

2023 05 11

Vietnam Daily Review

VNインデックス4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-1.14ポイント安の1057.12で引けた。HNXインデックスは+0.52ポイント高の214.41で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVPB (+0.42%)、NVL (+0.24%)、DIG (+0.2%)、VRE (+0.15%)、CTG (+0.12%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-1.19%)、GAS (-0.48%)、VNM (-0.26%)、VHM (-0.22%)、TCB (-0.18%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比+9.86%増の10兆7,950ドンに達した。総売買代金が11兆5,310億ドンに達した。変動幅は6.97ポイントだった。上昇には197銘柄、変わらずには80銘柄、下落には155銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場及びHNX市場での売越額はそれぞれ、1,226億7,000万ドン、169億5,000万ドンだった。最も買われたのはVND (721億7,000万ドン)、SSI (641億7,000万ドン)、STB (372億2,000万ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いたが、前場の中盤から前日終値付近でもみ合った後、-1.14ポイント安の1057.12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11業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は医療業界、建設・建材業界だった。外国人投資家はHSX市場及びHNX市場で買い越した。現在の傾向は投資家の気迷いと示した。VNインデックスは5月に会議第15期（5月22日～6月10日）に関する情報を待っていることで、明確なシグナルを見せていない。先物取引契約：VN30F2309の以外、他の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を慎重的に取引するべきだ。カバードワラント：2023年5月11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 1057.12

売買代金: 10794.89 億ドン **-1.14 (-0.11%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

HNX-INDEX 214.41

売買代金: 0 億ドン **0.52 (0.24%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

UPCOM-INDEX 79.13

#VALUE!
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン **0.29 (0.37%)**

データ

	価値	増減率
石油価格	73.1	0.8%
金価格	2,024	-0.3%
対USD為替レート	23,469	0.0%
対EUR為替レート	25,651	-0.5%
対円為替レート	17,416	0.0%
銀行間金利（1か月物）	5.10%	0.2%
国債金利（5年間物）	2.64%	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
VND	72.17	NLG	-18.35
SSI	64.17	TV2	-16.88
STB	37.22	VCB	-15.56
VRE	27.40	DPM	-15.17
HDG	21.74	DHC	-14.61

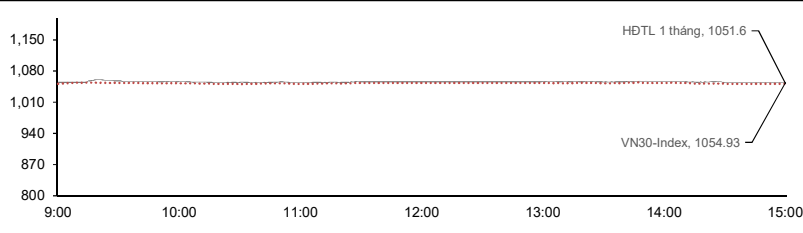
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2312	1045.50	0.11%	-9.43	-29.6%	19	12/21/2023	224
VN30F2305	1051.60	0.10%	-3.33	-7.1%	137394	5/18/2023	7
VN30F2306	1049.90	0.12%	-5.03	-6.7%	915	6/15/2023	35
VN30F2309	1046.30	-0.03%	-8.63		37	9/21/2023	133

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
VPB	19.80	1.28	1.21

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
PDR	14.0	3.76	0.06
0/1/1900	0.0	0.90	0.00
0/1/1900	0.0	0.23	0.00
0/1/1900	0.0	0.27	0.00
VCB	91.0	0.19	-0.54

