



WEEKLY MARKET UPDATE (7)

“Đồng Dollar phục hồi – Thị trường toàn cầu rung lắc”

Tóm tắt thị trường tuần qua

1. Biến động thị trường tiền tệ

Các nền kinh tế lớn: Một tuần với sự trở lại của đồng Dollar khiến hầu hết tiền tệ các nước điều chỉnh giảm với mức giảm mạnh nhất thuộc về Hàn Quốc (-2,81%), Ấn độ (-0.8%) và Châu Âu (-0.92%).

Khu vực Châu Á: Châu Á không thoát khỏi xu thế chung thậm chí có mức giảm mạnh như Thái Lan (-2,46), Malaysia (-1.74), tuy nhiên các nước này đều có YTD dương.

2. Thị trường hàng hóa

Nhóm Năng lượng trong tuần có mức tăng mạnh nhất lần lượt dầu Brent (9%) và WTI (8,24%). Nhóm kim loại và nông sản tuần này điều chỉnh giảm sau đà phục hồi từ đầu năm.

3. Diễn biến Chỉ số VIX và DXY

Chỉ số VIX và S&500: Chỉ số VIX có mức tăng 13% trong tuần, tiến lên sát mốc 21 do tâm lý bất an của nhà đầu tư trước các thông tin tăng lãi suất của Fed khi các chỉ số thất nghiệp vẫn tốt.

Chỉ số Dollar: Tuần này chỉ số Dollar Index tăng 0,5% và vượt khỏi mốc 103, điều này phần nào giải thích sự biến động mạnh trên thị trường tiền tệ toàn cầu.

4. Thị trường chứng khoán Toàn Cầu

Tỷ suất sinh lợi: Ý và Nhật có mức TSSL cao nhất khu vực lần lượt 1,7% và 0.6%, xu hướng giảm bao trùm toàn cầu tuy nhiên khu vực Châu Á và Mỹ Latinh bị hit nhiều hơn so với Châu Âu.

Chỉ số P/E: Với mức P/E trailing trung vị là 14.5, ngoại trừ Mỹ, Úc thì hầu hết các quốc gia đều có P/E thấp hơn. P/E FW 2023 đều đang thấp hơn hiện tại ngoại trừ Hồng Kong, Brazil.

5. Tình hình thị trường chứng khoán Châu Á

Thị trường châu Á tuần này giảm -0,64%, có sự phân hóa rõ theo từng quốc gia. Tuy nhiên hầu hết các nước đều có mức sinh lợi dương từ đầu năm cho đến nay nên có thể coi như một nhịp điều chỉnh

6. Tình hình thị trường chứng khoán Việt Nam

Khối lượng giao dịch và định giá: Hiện tại P/E quanh mốc 13.7, tăng đáng kể so với đầu năm (12,46). Khối lượng giao dịch trong tuần quanh 0,45 tỷ USD, giảm hơn 20% từ đầu năm.

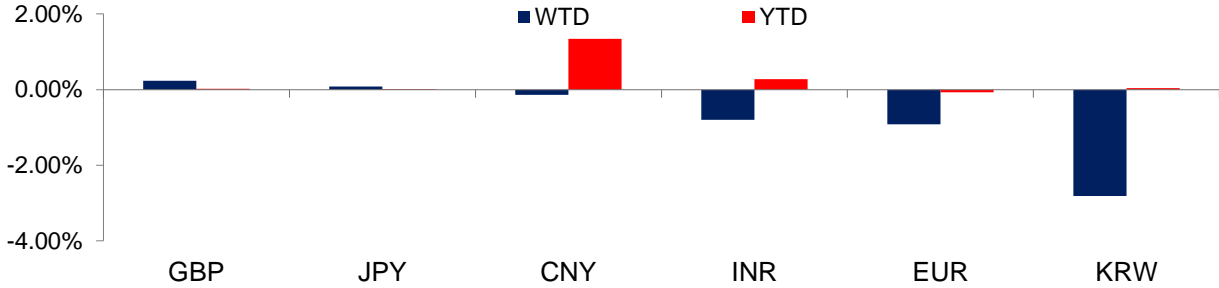
TSSL theo ngành: Trong tuần, Dịch vụ viễn thông và Bất động sản có mức giảm mạnh nhất lần lượt (-5,69% và -5,04%). Hiện tại nhóm CNTT và Tiện ích có YTD cao nhất lần lượt (12,9% và 12,25%).

