

2023 05 24

Vietnam Daily Review

VNインデックス続落。

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-4.06ポイント安の1061.79で引けた。HNXインデックスは+0.17ポイント高の215.96で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVHM (+0.87%)、MSN (+0.5%)、BSI (+0.09%)、FTS (+0.08%)、BCM (+0.08%)だった。
- ・主に下落した銘柄はHPG (-0.58%)、TCB (-0.48%)、BID (-0.44%)、VNM (-0.37%)、GAS (-0.34%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比-4.1%減の11兆3,570億 ドンに達した。総売買代金が13兆7,680億 ドンに達した。変動幅は9.01ポイントだった。上昇には168銘柄、変わらずには55銘柄、下落には215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5,698億6,000万ドンだった。最も売られたのはHPG (1,336億1,000万ドン)、VNM (951億9,000万ドン)、VND (780億6,000万ドン)だった。一方、HNX市場での買越額は143億 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、中盤からマイナス圏に転落し、前引けにかけてもみ合った。後場に入ると、マイナス圏で引き続きもみ合って、-4.06ポイント安の1061.79で引けた。市場の広さがネガティブな状態に転換し、19業界うちの15業界が下落した。そのうち、基本的なりソース業界、化学業界、小売り業界、銀行業界は下落した。一方、不動産業界、証券業界は国家銀行の利下げ決定のおかげで、活発に取引した。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インデックスは短期的に反発すると期待している。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24日には、カバードワラント市場は指定銘柄と共にもみ合った。

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 **1061.79**

売買代金: 11357.43 億ドン **-4.06 (-0.38%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX **215.96**

売買代金: 0 億ドン **0.17 (0.08%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX **80.93**

#VALUE! **-0.07 (-0.09%)**
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	73.8	1.3%
金価格	1,974	-0.1%
対USD為替レート	23,468	0.0%
対EUR為替レート	25,317	0.2%
対円為替レート	16,939	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	4.68%	0.1%
国債金利 (5年間物)	2.67%	0.1%

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
VCI	19.35	HPG	-133.61
VIC	17.21	VNM	-95.19
HDB	11.49	VND	-78.06
GMD	11.27	KBC	-61.93
VHM	9.80	CTG	-51.15

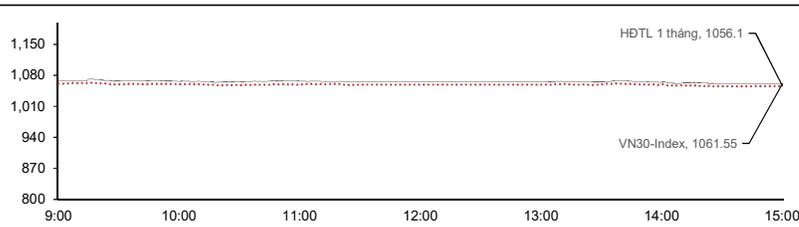
ソース：BSCリサーチ

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	1048.10	-0.39%	-13.45	0.0%	89	12/21/2023	213
VN30F2307	1052.20	-0.45%	-9.35	36.3%	698	7/20/2023	59
VN30F2306	1056.10	-0.32%	-5.45	3.2%	183543	6/15/2023	24
VN30F2309	1051.00	-0.10%	-10.55	-11.5%	46	9/21/2023	122

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
MSN	71.80	1.99	0.93

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
SAB	158.5	1.49	-0.04
0/1/1900	0.0	0.38	0.00
0/1/1900	0.0	0.37	0.00
0/1/1900	0.0	0.39	0.00
HPG	21.3	0.00	-1.32

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは - 6.5ポイント安の1061.55で引けた。変動幅は11.69ポイントだった。HPG, TCB, STB, VPB, và FPT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、前場の終盤に売りに勢いが強まったことで、マイナス圏に転落し、下げ幅を拡大し、 - 0.61%安で引けた。売買代金はMA20の上にある。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、VN30F2312とVN30F2309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、全ての先物取引契約が増加した。

