

2022 07 27

Vietnam Daily Review

VNインデックス4日ぶり反発。

VN指数にBSCの予測

	弱気	中立	強気
2020 04 27		●	
2020 04 27 ~ 2020 05 01		●	
4		●	

サマリー

- ・VNインデックスは+5.97ポイント高の1191.04で引けた。HNXインデックスは+1.64ポイント高の284.52で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVCB (+1.32%)、CTG (+0.55%)、BVH (+0.55%)、VGC (+0.47%)、VIC (+0.39%)だった。
- ・主に下落した銘柄はHPG (-0.57%)、MWG (-0.32%)、MBB (-0.23%)、HVN (-0.14%)、VHM (-0.11%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比1.02%減の7兆9,880億ドンに達した。総売買代金が10兆240億ドンに達した。変動幅は12.46ポイントだった。上昇には222銘柄、変わらずに96銘柄、下落には201銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場及びHNX市場での買越額はそれぞれ、6,185億7,000万ドン、8,119億4,000万ドンだった。最も買われたのはKDC (6,196億2,000万ドン)、MWG (399億2,000万ドン)、LPB (286億ドン)だった。

推奨戦略

VNインデックスは前場に1180ポイントの周りでもみ合ったが、後場に入ると、買いに勢いが強まったことで値を上げ、プラス圏に浮上し、VNインデックスは5.97ポイント高の1191.04ポイントで引けた。市場の広さがポジティブな状態に転換し、19業界うちの14業界が上昇した。銀行業界及び不動産業界は本日市場を牽引した。外国人投資家はHSX市場及びHNX市場で買い越した。現在、VNインデックスは1185~1200ポイントの周りでもみ合う傾向にある。短期的には、キャッシュフローが入るまでに、VNインデックスがこの傾向を維持する可能性がある。また、次の数日に市場の推移はFEDの利上げ決定に依存するだろう。

先物取引契約：先物取引契約は証券市場と共に上昇した。投資家は次の数日に短期先物取引契約を取引することを検討するべきだ。
 カバードワラント：2022年7月27日には、カバードワラント市場は証券市場と共に下落した。

BSC RESEARCH

部長

Tran Thang Long

longtt@bsc.com.vn

マクロ及び市場を担当するグループ

Bui Nguyen Khoa

khoabn@bsc.com.vn

Le Quoc Trung

trunglq@bsc.com.vn
VN-INDEX 1185.07

 売買代金: 8069.62 億ドン **-3.43 (-0.29%)**
 外国人投資家の売買代金 (買い越し・
 売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 44768.00

 売買代金: 0 億ドン **0 (0%)**
 外国人投資家の売買代金 (買い越し・
 売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 44768.00

 #VALUE!
0 (0%)
 外国人投資家の売買代金 (買い越し・
 売り越し) 億ドン

データ

	価値	増減率
石油価格	98.4	1.8%
金価格	1,724	0.3%
対USD為替レート	23,364	-0.1%
対EUR為替レート	23,843	-0.5%
対円為替レート	17,109	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	-	0.0%
国債金利 (5年間物)	0	0.0%

ソース：ブルームバーグ、BSCリサーチ

外人投資家による売買金額上位5銘柄

購入銘柄トップ	売買代金	売却銘柄トップ	売買代金
VCB	23.35	DGC	-38.72
MWG	21.95	VNM	-16.91
SSI	21.56	DPM	-11.30
LPB	20.45	GAS	-11.25
KDH	19.24	IJC	-8.60

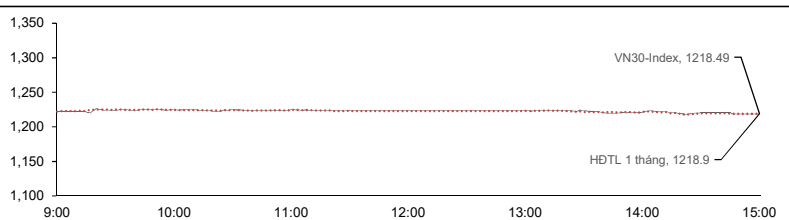
ソース：BSCリサーチ

市場概要 A	ページ1
テクニク分析	ページ2
デリバティブ市場	ページ2
推奨ポートフォリオ	ページ3
大型株	ページ4
市場統計	ページ5
最新レポート	ページ6

先物取引契約

チャート

VN30-Index Intraday と1ヶ月先物取引契約



ソース: Bloomberg, BSC Research

契約名	契約値	増減(日)	差	%	売買高	満期日	日数
VN30F2207	1234.10	0.65%	15.61	7.4%	203851	7/21/2022	0
VN30F2208	1218.90	-0.25%	0.41	-17.7%	154039	8/18/2022	25
VN30F2209	1219.20	-0.19%	0.71	-45.7%	95	9/15/2022	53
VN30F2212	1217.60	-0.20%	-0.89	33.3%	76	12/15/2022	144