Tình hình mua bán nước ngoài và tự doanh: Nước ngoài tiếp tục mua ròng 860 tỷ tập trung các mã STB, HPG, HCM. Tự doanh bán ròng 526 tỷ, tập trung các mã VPB, HPG, VNM.

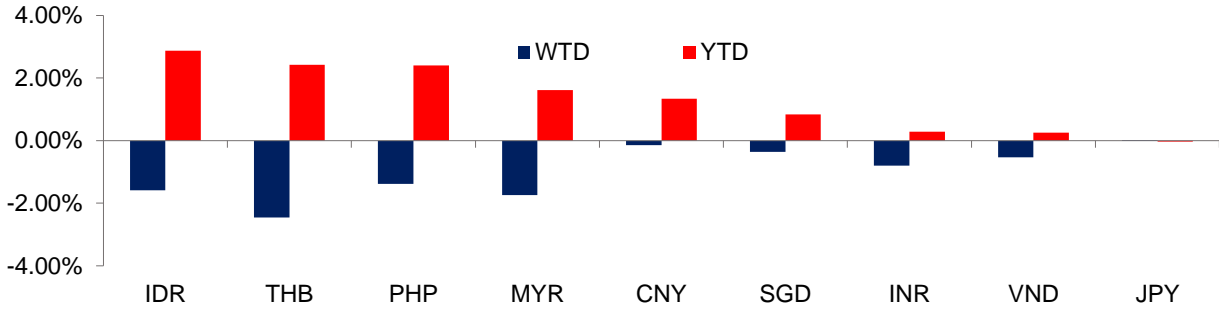


1. Biến động thị trường tiền tệ

Hình 1.1: Biến động thị trường tiền tệ các nền kinh tế lớn



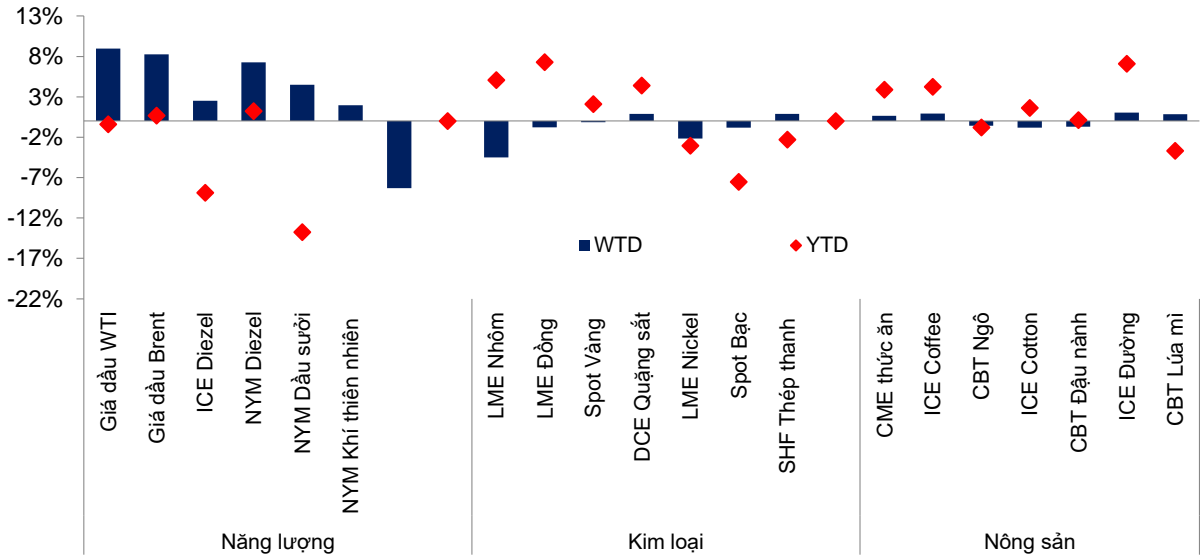
Hình 1.2: Biến động thị trường tiền tệ các nước Châu Á



