay mô hình nền

3.Kết hợp Fibonacci với hỗ trợ và kháng cự

Fibonacci luôn là một công cụ rất hiệu quả, nhưng như đã nói, việc sử dụng chỉ một mình Fib riêng lẻ có thể sẽ không đem lại hiệu quả cao. Vì vậy, chúng ta sẽ thử kết hợp nó với Hỗ trợ và Kháng cự nhằm tăng thêm mức độ hiệu nghiệm xem sao.

Nếu bản thân Fib đã là những mức hỗ trợ hoặc kháng cự và chúng ta kết hợp nó với những vùng giá mà những người giao dịch khác đang đợi để mua hoặc bán (các vùng hỗ trợ và kháng cự) thì rõ ràng khả năng giá bật lại từ vùng đó sẽ lớn hơn rất nhiều

Hãy xem ví dụ về việc kết hợp hỗ trợ và kháng cự với các mức Fib. Dưới đây là biểu đồ ngày của USDCHF



Như bạn thấy, rõ là USDCHF có một xu hướng tăng và chúng ta quyết định rằng sẽ đợi MUA USDCHF. Câu hỏi đặt ra là “chúng ta sẽ mua ở đâu?”. Fib được dùng để trả lời câu hỏi này khi được căng từ vùng thấp 1.0132 ngày 11.01 đến vùng cao 1.0899 ngày 19.02.

Bây giờ hãy xem lại biểu đồ USDCHF sau khi Fib được căng ra



Nhìn vào biểu đồ bên trên và hãy để ý vùng giá 1.0510. Đây là vùng giá đã tạo kháng cự trước đó và bây giờ lại trùng khớp với Fib retracement 50%. Vùng kháng cự 1.0510 cũ đã bị phá vỡ, bây giờ, nó có thể sẽ đóng vai trò hỗ trợ và thành điểm mua đẹp



Nếu bạn mua quanh khu vực Fib 50% thì có vẻ là một quyết định tốt. Hãy xem lần chạm thứ 2 của giá vào vùng này. Giá đã cố gắng xuyên thủng vùng này nhưng lại không thể đóng cửa phía dưới. Sau đó, giá đi lên và phá luôn đỉnh cũ

Vì sao có chuyện này?

Đầu tiên, như chúng ta đã thảo luận trong Lớp 1, các mức hỗ trợ hoặc kháng cự cũ là những vùng tốt để đặt lệnh mua hoặc bán bởi vì những người giao dịch khác sẽ chú ý vào những vùng này.

Thứ hai, chúng ta biết rằng có khá nhiều người giao dịch cũng

sử dụng fibonacci nên có thể họ cũng đang đợi mua bán tại các vùng Fib như chúng ta. Nếu kết hợp với cả Hỗ trợ và kháng cự thì rõ ràng sẽ có nhiều lệnh hơn được đặt mua ở các vùng đó và giá có thể sẽ đi như chúng ta mong muốn

Tất nhiên là không có gì đảm bảo cho việc giá sẽ bật lại từ các vùng chúng ta phân tích nhưng ít nhất chúng ta sẽ có sự tự tin hơn nếu phân tích được rõ ràng như trên. Cần ghi nhớ rằng việc giao dịch là dựa vào các khả năng có thể xảy ra chứ không có gì chắc chắn, vì vậy chúng ta cần chọn cho mình những điểm vào lệnh có khả năng chiến thắng cao hơn bình thường