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは0.06ポイント安の1054.93で引けた。変動幅は7.86ポイントだった。VCB、TCB、VNM、MWGとVHM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インデックスは高値で寄り付いたが、後場に入ると、上げ幅を縮小し、終盤にわずかに下落した。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。
- ・VN30F2309の以外、他の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、VN30F2312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、VN30F2306とVN30F2312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	損益分岐価格	実施価格	証券価格
CHPG2225	6/6/2023	26	2:1	421,100	48.72%	1,640	3.80%	1,550	2,412	21,290	17,000	21,750
CACB2301	8/7/2023	88	10:1	404,000	35.49%	300	3.45%	1,300	83	29,260	27,700	24,900
CHPG2226	9/5/2023	117	4:1	10,900	48.72%	2,140	1.42%	2,300	930	23,360	19,500	21,750
CFPT2213	9/5/2023	117	10:1	30,900	24.07%	1,090	0.93%	1,800	757	87,100	74,500	79,100
CACB2208	9/5/2023	117	4:1	42,900	35.49%	1,280	0.79%	1,400	1,064	26,660	21,500	24,900
CFPT2212	6/6/2023	26	10:1	135,600	24.07%	940	0.00%	1,870	935	81,200	70,000	79,100
CFPT2214	11/1/2023	174	10:1	3,300	24.07%	1,210	0.00%	1,900	784	89,600	76,000	79,100
CFPT2301	6/27/2023	47	6:1	4,400	24.07%	1,040	0.00%	2,240	180	94,500	84,000	79,100
CFPT2302	8/16/2023	97	3.99:1	400	24.07%	960	0.00%	2,300	518	98,100	85,000	79,100
CHPG2301	6/27/2023	47	2:1	7,300	48.72%	2,000	0.00%	1,970	1,630	23,300	19,000	21,750
CHPG2302	9/27/2023	139	2:1	500	48.72%	2,510	0.00%	2,120	1,833	24,900	20,000	21,750
CHPG2304	8/16/2023	97	2:1	3,500	48.72%	1,240	0.00%	2,700	887	26,140	23,000	21,750
CHPG2305	8/7/2023	88	7.26:1	30,200	48.72%	680	0.00%	1,700	217	25,600	23,200	21,750
CHPG2306	11/9/2023	182	8:1	562,500	48.72%	1,180	0.00%	1,380	508	23,510	20,000	21,750
CMBB2211	8/31/2023	112	10:1	598,000	38.91%	110	0.00%	1,200	9	27,520	27,000	18,500
CHPG2227	11/1/2023	174	3:1	1,717,200	48.72%	2,180	-0.91%	2,400	1,242	24,500	20,500	21,750
CHPG2303	7/17/2023	67	2:1	9,600	48.72%	1,850	-1.07%	2,800	523	26,140	23,900	21,750
CFPT2303	11/9/2023	182	3.99:1	181,200	24.07%	610	-3.17%	1,510	857	96,000	86,000	79,100
CMBB2213	6/6/2023	26	3:1	646,600	38.91%	580	-3.33%	1,550	579	19,280	17,000	18,500
CFPT2210	8/31/2023	112	10:1	321,700	24.07%	240	-4.00%	2,350	121	94,700	90,000	79,100

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:

- ・2023年5月11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、CACB2208は+0.37%と最も上昇した。売買代金は前日比111.41%増となった。CACB2208の売買代金は最大となり、全市場の0.37%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCMSN2214、CMWG2213、CVNM2211とCVRE2216の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CHPG2302とCHPG2225の収益性は最も高かった。CSTB2224、CHPG2225、CVNM2211とCHPG2301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	91.0	-1.1%	0.9	18,724	2.0	7,311	12.4	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	45.0	0.0%	1.0	9,897	1.0	4,208	10.7	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.8	1.3%	1.1	5,779	5.7	3,972	5.0	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	29.1	-0.7%	1.4	4,450	3.2	14,982	1.9	-	17.6%	Link
ACB	銀行	18.5	小幅反落。	1.4	3,647	6.0	14,982	1.2	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	26.4	0.2%	1.3	2,164	17.2	4,640	5.7	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	16.7	-0.9%	1.1	2,904	2.6	4,603	3.6	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	27.6	-0.7%	1.6	921	8.6	4,880	5.7	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	39.6	-1.0%	1.7	568	3.9	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	37.0	-0.3%	1.6	721	2.7	1,217	30.4	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	21.8	0.2%	1.0	5,499	12.9	1,916	11.4	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	49.2	-0.4%	0.9	9,305	1.1	1,896	25.9	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	28.1	0.9%	1.1	2,771	4.0	5,227	5.4	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	30.0	0.5%	0.4	933	1.9	1,576	19.0	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	33.4	-1.5%	1.5	557	3.5	2,557	13.0	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	52.2	2.0%	1.5	862	7.5	14,120	3.7	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	33.4	1.4%	1.3	568	3.3	6,793	4.9	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	24.4	2.7%	0.8	560	4.2	2,625	9.3	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	92.2	-1.1%	0.8	7,672	1.6	2,292	40.2	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	37.8	0.0%	1.1	2,085	1.0	1,340	28.2	45,000	20.4%	Link
POW	イリティ	26.1	0.4%	1.3	542	7.2	993	26.3	33,000	6.3%	Link
REE	イリティ	22.3	2.1%	1.5	539	8.6	7,698	2.9	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	13.3	-0.7%	1.2	1,354	3.7	3,895	3.4	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	70.0	-0.7%	1.2	6,361	1.4	2,605	26.9	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	73.8	0.3%	1.1	4,568	1.5	3,456	21.4	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	38.7	-0.8%	1.3	2,462	2.8	7,475	5.2	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	75.0	-0.3%	0.8	1,070	1.1	2,965	25.3	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	61.2	-0.3%	1.2	488	0.8	12,800	4.8	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	49.5	-1.8%	0.7	649	2.5	7,059	7.0	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	79.1	0.1%	0.8	3,773	1.6	5,901	13.4	91,900	49.0%	Link