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

2. Thị trường hàng hóa

Hình 2.1: Tỷ suất sinh lợi của các nhóm hàng hóa

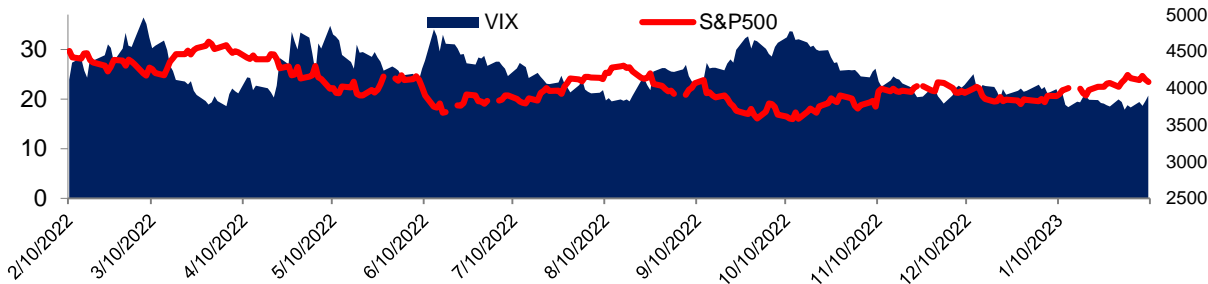


Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

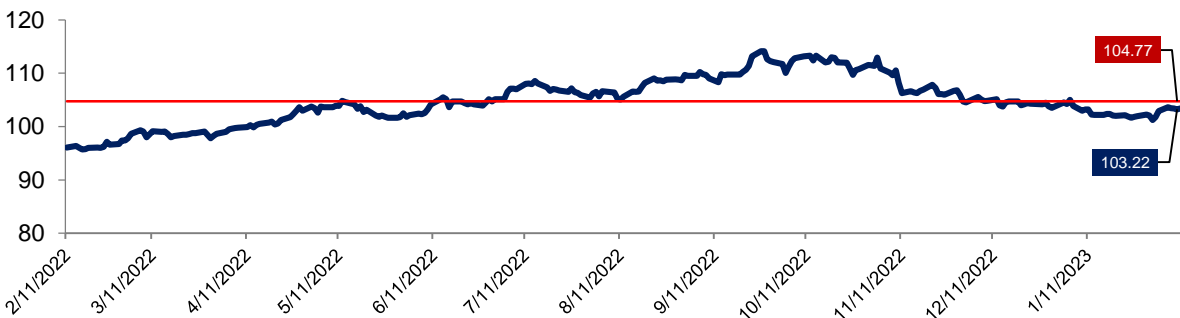


3. Diễn biến Dollar Index và Chỉ số VIX