4. Kết hợp Fibonacci với đường xu hướng (trendline)

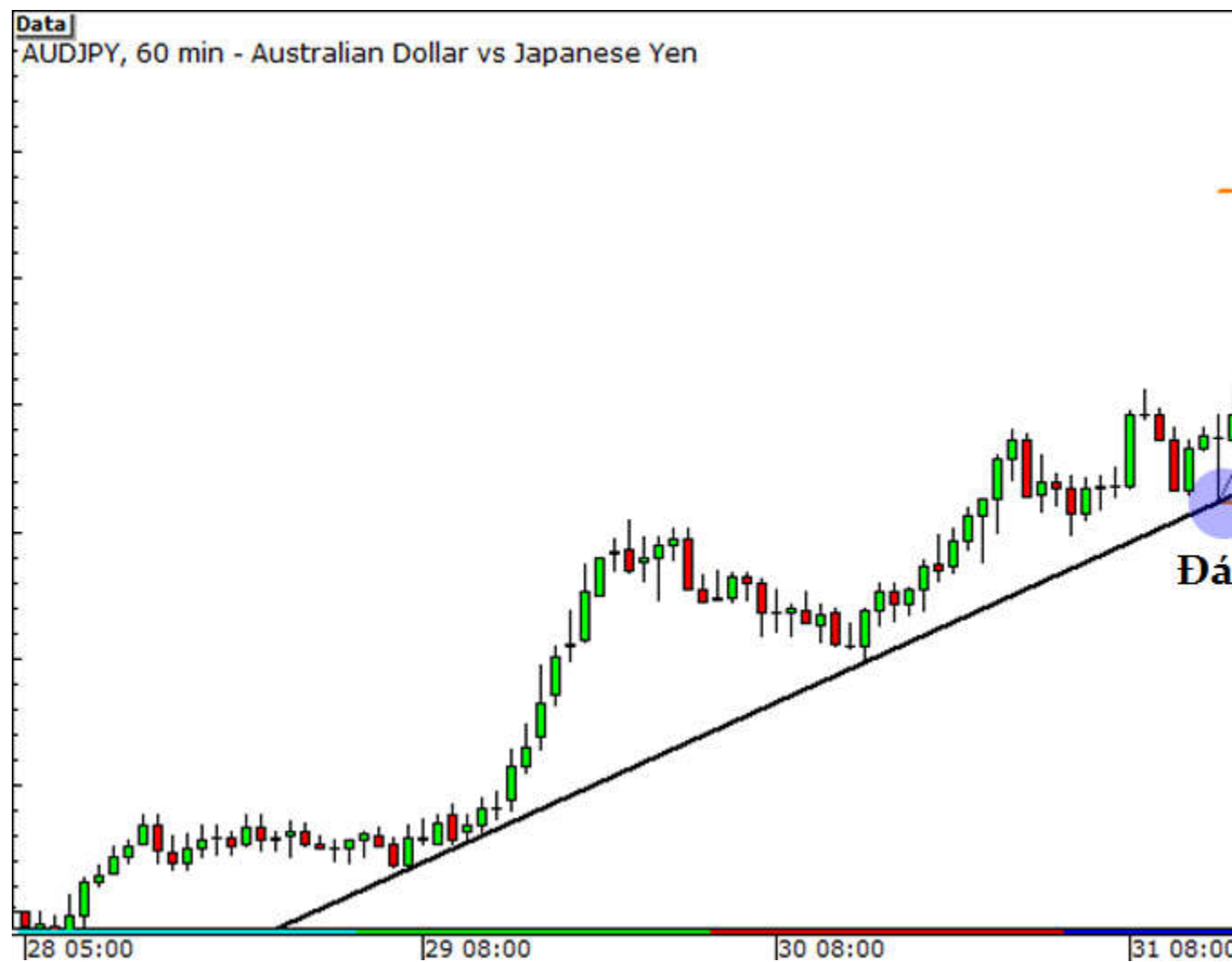
Một công cụ khác kết hợp rất tốt với fibonacci là đường xu hướng. Chúng ta biết rằng việc sử dụng Fib là nhằm tìm các điểm hỗ trợ và kháng cự trong một xu hướng tăng hoặc giảm. Đường xu hướng cũng có tác dụng như vậy. Vậy nếu có thể kết hợp được 2 yếu tố này lại với nhau thì rõ ràng hiệu quả sẽ tăng lên nhiều

Hãy xem ví dụ với cặp tiền AUDJPY dưới đây ở chart 1H. Giá đang được đường xu hướng bên dưới hỗ trợ rất tốt

