

2022 08 04

Vietnam Daily Review

VNインデックス4日続伸。

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+4.39ポイント高の1254.15で引けた。HNXインデックスは-0.38ポイント安の297.73で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVCB (+3.68%)、VHM (+1.22%)、NVL (+1.16%)、BCM (+0.5%)、VPB (+0.45%)だった。
- ・主に下落した銘柄はGAS (-1.4%)、SAB (-0.77%)、MSN (-0.73%)、VGC (-0.32%)、CTG (-0.3%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比0.92%減の15兆1,240億ドンに達した。総売買代金が17兆70億ドンに達した。変動幅は10ポイントだった。上昇には231銘柄、変わらずに85銘柄、下落には213銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場での買越額は563億ドンだった。最も買われたのはVHM (1,853億9,000万ドン)、HPG (914億5,000万ドン)、VCB (674億6,000万ドン)だった。一方、HNX市場での売り越額は168億4,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間で狭い変動幅10ポイントでもみ合った。市場の広さがバランスを取る状態で維持し、19業界うちの9業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は小売り業界だった。赤三兵のパターンが形成した後、同時線が出たのは投資家の迷いを示した。VNインデックスは次の日に1250ポイントのマイナス圏で引けたら、短期的に1235~1255ポイントの範囲でもみ合う可能性がある。そうではない場合、1260~1280ポイントまで上昇する可能性がある。

先物取引契約：先物取引契約は証券市場と共に上昇した。投資家は次の数日に先物取引契約の購入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8月4日には、カバードワラント市場は証券市場と共に上昇した。

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 **1254.15**

売買代金: 15123.61 億ドン **4.39 (0.35%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX **44777.00**

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 **44777.00**

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

データ

	価値	増減率
石油価格	90.8	0.1%
金価格	1,779	0.8%
対USD為替レート	23,408	0.1%
対EUR為替レート	23,848	0.4%
対円為替レート	17,424	-0.3%
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

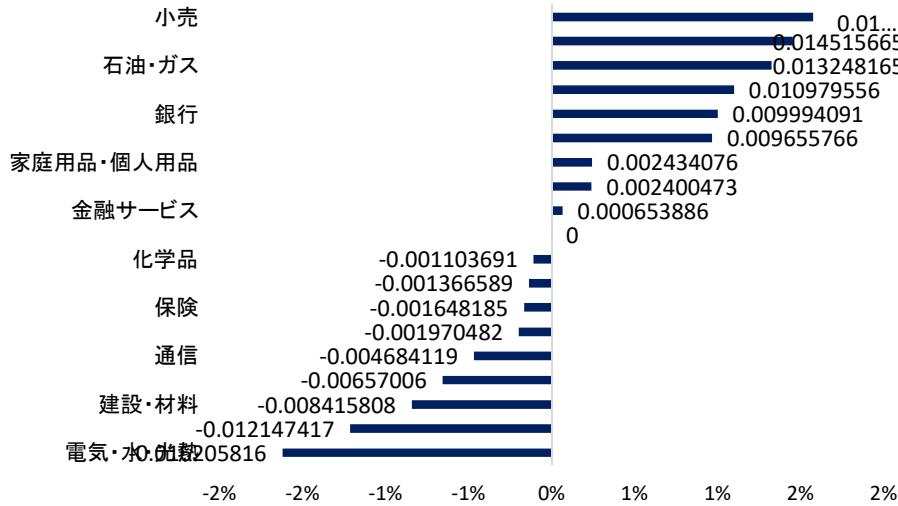
外人投資家による売買金額上位5銘柄

購入銘柄トップ	売買代金	売却銘柄トップ	売買代金
VHM	185.39	FUEVFNV	-225.32
HPG	91.45	E1VFN3	-115.54
VCB	67.46	MSN	-72.42
CTG	46.41	KBC	-35.90
STB	37.75	GAS	-25.03

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

本日の業界の推移

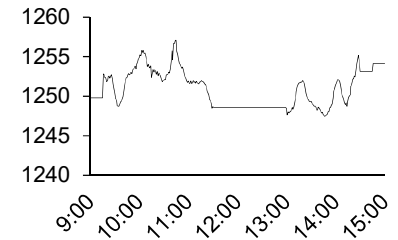


Le Quoc Trung

trunglq@bsc.com.vn

図表 1

VN-インデックス 日中の動き



ソース:ブルームバーグ、BSCリ...

