

2022 08 25

Vietnam Daily Review

VNインデックス3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+11.72ポイント高の1288.88で引けた。HNXインデックスは+0.56ポイント高の301.86で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVHM (+1.44%)、GVR (+1.32%)、VIC (+0.97%)、VPB (+0.63%)、CTG (+0.61%)だった。
- ・主に下落した銘柄はGAS (-0.39%)、VGC (-0.14%)、FLC (-0.06%)、CMG (-0.06%)、PVD (-0.04%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比6.83%増の13兆6,740億ドンに達した。総売買代金が15兆4,820億ドンに達した。変動幅は12.02ポイントだった。上昇には279銘柄、変わらずに77銘柄、下落には168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905億2,000万ドンだった。最も買われたのはVNM (760億3,000万ドン)、MSN (614億ドン)、CTG (320億2,000万ドン)だった。一方、HNX市場での売越額は31億4,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いた後、更に値を上げ、1260~1285ポイントの範囲を上回って、11.72ポイント高の1288.88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12業界が上昇し、VN30インデックスうちの26業界が高値で引けた。外国人投資家はHSX市場で買い越したが、HNX市場で売り越した。VNインデックスは次の数日に抵抗線を接近すると、1285ポイントの周りでもみ合う可能性がある。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短期先物取引契約を取引するべきだ。カバードワラント：2022年8月25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 1288.88

売買代金: 13673.88 億ドン **11.72 (0.92%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 0.00

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 0.00

#VALUE!
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	95.2	0.3%
金価格	1,764	0.8%
対USD為替レート	23,428	-0.1%
対EUR為替レート	23,431	0.1%
対円為替レート	17,160	0.1%
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
VNM	76.03	PHR	#####
MSN	61.40	NVL	#####
CTG	32.02	VGC	#####
SHB	29.56	BVH	#####
PVD	27.21	TLG	#####

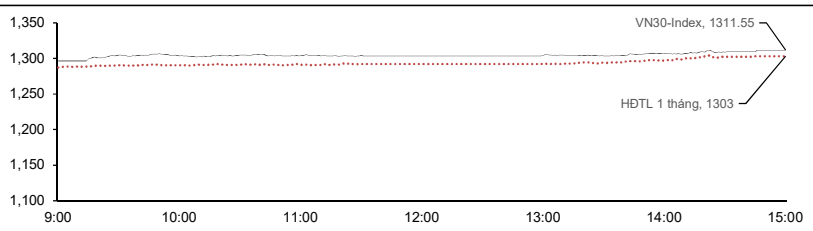
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2209	1303.00	1.38%	-8.55	-1.1%	186354	9/15/2022	21
VN30F2210	1299.00	1.30%	-12.55	-47.3%	285	10/20/2022	56
VN30F2212	1292.30	1.40%	-19.25	-65.7%	34	12/15/2022	112
VN30F2203	1283.50	0.92%	-28.05	-31.0%	89	3/16/2023	203

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	#VALUE!	269590.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00

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	#VALUE!	23,650.00	1.50
0/1/1900	#VALUE!	26,450.00	2.12
0/1/1900	#VALUE!	25,700.00	2.39
0/1/1900	#VALUE!	39,550.00	0.76
0/1/1900	#VALUE!	112,800.00	0.80

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは+15.14ポイント高の1311.55で引けた。変動幅は12.29ポイントだった。GAS、VJC、BID、VCBとBVHなどの主力株が堅調で、VN30インデックスを牽引した。
- ・売買代金が増加し、テクニク指標が中立傾向を示したことと共に、VN30インデックスが丸坊主のローソク足パターンを形成したのは短期的な回復傾向を示した。投資家は次の数日に短期先物取引契約を取引するべきだ。
- ・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、先物取引契約が減少した。先物取引契約数を見ると、VN30F2303とVN30F221

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	損益分岐価格	実施価格	証券価格
CNVL2203	9/26/2022	32	5:1	85,900	25.62%	250	13.6%	2,150	83	93,300	92,500	83,600
CVRE2207	10/20/2022	56	8:1	3,300	40.02%	190	11.8%	1,000	84	33,333	33,333	29,200
CTCB2205	10/19/2022	55	5:1	100	32.45%	400	11.1%	2,300	53	52,450	46,500	39,550
CMWG2206	1/9/2023	137	4.97:1	4,700	34.77%	1,170	10.4%	2,590	131	94,273	88,060	68,400
CVHM2207	10/19/2022	55	7.77:1	326,100	25.60%	320	10.3%	2,000	32	85,537	73,000	61,000
CVHM2210	1/3/2023	131	16:1	639,000	25.60%	250	8.7%	1,000	14	97,439	79,999	61,000
CVIC2206	9/19/2022	25	10:1	11,000	27.32%	150	7.1%	1,900	0	87,500	82,500	65,900
CMBB2205	10/31/2022	67	2:1	345,900	35.14%	1,030	3.0%	3,000	229	47,800	32,000	23,650
CVNM2207	3/28/2023	215	15.4:1	131,100	26.71%	1,340	2.3%	1,100	588	68,668	68,668	77,900
CHPG2215	3/28/2023	215	10:1	1,563,700	37.33%	650	1.6%	1,000	373	37,299	22,999	23,850
CVJC2203	12/27/2022	124	20:1	94,700	27.83%	770	1.3%	1,400	283	190,931	131,131	123,400
CKDH2205	9/26/2022	32	2.72:1	9,600	33.33%	30	0.0%	1,750	1	65,158	58,000	38,200
CHDB2204	9/26/2022	32	2:1	14,200	35.92%	70	0.0%	1,700	45	33,000	31,500	26,450
CVPB2204	11/15/2022	82	16:1	21,500	37.32%	410	0.0%	1,000	120	30,888	30,888	31,950
CHDB2201	9/21/2022	27	5:1	69,600	35.92%	60	0.0%	1,500	19	43,799	30,999	26,450
CVHM2206	9/26/2022	32	4.85:1	23,000	25.60%	30	0.0%	1,790	0	84,918	86,000	61,000
CTCB2204	10/7/2022	43	5:1	1,200	32.45%	300	0.0%	2,400	58	50,550	45,000	39,550
CMSN2205	12/27/2022	124	19.8:1	400	42.39%	910	-3.2%	1,200	549	136,510	113,979	112,800
CMSN2202	10/7/2022	43	8.27:1	366,800	42.39%	280	-3.4%	2,220	237	140,017	127,552	112,800
CKDH2206	9/20/2022	26	7.26:1	166,300	33.33%	20	-33.3%	1,100	2	69,936	52,999	38,200