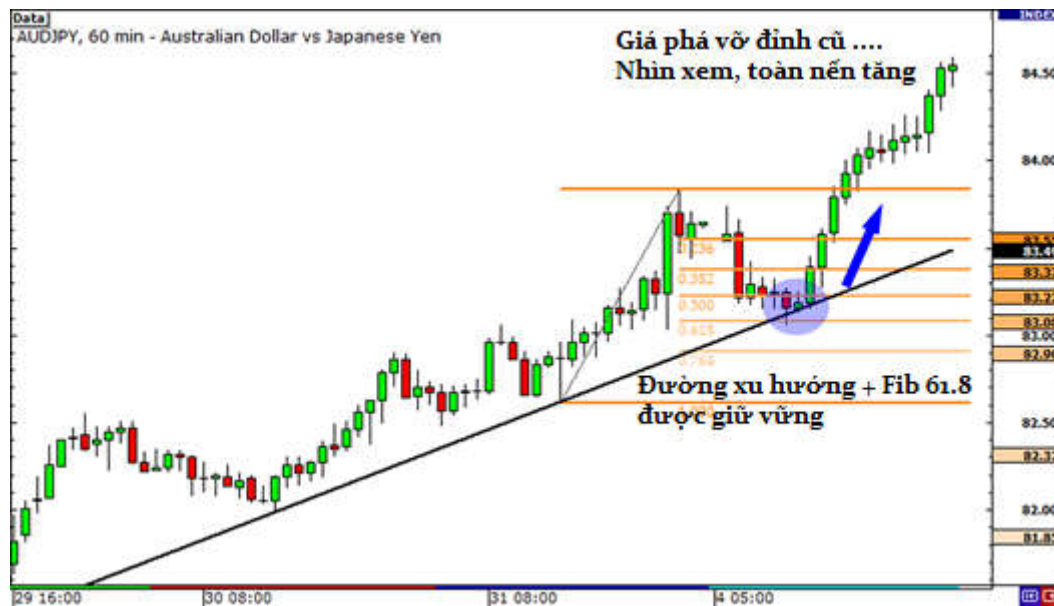


Để tìm điểm vào lệnh theo Fib retracement, chúng ta căng Fib cho vùng đáy 82.61 và vùng đỉnh 83.84. Hãy chú ý vùng Fib 50% và 61.8% giao nhau với đường xu hướng tăng

Xem tiếp diễn biến bên dưới



Bạn thấy không, Fib 61.8% đã không bị xuyên thủng và giá chỉ chạm vào đây trước khi quay đầu lên đi tiếp, phá cả đỉnh cao trước đó



Việc vẽ đường xu hướng – tất nhiên sẽ có rất nhiều ý kiến khác nhau do cách chọn đỉnh đáy khác nhau, tuy nhiên, rõ ràng sự kết hợp giữa Fib và đường xu hướng là một công cụ mà bạn không nên bỏ qua.

5. Kết hợp Fibonacci với mô hình nền

Khi kết hợp Fib với mô hình nền, chúng ta cần tìm các mô hình nền đảo chiều vì một khi giá muốn đảo chiều tức là nó sẽ xoay chiều về hướng ngược lại, tức là hướng thuận với xu hướng chủ đạo trước đó

Hãy xem ví dụ ở chart 1H của EURUSD dưới đây



Cặp tiền này đang nằm trong xu hướng giảm trong tuần trước nhưng đà giảm đã dừng lại. Điều này làm chúng ta suy nghĩ về việc tìm điểm vào cho lệnh bán để phù hợp với xu hướng giảm trước đó. Hãy lấy fibonacci ra và căng từ đỉnh 1.3364 ngày 03.03 xuống đáy 1.2523 ngày 06.03

Xem kết quả nhé



Giá có dừng lại 1 chút ở Fib 50% nhưng sau đó tăng tiếp đến Fib 61.8%. Sau đó giá hình thành một mô hình nền đảo chiều là doji bóng dài (long-legged-doji). Điều này gợi ý về khả năng kháng cự tốt của Fib 61.8 cũng như áp lực đẩy giá lên đường như đã hết và tạo cơ hội bán ra trở lại.



Đây là cơ hội tốt để bán ra? Chẳng có gì là chắc cả nhưng ít ra nó cũng là một khả năng tốt nhất khi kết hợp giữa Fib và mô hình nền



Ngay sau khi hình thành Doji tại vùng Fib 61.8, EURUSD đã quay đầu giảm trở lại, về đến vùng đáy cũ. Nếu bạn đặt lệnh bán, bạn đã thành công.