BSCの注目銘柄のテクニク

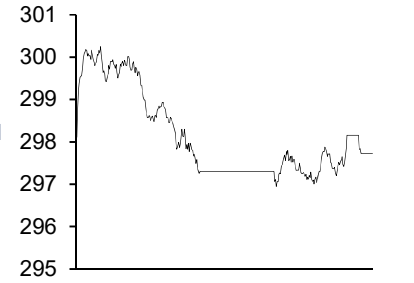
VTP (ベトテル郵便株式会社) - 回復シグナル

- ・ 現在傾向: 回復傾向
- ・ MACD指標: シグナル線を上回った。
- ・ RSI指標: 上昇傾向。

VTPは本日、大幅に上昇した。丸坊主のローソク足パターンが形成した。売買高は株式の値上がりと共に20日の平均水準を上回った。MACD指標がシグナル線を上回った。RSI指標が回復傾向をサポートしていた。株価線がMA100の下にあるが、MA20及びMA50の上にある。そのために、中期投資家は株価の62.3で買い、株価の70.0で利益確定売することを検討することができます。損切り値は株価の58.5の下である。

図表 2

HNX-インデックス 日中の動き



ソース:ブルームバーグ、BSCリ...

チ

Published on TradingView.com, August 04, 2022 15:27:41 +07
VTP, D 0:61.00 H:62.50 L:61.00 C:62.30

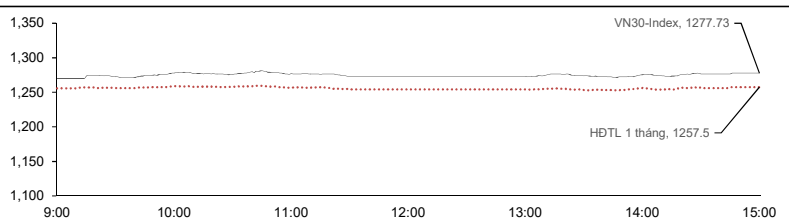


TradingView

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	1257.50	0.60%	-20.23	-12.0%	194586	8/18/2022	14
VN30F2209	1255.90	0.71%	-21.83	-13.1%	358	9/15/2022	42
VN30F2212	1252.90	0.51%	-24.83	925.0%	41	12/15/2022	133
VN30F2203	1248.00	0.53%	-29.73	41.0%	141	3/16/2023	224

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
NVL	78.50	3.02	1.86
VCB	82.50	3.77	1.62
VHM	63.00	1.78	1.49
VPB	29.40	1.38	1.29

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
MSN	107.9	-1.91	-1.39
STB	25.2	-0.98	-0.49
SAB	185.0	-2.58	-0.36
HPG	23.7	-0.42	-0.33