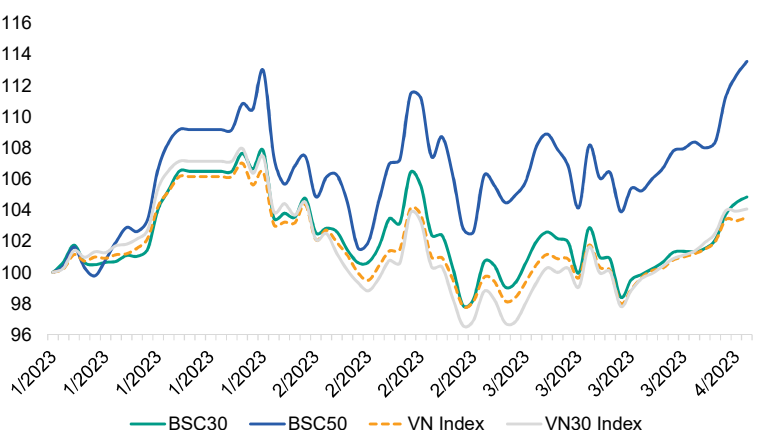
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討すべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	0.7%	1.1%	0.4%	0.5%
1 tuần	1.5%	2.1%	0.9%	0.3%
1 tháng	0.2%	3.3%	-0.7%	-2.1%
3 tháng	2.0%	10.5%	0.3%	0.6%



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4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
#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!

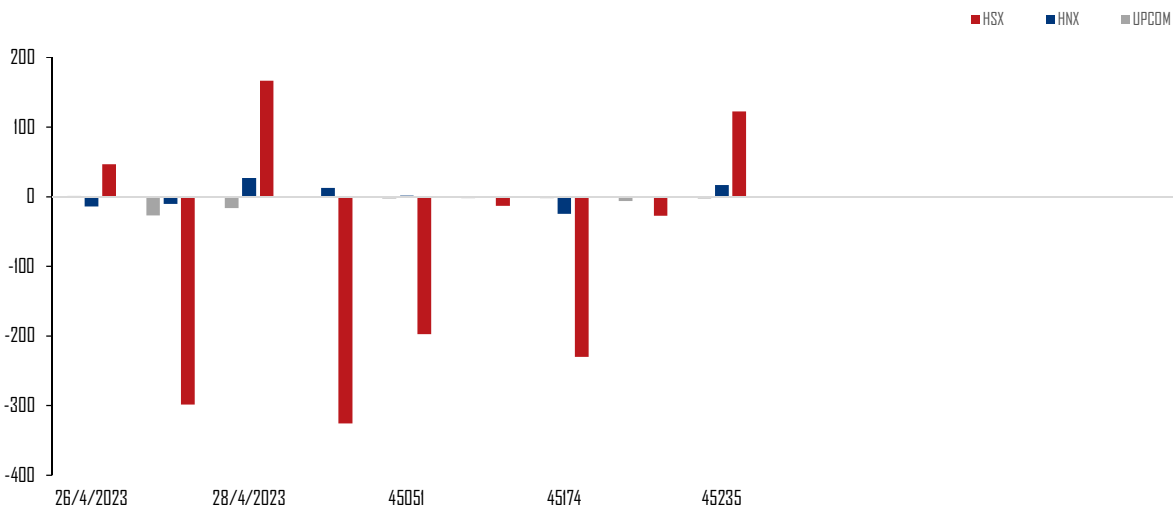
HNXの上昇率上位5銘柄

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