Điều cần lưu ý ở phương pháp này là bạn phải đợi giá hình thành mô hình nến, tức là bạn không thể đặt các lệnh chờ mua chờ bán sẵn mà phải quan sát giá trực tiếp. Sau khi có diễn biến của giá, bạn mới quyết định vào lệnh hay không dựa vào mô hình nến

6.Cách dùng Fibonacci mở rộng (Fibonacci Extension) để chốt lời

Đây là loại Fib giúp bạn tìm được mục tiêu mà giá hướng đến, tức là sau khi giá chạm vào các vùng của fibonacci retracement, bạn sẽ bắn khoản rằng giá hướng đến mục tiêu nào, các vùng Fib Extension sẽ là câu trả lời

Để dùng loại Fib này, bạn cần tìm 3 điểm là Đáy, Đỉnh và Điểm

hồi lại

Hãy xem ví dụ về xu hướng tăng bên dưới.





Nhìn chung, các mức Fib Ext 0.618; 1.000; 1.618 là các vùng cần lưu ý chốt lời đối với Fib Ext

Xem thêm 1 ví dụ đối với xu hướng giảm ở EURUSD (đây là ví dụ trong bài Fib kết hợp mô hình nến)



Sau khi chúng ta thấy doji ở vùng 0.618 của Fib retracement thì giá đảo chiều và đi xuống. Bây giờ chúng ta sẽ căng Fib

Extension cho EURUSD. Ba điểm dừng để căng là đỉnh 1.3363, đáy 1.2522 và đỉnh hồi lại 1.3094



Giá rõ ràng đã chạm và có “ngủ” một chút tại các vùng Fib Ext là 38.2; 50; 61.8. Đây là các vùng chốt lời cho lệnh bán nói trên

Nhìn chung, sau khi giá chạm vào các vùng Fib Extension đều có một chút phản ứng – không phải lúc nào cũng phản ứng – nhưng là vừa đủ cho chúng ta chốt 1 phần lời và quản lý rủi ro tốt hơn

Một số vấn đề cần quan tâm ở đây là:

- Trước tiên, không có cách nào biết chắc fibonacci extension nào sẽ đóng vai trò kháng cự hoặc hỗ trợ mạnh. Nhiều khi giá dội lại từ Fib ext nhưng nhiều khi nó xuyên thủng luôn
- Vấn đề tiếp theo là nhiều khi chúng ta xác định vùng đỉnh, đáy và vùng hồi lại chưa chính xác. Điều này dựa vào kinh nghiệm

của mỗi người giao dịch.

· Nhìn chung, việc dùng Fibonacci (cả retracement lẫn extension) dựa phần lớn vào kinh nghiệm và cái nhìn riêng của mỗi người.

7 . Kết hợp các công cụ Fibonacci

Một phương pháp khác để gia tăng hiệu quả khi sử dụng Fibonacci là kết hợp nhiều công cụ Fibonacci.



Trong ví dụ này, HNXIndex đang tiến vào giai đoạn điều chỉnh sau xu hướng tăng trước đó, chúng ta kéo FR thứ nhất (màu xanh) từ đáy ngày 24/2/2009 đến đỉnh ngày 23/10/2009 và FR thứ hai từ đáy điều chỉnh ngày 27/4/2009 đến đỉnh 23/10/2009.

Có thể thấy rằng có 3 sự giao hội khá rõ ràng khi sử dụng đồng thời 2 FR này, 38.2% (xanh) trùng với 50% (đỏ); 50% (xanh) trùng với 61.8% (đỏ) và 61.8% (xanh) trùng với 78.6% (đỏ). Điều này sẽ làm tăng thêm sức mạnh hỗ trợ của 3 mức FR này, và kết quả là:



HNXIndex đã tăng điểm trở lại khi thoái lui về mức FR 61.8% (xanh) trùng với 78.6% (đỏ). Hơn thế nữa, việc xuất hiện một cây nến hammer ở mức FR kết hợp này sẽ càng làm tăng thêm khả năng đảo chiều quay trở lại xu hướng tăng của chỉ số.

