

2023 05 04

Vietnam Daily Review

VNインデックス反落。

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-8.51ポイント安の1040.61で引けた。HNXインデックスは+0.67ポイント高の208.15で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はHVN (+0.44%)、ACB (+0.42%)、BID (+0.32%)、FPT (+0.28%)、DHG (+0.24%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-2.37%)、MSN (-0.89%)、SAB (-0.87%)、VIC (-0.76%)、VNM (-0.73%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比+0.01%増の9兆2,590ドンに達した。総売買代金が10兆4,960億ドンに達した。変動幅は10.94ポイントだった。上昇には143銘柄、変わらずには55銘柄、下落には247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3,260億ドンだった。最も売られたのはVNM (380億ドン)、CTG (307億2,000万ドン)、STB (298億1,000万ドン) だった。HNX市場での買越額は123億9,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは安値で寄り付いた後、下げ幅を拡大し、-8.51ポイント安の1040.61で引けた。19業界うちの10業界が上昇したが、値下がり銘柄数が値上がり銘柄数より多かったのはキャッシュフローがいくつかの銘柄に集中していると示した。そのうち、最も上昇率は医療業界だった。一方、小売り業界は大幅に下落した。VNインデックスは短期的に1030~1050ポイントの範囲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下落した。投資家は次の数日に先物取引契約を慎重的に取引するべきだ。

カバードワラント：2023年5月4日には、カバードワラント市場は指定銘柄と共に下落した。

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 1040.61

売買代金: 9258.86 億ドン **-8.51 (-0.81%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 208.15

売買代金: 0 億ドン **0.67 (0.32%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 77.27

#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	69.2	0.8%
金価格	2,033	-0.3%
対USD為替レート	23,450	0.0%
対EUR為替レート	25,987	0.2%
対円為替レート	17,426	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	5.26%	0.2%
国債金利 (5年間物)	2.55%	-0.3%

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
FUEVFN	56.76	VNM	-38.00
KDH	17.54	CTG	-30.72
VPB	11.57	STB	-29.81
FRT	9.08	GMD	-28.93
VIX	5.53	MSN	-24.73

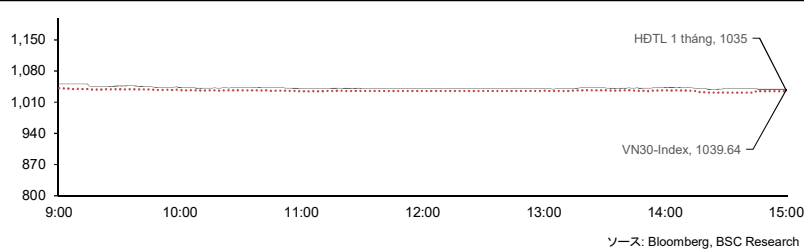
ソース：BSCリサーチ

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



契約名	契約値	増減(日)	差	%	売買高	満期日	日数
VN30F2312	1027.40	-0.47%	-12.24	-32.2%	61	12/21/2023	231
VN30F2305	1035.00	-0.72%	-4.64	-3.2%	160855	5/18/2023	14
VN30F2306	1029.50	-0.25%	-10.14	160.0%	1074	6/15/2023	42
VN30F2309	1028.20	-0.82%	-11.44	-8.3%	33	9/21/2023	140

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
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
ACB	24.70	2.07	1.50

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
BCM	78.1	1.29	-0.03
0/1/1900	0.0	0.93	0.00
0/1/1900	0.0	0.57	0.00
0/1/1900	0.0	0.78	0.00
VPB	19.6	0.96	-1.72