Hình 3.1: Diễn biến chỉ số VIX và S&P500



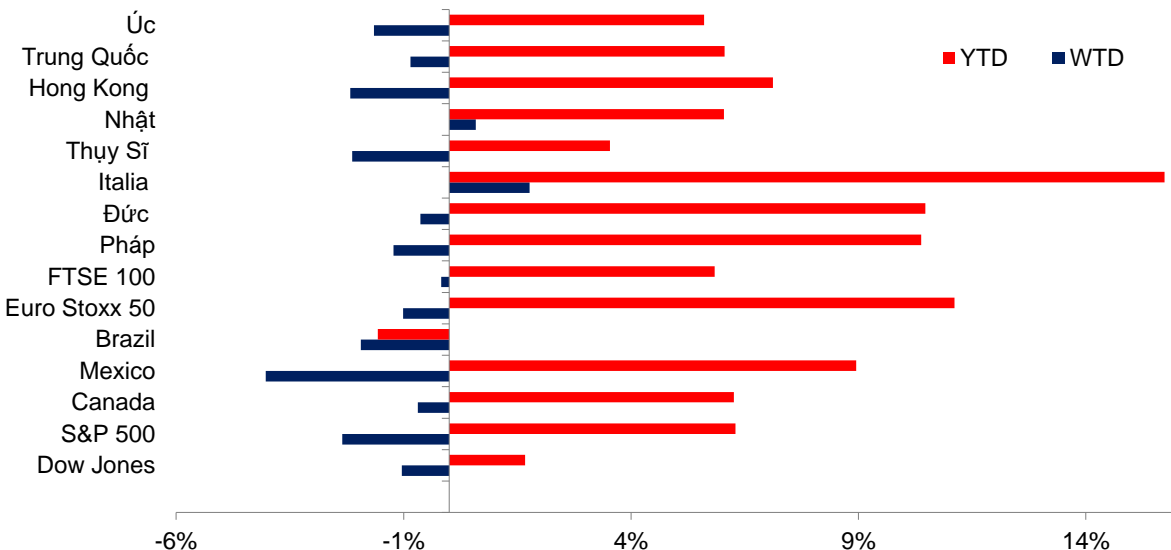
Hình 3.2: Diễn biến chỉ số DXY



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

4. Diễn biến thị trường chứng khoán toàn cầu

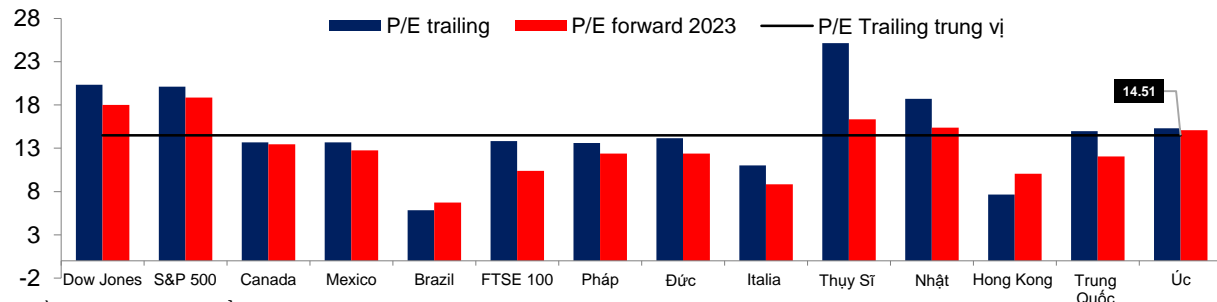
Hình 4.1: Tỷ suất sinh lợi toàn cầu



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp



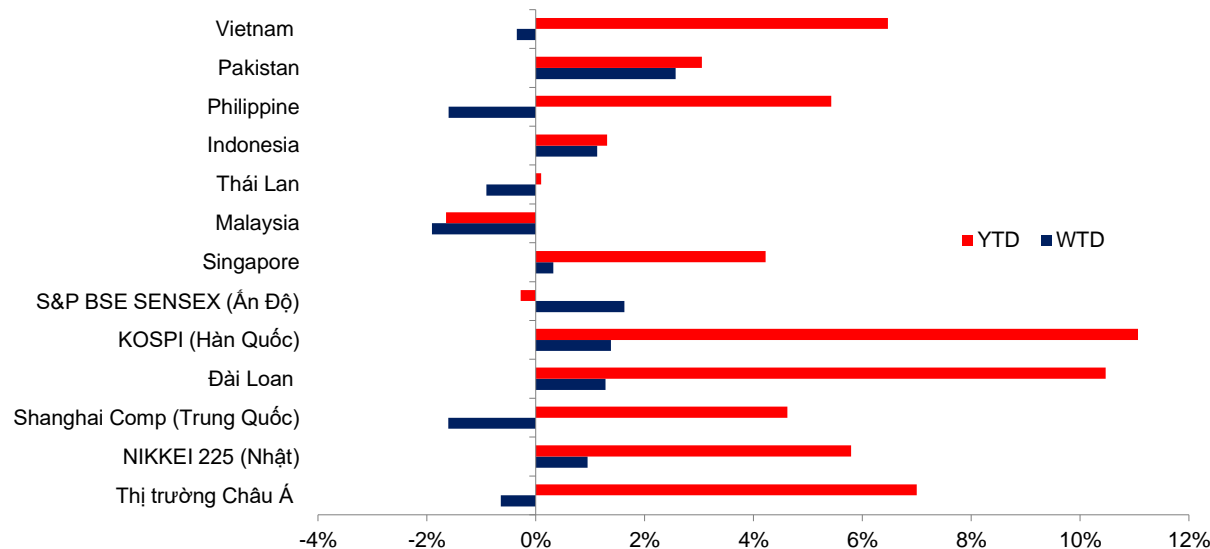
Hình 4.2: Định giá P/E trailing và P/E Forward 2023 toàn cầu



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

5. Diễn biến thị trường chứng khoán Châu Á

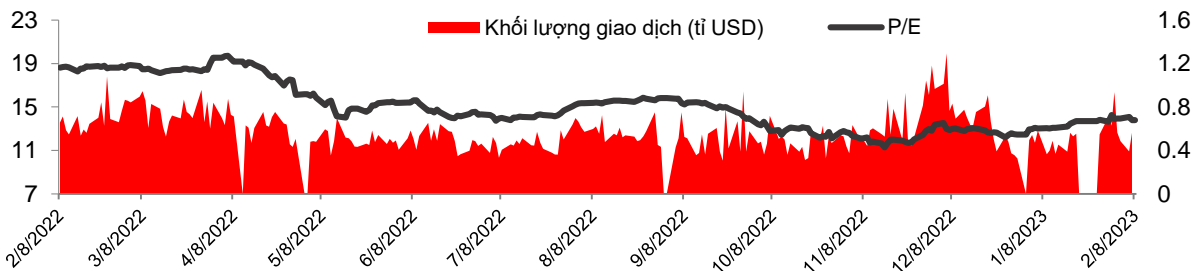
Hình 5.1: Tỷ suất sinh lợi một số quốc gia tại Châu Á