ノート: * 理論的な価格はBlack-Scholes公式に基づき計算されます

非リスク金利 4.75%

** 転換率

評価:

- ・2022年8月25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、CVHM2208とCVNM2203はそれぞれ、+50%、+22.22%と最も上昇した。売買代金は前日比8.88%と減少した。CHDB2205の売買代金は最大となり、全市場16.02%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCSTB2214、CKDH2209、CKDH2208とCTPB2204の時価が理論価格と相当している。CHDB2205、CNVL2206、CVHM2211とCKDH2206の収益性は最も高かった。CFPT2203、CPNJ2201、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3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

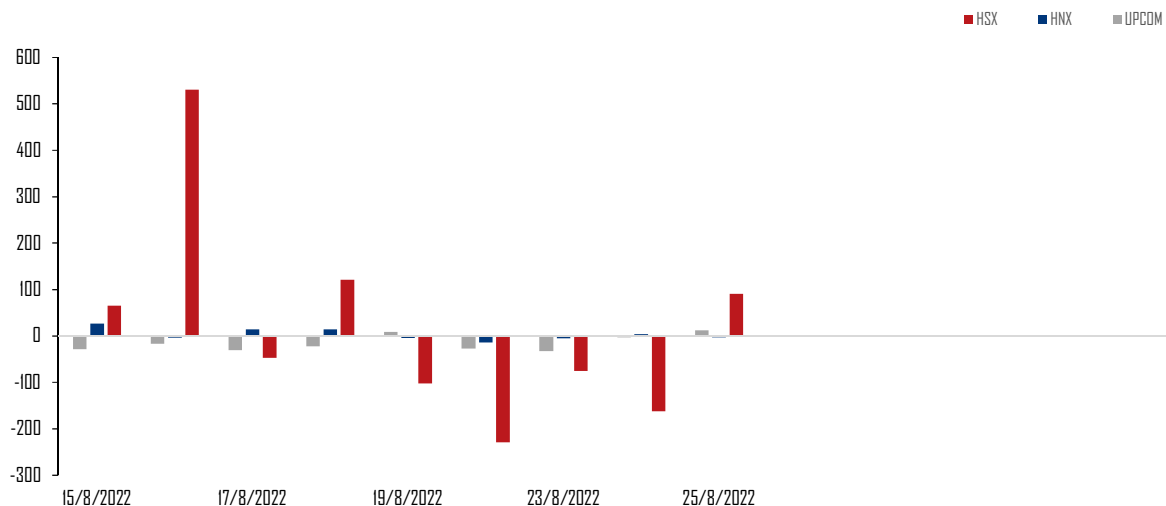
HNXの上昇率上位5銘柄

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

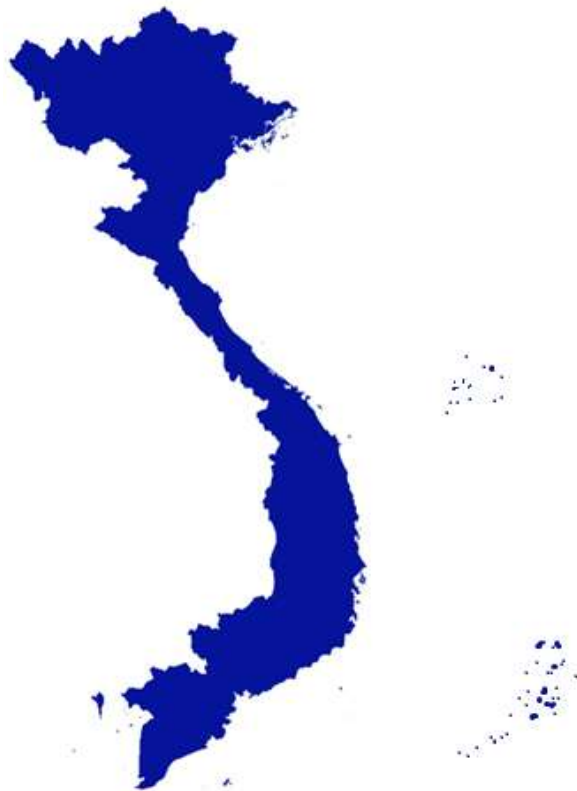
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

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