

2022 07 29

Vietnam Daily Review

VNインデックス3日ぶり小幅反落。

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-1.79ポイント安の1206.33で引けた。HNXインデックスは-1.23ポイント安の288.61で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVHM (+1.23%)、SAB (+1.18%)、BID (+1.04%)、GAS (+0.58%)、TCB (+0.54%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVIC (-2.75%)、MSN (-1.31%)、VCB (-0.71%)、DGC (-0.58%)、CTG (-0.48%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比7.45%減の12兆9,160億ドンに達した。総売買代金が15兆350億ドンに達した。変動幅は1.51ポイントだった。上昇には189銘柄、変わらずに87銘柄、下落には239銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場での売越額は340億4,000万ドンだった。最も売られたのはNVL (3,148億7,000万ドン)、DGC (641億5,000万ドン)、VNM (353億ドン)だった。一方、HNX市場での買越額は80億7,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いた後、上げ幅を拡大したが、終盤に売りに勢いが強まったで、値を消しマイナス圏に転落した。市場の広さがネガティブな状態に転換し、値下がり銘柄数が値上がり銘柄数より多くなった。19業界うちの9業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は保険業界及び通信業界だった。売買代金が10兆ドンを上回ったのは2022年第2四半期業績が積極的な心理を作る従って、キャッシュフローが戻していると示した。外国人投資家はHSX市場で売り越したが、HNX市場で買い越した。VNインデックスは来週に1200~1250ポイントの範囲で推移する可能性がある。

先物取引契約：先物取引契約は証券市場と共に下落した。投資家は次の数日に先物取引契約の購入を検討するべきだ。

カバードワラント：2022年7月29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 1206.33

売買代金: 12915.78 億ドン **-1.79 (-0.15%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 44771.00

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 44771.00

#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	97.9	1.5%
金価格	1,763	0.4%
対USD為替レート	23,354	0.0%
対EUR為替レート	23,835	0.4%
対円為替レート	17,571	1.1%
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	却銘柄トップ	売買代金
SSI	132.36	NVL	-294.77
KBC	70.50	DGC	-64.56
STB	57.35	VHM	-35.31
DXG	49.91	HPG	-22.02
NLG	49.50	VCB	-19.34

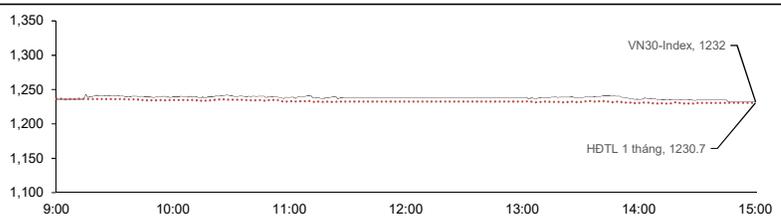
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2208	1230.70	-0.07%	-1.30	1.6%	166959	8/18/2022	20
VN30F2209	1229.90	-0.15%	-2.10	11.0%	302	9/15/2022	48
VN30F2212	1229.00	-0.37%	-3.00	-71.8%	24	12/15/2022	139
VN30F22303	1228.00	-0.10%	-4.00	-82.9%	21	3/16/2023	230

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは-4.14ポイント安の1232.00で引けた。変動幅は18.2ポイントだった。VIC、MSN、FPT、TPBとMWGなどの主力株が軟調で、VN30インデックスの重しになった。VN30インデックスは本日、大きな変動幅でもみ合った。売買代金が20日の平均水準を上回った。下影陰線が形成した。しかし、テクニク指標及びローソク足パターンは回復傾向をサポートしていた。投資家は次の数日に先物取引契約の購入を検討すべきだ。
- ・殆どの先物取引契約は証券市場と共に下落した。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、VN30VF2209の以外、他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
CMSN2209	3/28/2023	242	19.8:1	400	42.61%	1,240	3.3%	1,400	805.82	120,719	111,413	106,100
CSTB2214	1/9/2023	164	2:1	106,200	47.13%	2,540	3.3%	1,630	2,001.94	23,480	23,000	24,700
CPNJ2203	10/3/2022	66	24.8:1	227,800	41.25%	780	2.6%	1,300	603.25	139,190	109,999	114,000
CVNM2204	10/7/2022	70	9.67:1	310,200	26.77%	740	1.4%	1,500	500.82	70,603	73,000	72,800
CVNM2207	3/28/2023	242	15.4:1	11,300	26.77%	1,160	0.9%	1,100	618.55	68,668	68,668	72,800
CKDH2209	3/28/2023	242	7.26:1	70,100	35.35%	1,350	0.7%	1,200	787.08	53,768	36,344	37,500
CPNJ2201	9/20/2022	53	7.91:1	85,600	41.25%	2,650	0.0%	2,300	2,538.19	113,216	95,500	114,000
CFPT2203	8/1/2022	3	3.3:1	904,300	33.19%	1,940	0.0%	3,800	1,974.44	80,068	95,000	83,500
CMBB2207	1/3/2023	158	10:1	5,000	36.03%	650	0.0%	1,000	379.07	41,356	23,456	25,650
CHDB2208	3/8/2023	222	5:1	17,800	38.66%	1,160	0.0%	1,100	715.87	28,499	23,999	24,150
CSTB2215	3/28/2023	242	5:1	183,600	47.13%	1,350	-1.5%	1,100	1,027.19	30,922	22,222	24,700
CSTB2211	12/27/2022	151	8:1	882,100	47.13%	630	-1.6%	1,000	461.66	26,693	23,333	24,700
CHDB2207	12/7/2022	131	3:1	12,300	38.66%	1,390	-2.1%	2,500	801.83	24,860	24,500	24,150
CSTB2213	1/3/2023	158	8:1	83,700	47.13%	640	-3.0%	1,000	403.64	36,044	24,444	24,700
CTPB2203	10/28/2022	91	10:1	719,100	44.30%	610	-3.2%	1,000	512.75	75,899	22,999	26,600
CMBB2206	10/3/2022	66	10:1	90,200	36.03%	520	-7.1%	1,000	383.99	31,422	22,222	25,650
CPNJ2202	10/3/2022	66	24.8:1	150,100	41.25%	740	-7.5%	1,200	672.90	117,834	99,999	114,000
CKDH2208	12/7/2022	131	4.54:1	7,100	35.35%	1,980	-8.3%	2,400	1,023.85	43,019	35,891	37,500
CMSN2208	10/7/2022	70	14.8:1	63,900	42.61%	1,210	-9.0%	2,400	792.14	111,485	104,233	106,100
CTPB2204	3/28/2023	242	10:1	257,400	44.30%	800	-9.1%	1,000	597.06	39,388	23,888	26,600