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは11.79ポイント高の1039.64で引けた。変動幅は9.7ポイントだった。VPB、MSN、MWG、VNMとHPG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インデックスは安値で寄り付いた後、下げ幅を拡大し、安値で引けた。売買代金はMA20の下にある。投資家は次の数日に先物取引契約を慎重的に取引するべきだ。
- ・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、VN30F2306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	損益分岐価格	実施価格	証券価格
CSTB2303	11/9/2023	189	4:1	127,700	49.24%	2,740	0.00%	4,500	1,359	27,620	22,000	25,150
CHPG2226	9/5/2023	124	4:1	53,000	48.90%	2,080	0.00%	2,300	870	23,360	19,500	21,300
CFPT2212	6/6/2023	33	10:1	103,600	24.30%	890	0.00%	1,870	888	81,200	70,000	78,500
CVRE2220	9/5/2023	124	4:1	116,500	43.67%	620	-1.59%	2,100	464	33,920	30,000	27,250
CHPG2306	11/9/2023	189	8:1	327,700	48.90%	1,100	-1.79%	1,380	479	23,510	20,000	21,300
CSTB2224	9/5/2023	124	1:1	142,000	49.24%	3,220	-2.42%	2,700	6,144	26,380	20,000	25,150
CHPG2225	6/6/2023	33	2:1	281,000	48.90%	1,450	-2.68%	1,550	2,215	21,290	17,000	21,300
CVRE2216	8/31/2023	119	2.66:1	593,300	43.67%	320	-3.03%	1,650	571	33,240	31,000	27,250
CTCB2214	6/6/2023	33	2:1	79,200	43.74%	920	-3.16%	2,470	1,377	29,160	27,000	29,050
CMBB2213	6/6/2023	33	3:1	174,200	39.01%	600	-3.23%	1,550	529	19,280	17,000	18,200
CSTB2225	11/1/2023	181	5:1	144,400	49.24%	3,420	-3.39%	2,900	1,262	27,180	20,500	25,150
CVPB2302	8/16/2023	104	5.89:1	43,300	38.80%	1,960	-4.39%	2,400	379	23,140	18,600	19,550
CMBB2214	9/5/2023	124	2:1	527,700	39.01%	1,510	-5.63%	2,400	1,205	19,820	17,000	18,200
CHPG2227	11/1/2023	181	3:1	945,900	48.90%	2,070	-5.91%	2,400	1,169	24,500	20,500	21,300
CVPB2214	9/5/2023	124	15.7:1	168,300	38.80%	1,050	-6.25%	1,100	217	21,480	17,000	19,550
CMWG2302	11/9/2023	189	10:1	503,500	45.14%	300	-6.25%	1,350	173	53,060	50,000	37,900
CTCB2216	11/1/2023	181	4:1	77,000	43.74%	1,480	-7.50%	1,800	1,156	32,380	27,500	29,050
CMWG2214	9/5/2023	124	10:1	703,100	45.14%	310	-11.43%	1,100	149	50,700	46,500	37,900
CVRE2221	11/1/2023	181	4:1	131,400	43.67%	650	-13.33%	2,100	447	36,340	32,500	27,250
CVNM2211	6/6/2023	33	1.91:1	505,400	22.89%	570	-20.83%	2,500	1,578	78,300	66,806	68,600

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:

- ・2023年5月4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、CHPG2227は+26.02%と最も上昇した。売買代金は前日比69.98%増となった。CHPG2227の売買代金は最大となり、全市場の26.02%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCVNM2211、CSTB2224、CVRE2216とCHPG2225の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CHPG2302とCTPB2301の収益性は最も高かった。CSTB2224、CHPG2225、CHPG2301とCTCB2214の益回り率は最も高かった。

BSC30 Portfolio

銘柄	業界	終値(1千 VND)	変動率%	Beta	時価総額(100万USD)	売買代金(100万USD)	EPS fw (VND)	P/E fw	目標価格(VND/株)	外国人保有率	レポートのリンク
VCB	銀行	88.5	-2.2%	0.9	18,210	1.9	7,311	12.1	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	43.8	0.6%	1.0	9,622	0.7	4,208	10.4	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.6	-1.8%	1.2	5,706	6.4	3,972	4.9	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	29.1	-1.5%	1.4	4,442	2.4	14,982	1.9	-	17.6%	Link
ACB	銀行	18.2	ボックス反落。	1.4	3,588	4.6	14,982	1.2	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	25.2	-0.6%	1.3	2,061	9.2	4,640	5.4	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	15.7	1.0%	1.1	2,730	1.4	4,603	3.4	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	26.2	1.6%	1.6	874	14.4	4,880	5.4	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	39.1	1.3%	1.7	561	3.9	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	33.5	0.4%	1.6	653	0.8	1,217	27.5	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	21.3	-1.6%	1.0	5,385	15.4	1,916	11.1	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	49.5	0.0%	0.9	9,371	2.8	1,896	26.1	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	27.3	-1.6%	1.1	2,692	1.7	5,227	5.2	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	30.5	2.2%	0.4	949	4.1	1,576	19.3	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	34.0	1.6%	1.5	567	6.0	2,557	13.3	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	51.0	-1.0%	1.5	842	3.8	14,120	3.6	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	32.8	-2.4%	1.3	558	2.1	6,793	4.8	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	23.4	-1.5%	0.8	537	1.5	2,625	8.9	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	92.0	-0.9%	0.8	7,656	0.8	2,292	40.1	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	37.5	0.0%	1.1	2,069	1.1	1,340	27.9	45,000	20.4%	Link
POW	エネルギー	25.1	-0.8%	1.3	522	3.3	993	25.3	33,000	6.3%	Link
REE	エネルギー	20.3	-3.1%	1.5	491	2.7	7,698	2.6	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	13.0	-0.8%	1.2	1,324	4.7	3,895	3.3	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	68.6	-2.0%	1.2	6,234	8.0	2,605	26.3	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	70.6	-3.4%	1.1	4,370	2.6	3,456	20.4	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	37.9	-3.3%	1.3	2,411	4.1	7,475	5.1	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	76.1	-1.2%	0.7	1,085	0.9	2,965	25.7	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	59.5	-1.3%	1.2	474	1.2	12,800	4.6	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	50.7	-3.6%	0.7	664	3.3	7,059	7.2	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	78.5	1.3%	0.8	3,744	1.7	5,901	13.3	91,900	49.0%	Link