ソース: Bloomberg, BSC Research

Le Quoc Trung
trunglq@bsc.com.vn

VN30の上昇幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
MSN	110.00	1.29	0.83
VCB	73.90	1.37	0.54
KDH	37.05	2.07	0.36
SAB	167.70	1.64	0.20

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
0/1/1900	0.0	0.00	0.00
VIC	66.1	-1.78	-1.55
HPG	21.7	-1.14	-0.84
VNM	72.0	-1.23	-0.79
FPT	84.8	-0.70	-0.59

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは+0.94ポイント高の1219.43で引けた。変動幅は8.01ポイントだった。VCB、VIC、HDB、ACBとCTGなどの主力株が堅調で、VN30インデックスを牽引した。VN30インデックスは小幅な変動幅で引き続き推移した。売買代金が低い水準で留まった。下ヒゲが長い同時線が形成した。テクニク指標及びローソク足パターンが中立状態で留まっていた。投資家は次の日に短期先物取引契約を取引することを検討するべきだ。
- ・先物取引契約は証券市場と共に上昇した。売買高を見ると、VN30F2209の以外、他の先物取引契約が減少した。先物取引契約数を見ると、全ての先物取引契約が減少した。

カワードワラント

銘柄	満期日	残り期間	CR**	売買高	Độ lệch chuẩn	ワラント値	±増減	発行価格	理論的な価格*	換益分岐価格	実施価格	証券価格
CMBB2203	9/26/2022	62	2:1	4,600	35.91%	150	15.4%	1,900	8.67	50,620	35,500	25,150
CKDH2206	9/20/2022	56	7.26:1	24,100	35.32%	100	11.1%	1,100	9.72	69,936	52,999	37,050
CHDB2205	10/20/2022	86	5:1	17,600	38.58%	370	8.8%	1,000	140.56	34,261	27,111	23,600
CVNM2205	10/20/2022	86	15.4:1	10,200	26.79%	550	3.8%	1,000	131.76	77,372	79,999	72,000
CHPG2208	10/7/2022	73	3.78:1	31,400	36.72%	320	3.2%	2,500	10.32	39,406	40,000	21,650
CVHM2211	3/28/2023	245	16:1	200	25.44%	720	1.4%	1,000	199.26	76,359	64,999	58,700
CVHM2209	12/27/2022	154	15.5:1	32,200	25.44%	400	0.0%	1,000	62.05	89,354	69,979	58,700
CVHM2210	1/3/2023	161	16:1	544,500	25.44%	310	0.0%	1,000	12.57	97,439	79,999	58,700
CACB2201	9/20/2022	56	3.2:1	347,400	28.86%	240	0.0%	1,500	31.44	31,111	35,500	24,050
CKDH2209	3/28/2023	245	7.26:1	29,600	35.32%	1,100	0.0%	1,200	707.01	53,768	36,344	37,050
CMWG2206	1/9/2023	167	4.97:1	109,100	34.94%	1,040	0.0%	2,590	148.59	94,273	88,060	63,000
CVRE2203	8/15/2022	20	4:1	326,700	39.44%	20	0.0%	1,600	0.44	33,979	33,979	26,050
CVJC2203	12/27/2022	154	20:1	100	27.86%	970	-1.0%	1,400	374.69	190,931	131,131	125,100
CVRE2211	3/28/2023	245	8:1	35,100	39.44%	650	-1.5%	1,000	322.18	28,888	28,888	26,050
CSTB2211	12/27/2022	154	8:1	1,111,900	46.61%	510	-3.8%	1,000	348.32	26,693	23,333	22,950
CVNM2201	9/21/2022	57	15.2:1	22,800	26.79%	210	-4.5%	1,200	14.35	85,603	89,988	72,000
CMBB2204	11/7/2022	104	2:1	3,000	35.91%	660	-7.0%	2,200	212.36	37,620	31,000	25,150
CMWG2204	10/7/2022	73	4.97:1	660,200	34.94%	590	-13.2%	3,000	257.14	85,598	45,000	63,000
CHPG2203	9/20/2022	56	3.02:1	727,800	36.72%	50	-16.7%	2,200	0.01	43,125	51,500	21,650
CNVL2206	1/3/2023	161	16:1	100	25.60%	500	-19.4%	1,000	131.76	90,559	83,999	73,900

ノート: * 理論的な価格はBlack-Scholes公式を基づく計算されます

非リスク金利 4.75%

** 転換率

評価:

- ・2022年7月27日には、カワードワラント市場は証券市場と共に下落した。
- ・価格については、CACB2201とCNVL2206はそれぞれ、+140.96%、+100.00%と最も上昇した。売買代金は前日比+14.14%と減少した。CHPG2215の売買代金は最大となり、全市場の13.81%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCHPG2203、CHPG2207、CHDB2205とCHPG2206の時価が理論価格と相当している。CPOW2202、CTB2206、CMSN2206とCVRE2204の収益性は最も高かった。CFPT2203、CPNJ2202とCTPB2203の益回り率は最も高かった。

銘柄	セクタ	終値 (千VND)	% 日	Beta	時価総額 (百万 USD)	終値 (百万 USD)	1株当たり利益	P/E	P/B	外国人が所有する	ROE
MWG	小売	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
PNJ	小売	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
BVH	保険	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
PVI	保険	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VIC	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VRE	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
NVL	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
REE	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
DXG	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
SSI	証券	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VCI	証券	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
HCM	証券	#N/A	反発。	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
FPT	技術	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
FOX	技術	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
GAS	オイルとガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
PLX	オイルとガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
PVS	オイルとガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
BSR	オイルとガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
DHG	薬局	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
DPM	肥料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
DCM	肥料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VCB	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
BID	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VPB	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
CTG	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
MBB	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
ACB	バンク	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
BMP	プラスチック	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
NTP	プラスチック	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
MSR	天然資源	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
HPG	鋼	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
HSG	鋼	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VNM	消費者の主食	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
SAB	消費者の主食	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
MSN	消費者の主食	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
SBT	消費者の主食	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
ACV	輸送	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VJC	輸送	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
HVN	輸送	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
GMD	輸送	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
PVT	輸送	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VCS	材料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VGC	材料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
HT1	材料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
CTD	建設	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
VCG	建設	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
CII	建設	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
POW	電気	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A
NT2	電気	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A

市場統計

VNX指数プラス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	2015年4月24日	売買高
CTG	29.00	6.42	2.37	9.43M
VCB	59.60	2.41	1.83	3.45M
SAB	217.30	1.97	0.98	30.53k
BVH	89.80	3.22	0.69	268.66k
MBB	30.25	3.24	0.63	6.60M

VNインデックス4日ぶり反発。

VNX指数マイナス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
GAS	96.50	-6.94	-5.00	1.51M
VIC	123.00	-1.60	-1.92	4.73M
NVL	54.20	-6.87	-1.24	1.61M
VJC	173.00	-3.67	-1.08	598.90k
MSN	92.00	-1.50	-0.59	1.15M

HSXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
HLG	9.67	6.97	0.01	920.00
IDI	14.05	6.84	0.06	4.40M
TCO	11.75	6.82	0.01	20.00
CLC	36.85	6.81	0.02	23.54k
CEE	20.50	6.77	0.02	359.43k

HSXの下落率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
CMX	4.65	-7.00	0.00	38.99k
CMT	8.91	-6.99	0.00	20
AGR	3.99	-6.99	-0.02	367.62k
HII	17.65	-6.98	-0.01	46.95k
PLP	13.35	-6.97	-0.01	58.17k

ソース：ブルームバーグ、BSCリサーチ

HNX指数プラス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
ACB	43.50	3.57	1.26	3.70M
PVS	16.90	3.05	0.12	4.26M
SHB	11.00	0.92	0.11	15.24M
VGC	23.80	2.15	0.06	1.19M
SHS	19.00	2.15	0.04	1.37M

HNX指数マイナス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
CEO	13.80	-8.61	-0.13	3.58M
VCG	16.90	-3.98	-0.08	1.46M
DBC	20.00	-2.91	-0.04	27.72k
NVB	9.40	-1.05	-0.03	81.30k
PTI	20.30	-6.02	-0.03	120