8.FIBONACCI FAN (FF)

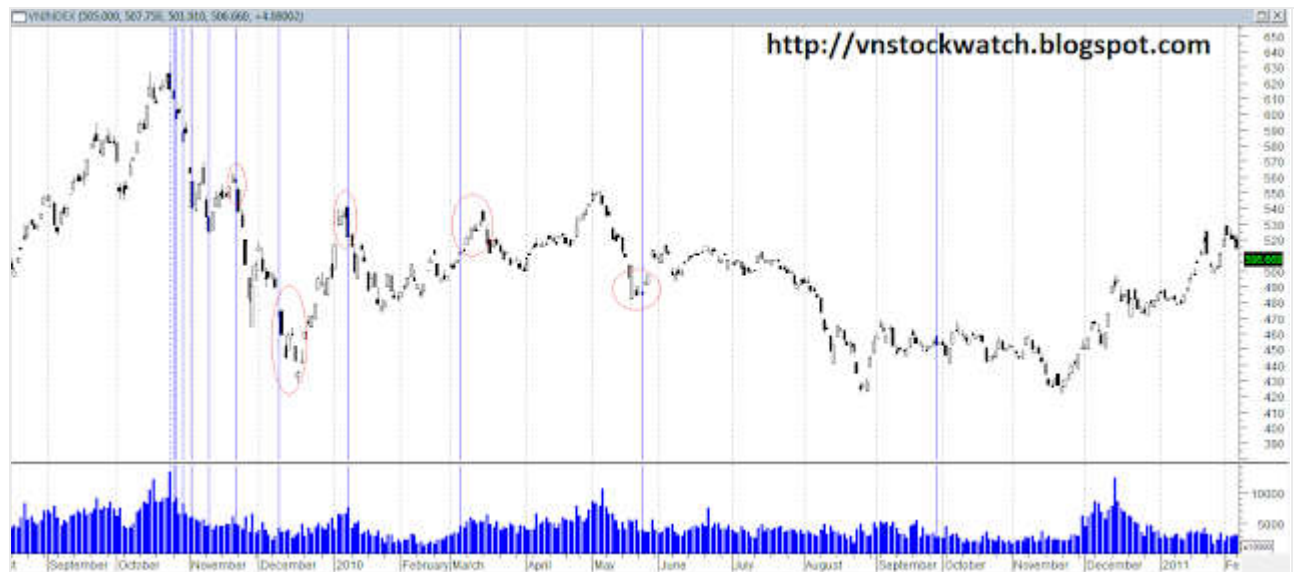
Fibonacci Fan được vẽ bằng cách kết nối hai điểm giá cao nhất và thấp nhất của giai đoạn phân tích. Sau đó một đường thẳng đứng “vô hình” sẽ được vẽ qua điểm giá cao nhất. Tiếp theo đó 3 đường chéo sẽ được vẽ từ điểm giá thấp nhất cắt đường thẳng đứng “vô hình” tại 3 mức 38.2%, 50.0%, 61.8%. Ba đường thẳng này sẽ đóng vai trò hỗ trợ/kháng cự cho diễn biến của giá trong tương lai!



Trực quan ta có thể thấy 3 đường FF phát huy rất rõ những vai trò hỗ trợ/kháng cự cho giá. Sau khi đạt đỉnh ở điểm A, HNXIndex điều chỉnh giảm và được hỗ trợ khá tốt bởi đường FF thứ 2 (điểm B), trở lại xu hướng tăng điểm, chỉ số lại được sự hỗ trợ bởi đường FF thứ nhất khi liên tục bám phía trên đường này trong nhiều ngày. Tiếp theo đó là các vai trò hỗ trợ ở các điểm C, D, F; vai trò kháng cự ở điểm E

9.FIBONACCI ARC (FA)

Fibonacci Arc được thiết lập đầu tiên bằng cách vẽ đường thẳng kết nối 2 điểm có mức giá cao nhất và thấp nhất của giai đoạn phân tích. 3 đường cong sau đó được vẽ với tâm nằm trên điểm có mức giá cao nhất và có khoảng cách bằng 38.2%, 50.0%, 61.8% độ dài đường thẳng thiết lập



Potential Reversal Zone (PRZ)

PRZ –Vùng đảo chiều tiềm năng: được định nghĩa là một khu vực có sự hội tụ của nhiều hơn 2 vạch (2 mức) Fibonacci (có thể là 3, 4, hoặc 5...), tại các vùng như vậy, Nhà PTKT tin rằng giá sẽ đảo chiều với một xác suất cao.