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29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CNVL2203はそれぞれ、+1478.95%、+200.00%と最も上昇した。売買代金は前日比-12.31%と減少した。CTCB2201の売買代金は最大となり、全市場の12.79%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCHPG2206、CMSN2204、CSTB2210とCPNJ2201の時価が理論価格と相当している。CPNJ2203、CKD H2209、CHDB2208とCMBB2206の収益性は最も高かった。CPNJ2201、CFPT2203とCSTB2214の益回り率は最も高かった。

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
01/1900	0.00	0.00	0.00
TCB	37.90	1.61	1.43
VHM	59.90	1.87	1.39
VPB	28.70	1.06	0.98
SAB	180.00	4.05	0.52

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
01/1900	0.0	0.00	0.00
VIC	64.0	-4.48	-3.88
MSN	106.1	-3.46	-2.26
FPT	83.5	-1.65	-1.36
MWG	61.0	-1.61	-1.07

ソース: Bloomberg, BSC Research

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	反落。	#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3日ぶり小幅反落。

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

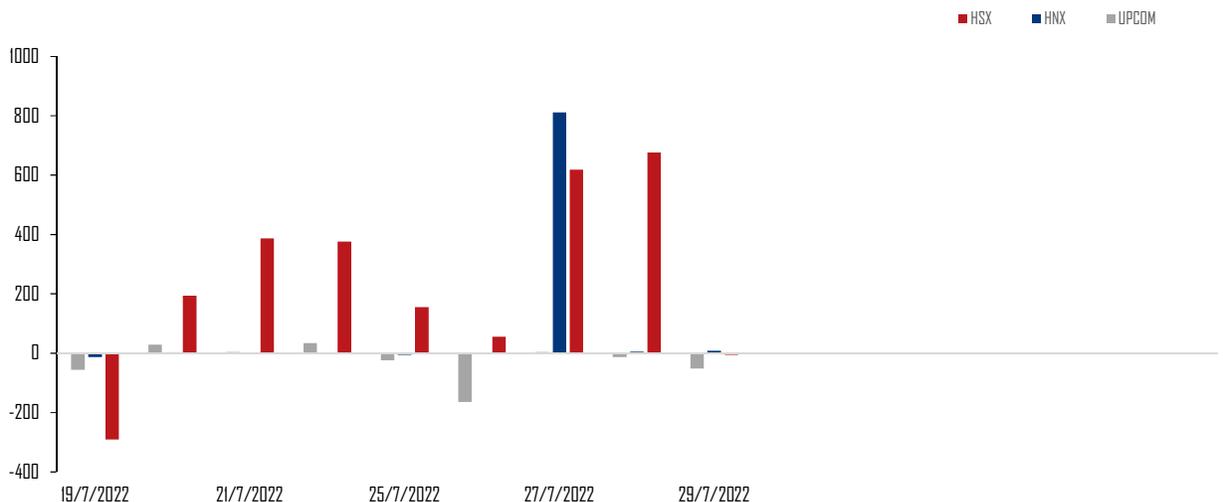
HNXの上昇率上位5銘柄

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

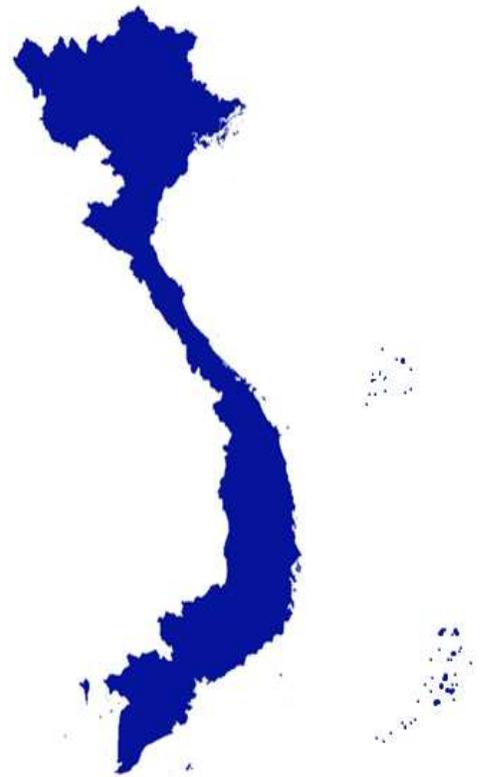
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

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 Nguyên

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