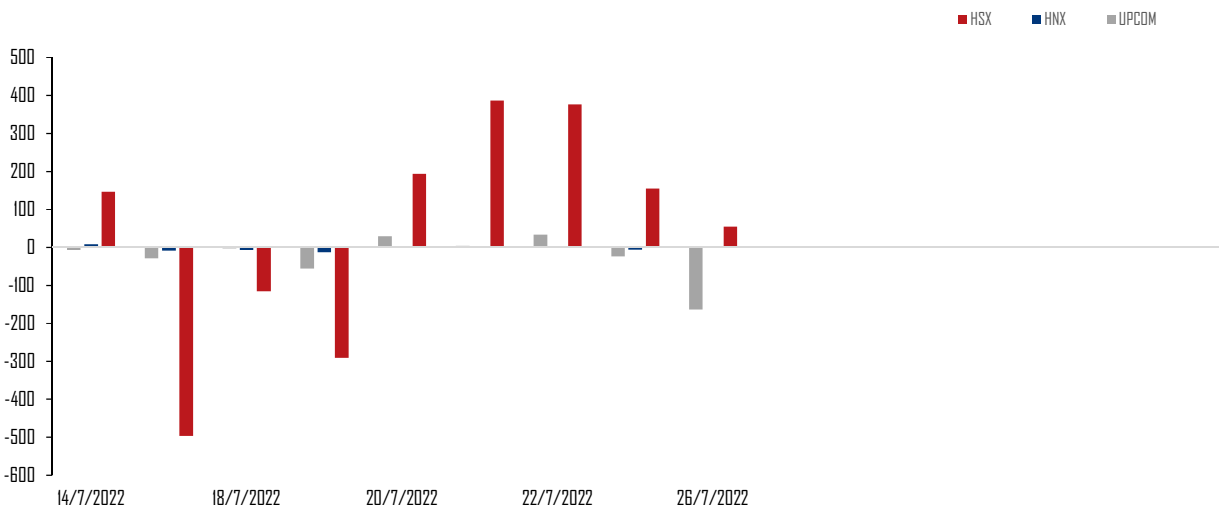
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
DPC	16.50	10.00	0.00	2.00k
TAG	34.60	9.84	0.02	23.80k
V12	11.20	9.80	0.00	100
TV3	32.50	9.80	0.01	100
ARM	33.70	9.77	0.00	100

HNXの下落率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
PXA	0.80	-11.11	0.00	31.10k
ACM	0.80	-11.11	0.00	58.30k
VE4	9.00	-10.00	0.00	100
NHC	32.60	-9.94	-0.01	1.82k
MAS	58.40	-9.88	-0.02	52.27k

外国人投資家の取引



ソース：HSX、HNX、BSCリサーチ

利用規約

本レポートはベトナム投資開発銀行証券株式会社（BSC）の作成によるレポートで、週間内の証券市場状況及びマクロ経済に関する分析、一般情報を提供するものです。本レポートはいかなる法人または個人の要求により作成されたレポートではありません。投資家は参考資料として本レポートの分析、評価、一般情報をご利用下さい。本レポートの情報、評価、予告などは信頼的なデータ源に基づいたものです。しかし、当社は掲載される情報の正確性に対していかなる保証もなされるものではありません。情報の使用に関して、またはその使用の結果に関して、その他の事項に関して、いかなる保証も負担いたしません。本レポートに掲載される評価や観点は現時点の考慮に基づいたものです。しかし、評価や観点は予告なしに変更されることがありますので、あらかじめご了承ください。本レポートの著作権者はベトナム投資開発銀行証券株式会社であるので、当社の書面による事前の許可なく、いかなる形式またはいかなる手段によっても、複製、再出版は著作権法、プライバシーに関する法律に違反することになります。当社の書面による事前の許可なく、いかなる形式またはいかなる手段によっても、複製、再出版または転送することを禁じます。

ハノイ本社

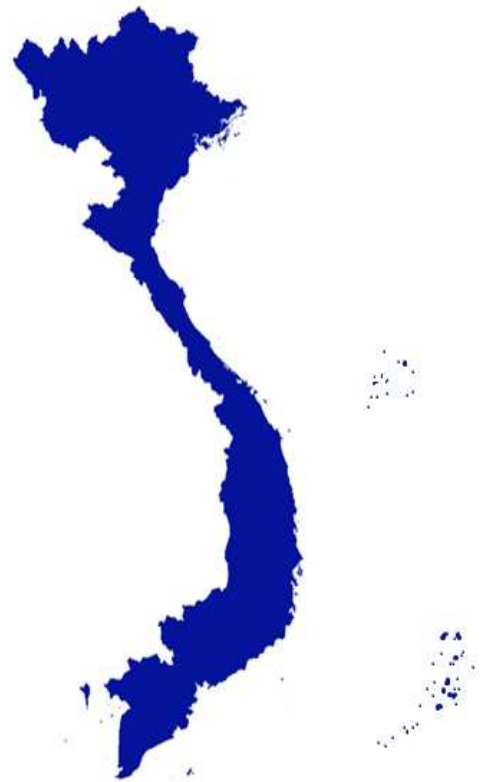
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

ホーチミン支店

146 Nguyen Cong Tru St, 9th Floor
District 1, HCMC
Tel: +84 8 3821 8885
Fax: +84 8 3821 8510

<http://www.bsc.com.vn>

Bloomberg: RESP BSCV <GO>



法人顧客

Vũ Thanh Phong
Trần Thành Hưng
Nguyễn Hoàng Dương
Nguyễn Hoàng Nguyễn

職位

法人向け投資コンサルティング業務部長
法人向け投資コンサルティング業務社員
法人向け投資コンサルティング業務社員
法人向け投資コンサルティング業務社員

メールアドレス

phongvt@bsc.com.vn
hungtt@bsc.com.vn
duongnh@bsc.com.vn
nguyennh@bsc.com.vn