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは+7.9ポイント高の1277.73で引けた。変動幅は10.8ポイントだった。NVL、VCB、VHM、VPBとFPTなどの主力株が堅調で、VN30インデックスを牽引した。VN30インデックスは本日、小さい変動幅で引き続き推移した。売買代金が20日の平均水準を上回った。テクニク指標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、VN30F2203の以外、他の先物取引契約が増加した。先物取引契約数を見ると、VN30F2212とVN30F2203が増加したが、VN30F2208とVN30F2209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
CTPB2204	3/28/2023	236	10:1	316,900	44.40%	980	14.0%	1,000	652.53	39,388	23,888	28,800
CMBB2207	1/3/2023	152	10:1	50,200	36.21%	720	10.8%	1,000	476.39	41,356	23,456	26,950
CTPB2203	10/28/2022	85	10:1	168,600	44.40%	750	10.3%	1,000	573.95	75,899	22,999	28,800
CVNM2204	10/7/2022	64	9.67:1	94,800	26.69%	750	2.7%	1,500	537.30	70,603	73,000	73,300
CMSN2208	10/7/2022	64	14.8:1	122,100	42.71%	1,200	2.6%	2,400	772.60	111,485	104,233	107,900
CPNJ2202	10/3/2022	60	24.8:1	26,400	41.14%	800	1.3%	1,200	760.84	117,834	99,999	116,000
CKDH2208	12/7/2022	125	4.54:1	115,100	35.34%	2,090	0.5%	2,400	1,151.29	43,019	35,891	39,000
CMBB2206	10/3/2022	60	10:1	124,600	36.21%	620	0.0%	1,000	499.54	31,422	22,222	26,950
CHDB2208	3/8/2023	216	5:1	1,200	38.59%	1,250	0.0%	1,100	762.58	28,499	23,999	24,900
CHDB2207	12/7/2022	125	3:1	500	38.59%	1,490	0.0%	2,500	867.79	24,860	24,500	24,900
CKDH2209	3/28/2023	236	7.26:1	217,100	35.34%	1,400	-0.7%	1,200	866.10	53,768	36,344	39,000
CVNM2207	3/28/2023	236	15.4:1	5,300	26.69%	1,160	-0.9%	1,100	647.48	68,668	68,668	73,300
CHPG2215	3/28/2023	236	10:1	2,243,900	37.66%	710	-1.4%	1,000	354.63	37,299	22,999	23,650
CSTB2211	12/27/2022	145	8:1	773,700	47.13%	700	-1.4%	1,000	537.16	26,693	23,333	25,200
CSTB2213	1/3/2023	152	8:1	74,000	47.13%	690	-1.4%	1,000	471.90	36,044	24,444	25,200
CSTB2214	1/9/2023	158	2:1	48,400	47.13%	2,750	-1.8%	1,630	2,313.82	23,480	23,000	25,200
CVRE2211	3/28/2023	236	8:1	1,079,600	40.32%	840	-2.3%	1,000	525.69	28,888	28,888	29,000
CPNJ2203	10/3/2022	60	24.8:1	378,900	41.14%	790	-2.5%	1,300	669.55	139,190	109,999	116,000
CVRE2210	12/7/2022	125	4:1	79,300	40.32%	1,290	-3.0%	2,300	769.85	28,800	28,800	29,000
CSTB2215	3/28/2023	236	5:1	79,800	47.13%	1,430	-3.4%	1,100	1,160.67	30,922	22,222	25,200

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

** 転換率

評価:

- ・2022年8月4日には、カワードワラント市場は証券市場と共に上昇した。
- ・価格については、CACB2201とCVHM2206はそれぞれ、+900.00%、+140.00%と最も上昇した。売買代金は前日比+3.66%と増加した。CKDH2204の売買代金は最大となり、全市場9.19%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCHPG2203、CVHM2210、CVHM2115とCVHM2211の時価が理論価格と相当している。CTPB2203、CPNW2202、CTPB2204とCVPB2204の収益性は最も高かった。CPNJ2202、CSTB2214とCKDH2208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	62.7	1.5%	0.6	3,990	11.8	3,360	18.7	4.1	49.0%	24.2%			
PNJ	小売	116.0	0.0%	0.6	1,222	2.4	5,308	21.9	3.4	49.0%	19.9%			
BVH	保険	58.4	0.0%	1.2	1,885	4.8	2,380	24.5	2.0	26.6%	8.3%			
PVI	保険	45.1	-1.3%	0.7	459	0.1	3,287	13.7	1.3	58.5%	9.9%			
VIC	不動産	66.4	0.6%	0.5	11,011	3.3	(138)	N/A	N/A	2.4	12.2%	-0.4%		
VRE	不動産	29.0	-0.2%	1.1	2,865	1.5	571	50.8	2.1	32.0%	4.2%			
NVL	不動産	63.0	1.8%	0.8	11,927	14.2	6,442	9.8	2.3	23.2%	25.8%			
DXG	不動産	26.7	-1.1%	1.4	705	10.5	1,223	21.8	1.7	29.8%	8.2%			
SSI	証券	23.6	0.0%	1.7	1,526	21.4	2,692	8.7	1.6	23.8%	22.0%			
VCI	証券	43.6	-0.9%	1.0	635	9.6	4,546	9.6	2.0	18.4%	24.3%			
HCM	証券	27.5	2.4%	1.6	546	11.7	2,522	10.9	1.6	42.3%	17.5%			
FPT	技術	86.1	日続伸。	1.0	4,107	11.4	4,517	19.1	4.8	49.0%	27.1%			
FOX	技術	72.0	0.0%	0.4	1,028	0.0	4,926	14.6	3.9	0.0%	30.2%			
GAS	オイルとガス	109.0	-2.7%	1.0	9,070	3.7	6,709	16.2	3.5	3.0%	24.3%			
PLX	オイルとガス	42.1	2.9%	1.5	2,326	2.7	514	81.9	2.3	17.6%	3.1%			
PVS	オイルとガス	23.6	-2.9%	1.6	490	7.7	1,115	21.2	0.9	8.8%	4.4%			
BSR	オイルとガス	24.3	-1.6%	0.8	3,276	10.6	2,108	11.5	2.0	41.1%	19.1%			
DHG	薬局	91.4	-0.5%	0.3	520	0.1	6,361	14.4	3.2	54.2%	23.1%			
DPM	肥料	47.5	-1.8%	1.3	808	4.7	12,920	3.7	1.5	15.8%	50.2%			
DCM	肥料	32.4	0.0%	1.2	746	4.8	7,062	4.6	1.7	8.9%	44.8%			
VCB	バンク	82.5	3.8%	0.8	16,975	8.0	#N/A	N/A	#N/A	N/A	#N/A	N/A	23.5%	#VALUE!
BID	バンク	39.3	0.0%	1.2	8,643	4.1	2,574	15.3	2.2	16.9%	15.1%			
CTG	バンク	28.9	-0.9%	1.5	6,028	6.6	3,056	9.4	1.4	26.7%	15.1%			
VPB	バンク	29.4	1.4%	1.2	5,682	23.3	3,755	7.8	1.4	17.6%	22.2%			
MBB	バンク	27.0	0.2%	1.3	4,427	13.1	4,160	6.5	1.5	23.2%	26.0%			
ACB	バンク	25.0	0.2%	1.1	3,671	4.8	3,482	7.2	1.6	30.0%	25.4%			
BMP	プラスチック	62.9	0.0%	0.7	224	0.2	4,413	14.3	2.1	85.4%	15.2%			
NTP	プラスチック	40.7	-1.7%	0.6	229	0.1	3,914	10.4	1.8	17.8%	18.0%			
MSR	天然資源	20.6	-1.9%	1.6	984	0.2	178	115.7	1.6	10.1%	1.4%			
HPG	鋼	23.7	-0.4%	1.1	5,979	31.0	4,747	5.0	1.4	20.3%	31.8%			
HSG	鋼	19.9	1.8%	1.5	431	10.9	4,213	4.7	0.8	6.7%	19.3%			
VNM	消費者の主食	73.3	-0.1%	0.6	6,661	5.5	4,055	18.1	4.5	54.7%	25.8%			
SAB	消費者の主食	185.0	-2.6%	0.8	5,158	2.4	7,018	26.4	5.2	62.8%	21.0%			
MSN	消費者の主食	107.9	-1.9%	1.0	6,679	7.5	7,172	15.0	5.3	28.9%	40.2%			
SBT	消費者の主食	18.9	-0.8%	1.6	516	1.8	1,381	13.6	1.4	8.2%	8.3%			
ACV	輸送	85.8	-2.4%	0.8	8,121	0.2	363	236.5	5.0	3.8%	1.3%			
VJC	輸送	129.2	1.7%	1.1	3,042	4.1	695	185.9	4.0	16.8%	2.2%			
HVN	輸送	17.1	0.3%	1.7	1,646	1.1	(4,381)	#N/A	N/A	#N/A	N/A	5.9%	#VALUE!	
GMD	輸送	51.6	-2.3%	0.9	676	3.8	2,702	19.1	2.3	46.2%	12.5%			
PVT	輸送	20.5	-0.7%	1.4	288	2.1	2,000	10.2	1.2	13.6%	12.5%			
VCS	材料	77.4	0.8%	0.8	538	0.4	10,334	7.5	2.5	3.1%	36.9%			
VGC	材料	58.1	-4.9%	0.7	1,133	5.0	4,345	13.4	3.4	5.7%	27.6%			
HT1	材料	16.7	-0.6%	1.1	277	0.7	506	33.0	1.2	1.9%	3.6%			
CTD	建設	63.7	2.1%	1.2	205	3.2	(961)	#N/A	N/A	0.6	52.4%	-0.8%		
CII	建設	20.8	-1.4%	1.5	228	6.9	1,253	16.6	1.0	10.6%	6.3%			
REE	電気	80.0	-1.5%	-1.4	1,236	3.3	6,593	12.1	2.0	49.1%	17.7%			
PC1	電気	38.7	-2.2%	-0.4	395	3.4	2,077	18.6	1.9	4.7%	10.5%			
POW	電気	13.6	-0.7%	0.6	1,385	5.8	674	20.2	1.1	2.3%	5.3%			
NT2	電気	26.3	-1.3%	0.6	329	1.3	3,116	8.4	1.7	14.2%	20.9%			