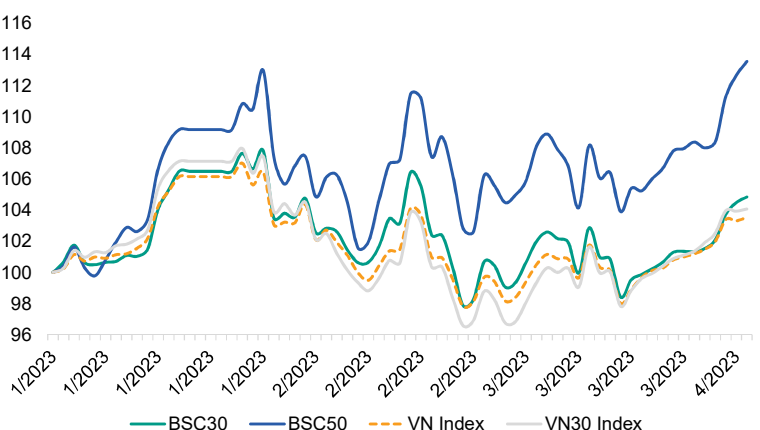
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討するべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	-0.9%	0.3%	-0.8%	-1.1%
1 tuần	0.2%	1.2%	0.1%	-0.2%
1 tháng	-3.3%	0.7%	-3.5%	-4.5%
3 tháng	1.9%	8.6%	1.5%	2.6%



BSC30とBSC50の効率



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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

VNインデックス反落。

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

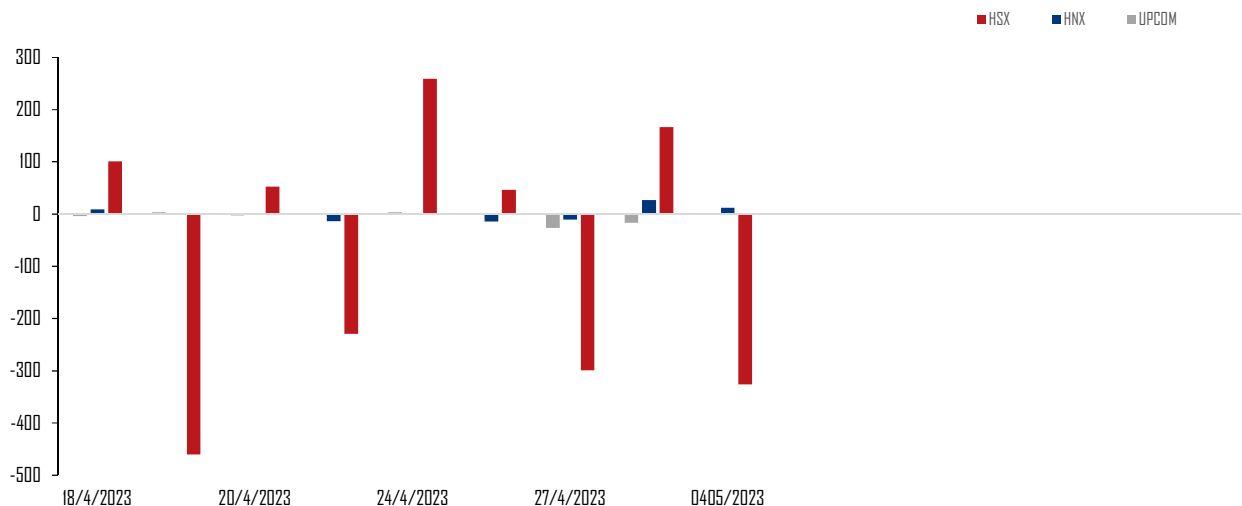
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!
#REF!	#REF!	#REF!	#REF!	#REF!

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