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

6. Diễn biến thị trường chứng khoán Việt Nam

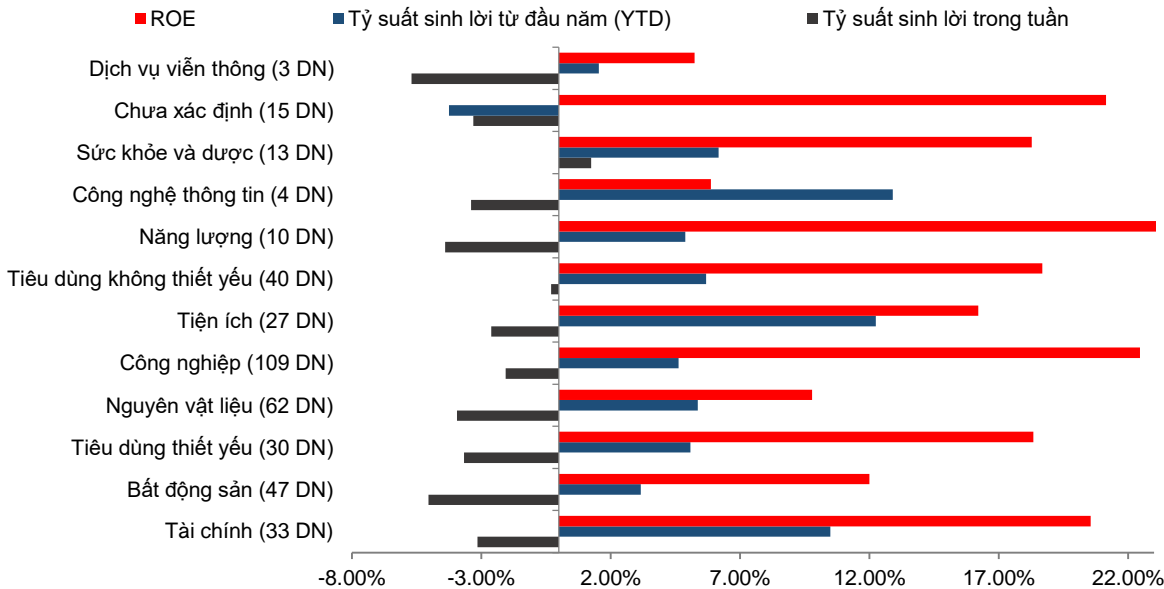
Hình 6.1: Định giá và khối lượng giao dịch



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp



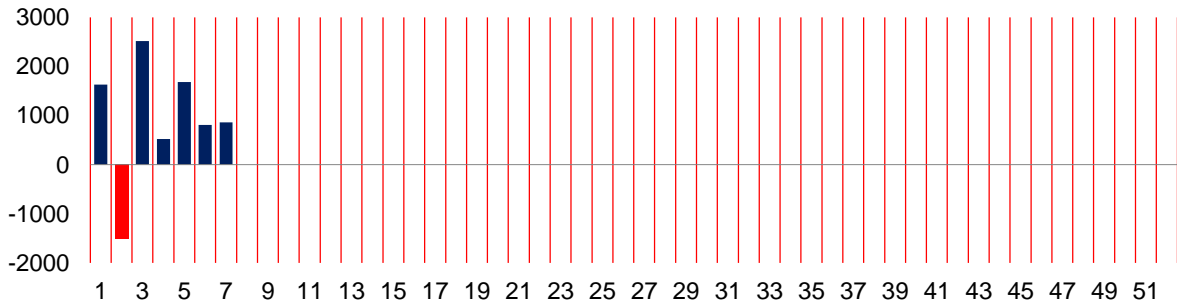
Hình 6.2: Tỷ suất sinh lời theo tuần, năm và ROE của các ngành



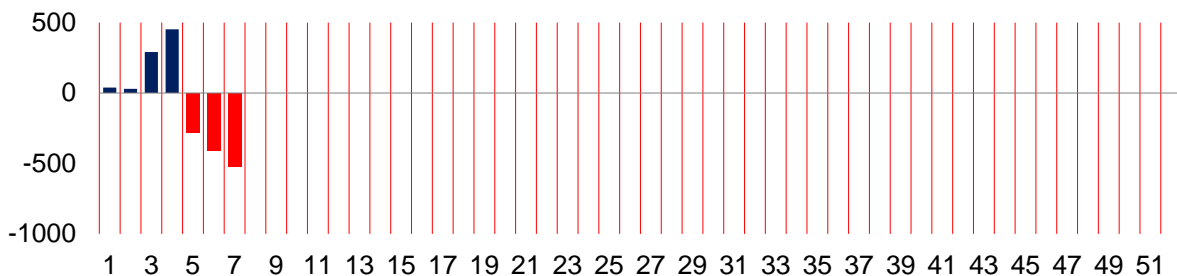
Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp

7. Tình hình mua bán ròng nước ngoài và tự doanh

Hình 7.1: Tình hình mua bán ròng nước ngoài theo tuần



Hình 7.2: Tình hình mua bán ròng tự doanh theo tuần



Nguồn: Bloomberg, TCSC tổng hợp