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日続伸。

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

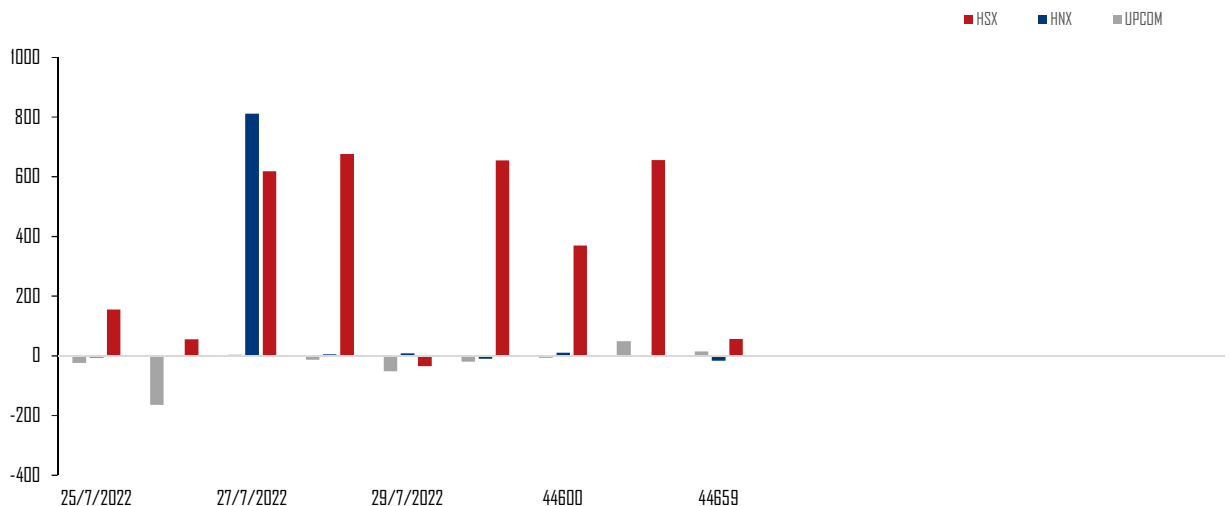
HNXの上昇率上位5銘柄

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

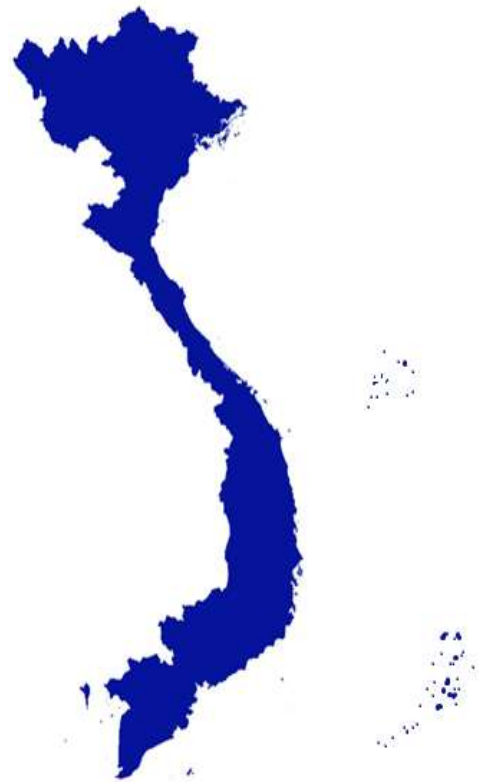
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

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