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
CVRE2221	11/1/2023	161	4:1	233,300	43.53%	660	6.45%	1,000	435	25,188	32,500	27,650
CVHM2219	9/5/2023	104	5:1	335,500	39.71%	1,140	5.56%	1,100	763	24,672	56,000	54,500
CVHM2220	11/1/2023	161	5:1	113,100	39.71%	1,390	2.21%	2,100	875	28,160	58,000	54,500
CACB2208	9/5/2023	104	4:1	144,400	35.43%	1,340	0.75%	1,100	1,132	25,900	21,500	25,150
CMWG2302	11/9/2023	169	6:1	790,800	44.05%	300	0.00%	1,100	249	22,200	50,000	37,950
CHPG2225	6/6/2023	13	3:1	87,800	48.65%	1,650	-0.60%	2,300	1,575	98,100	17,000	21,300
CPOW2210	6/6/2023	13	1:1	216,800	39.34%	790	-1.25%	1,400	791	111,612	13,000	13,500
CFPT2214	11/1/2023	161	10:1	101,200	24.16%	1,320	-1.49%	1,870	967	81,200	76,000	81,300
CMBB2213	6/6/2023	13	3:1	269,600	38.98%	590	-1.67%	2,800	604	26,140	17,000	18,600
CVRE2216	8/31/2023	99	4:1	884,600	43.53%	290	-3.33%	1,700	357	31,020	31,000	27,650
CFPT2210	8/31/2023	99	10:1	424,400	24.16%	280	-3.45%	1,300	170	29,260	90,000	81,300
CVPB2214	9/5/2023	104	4:1	331,000	38.50%	950	-4.04%	1,650	814	42,040	17,000	19,400
CTCB2215	9/5/2023	104	4:1	95,600	44.03%	1,410	-4.08%	1,350	1,308	53,060	26,500	29,800
CMBB2214	9/5/2023	104	2:1	112,000	38.98%	1,520	-4.40%	2,700	1,326	26,140	17,000	18,600
CTCB2216	11/1/2023	161	4:1	129,300	44.03%	1,530	-4.97%	1,200	1,328	80,159	27,500	29,800
CSTB2225	11/1/2023	161	2:1	455,500	49.36%	4,230	-5.16%	2,600	4,252	108,400	20,500	27,400
CHPG2306	11/9/2023	169	3:1	1,382,900	48.65%	1,060	-7.02%	1,970	1,303	23,300	20,000	21,300
CSTB2303	11/9/2023	169	2:1	117,400	49.36%	3,550	-7.79%	1,100	3,724	50,700	22,000	27,400
CHPG2227	11/1/2023	161	2:1	151,000	48.65%	1,970	-10.05%	1,100	1,785	19,589	20,500	21,300
CTCB2214	6/6/2023	13	3:1	263,400	44.03%	980	-10.91%	1,800	1,149	51,200	27,000	29,800

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24日には、カワードワラント市場は証券市場と共にもみ合った。
- ・価格については、CSTB2225は+22.56%と最も上昇した。売買代金は前日比-43.87%減となった。CSTB2225の売買代金は最大となり、全市場の22.56%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCMSN2214、CMWG2213、CACB2301とCSTB2302の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CHPG2225とCHPG2302の収益性は最も高かった。CSTB2224、CSTB2225、CSTB2303とCHPG2225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	92.6	-0.2%	0.9	19,054	1.4	7,311	12.7	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	43.5	-0.8%	1.0	9,567	1.5	4,208	10.3	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.4	-0.8%	1.2	5,662	7.1	3,972	4.9	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	29.8	-1.8%	1.4	4,557	6.3	14,982	2.0	-	17.6%	Link
ACB	銀行	18.6	ボックス続落。	1.4	3,667	4.5	14,982	1.2	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	27.4	-2.0%	1.3	2,246	26.1	4,640	5.9	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	16.1	-1.8%	1.1	2,800	1.7	4,603	3.5	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	26.6	-1.1%	1.7	886	10.2	4,880	5.4	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	39.5	0.5%	1.7	567	4.8	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	36.5	-2.4%	1.6	712	1.3	1,217	30.0	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	21.3	-1.8%	1.0	5,385	19.0	1,916	11.1	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	54.5	1.5%	0.9	10,318	2.0	1,896	28.7	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	27.7	-0.2%	1.2	2,732	1.9	5,227	5.3	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	29.3	0.2%	0.4	912	2.1	1,576	18.6	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	32.2	-1.4%	1.5	537	3.2	2,557	12.6	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	50.8	-1.2%	1.5	839	2.4	14,120	3.6	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	31.3	-1.7%	1.3	533	2.8	6,793	4.6	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	23.6	-1.3%	0.8	542	1.4	2,625	9.0	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	92.5	-0.8%	0.8	7,697	1.7	2,292	40.4	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	37.3	-0.5%	1.1	2,061	1.0	1,340	27.8	45,000	20.4%	Link
POW	イリティ	29.5	0.0%	1.3	613	11.9	993	29.7	33,000	6.3%	Link
REE	イリティ	23.4	-1.7%	1.6	566	4.3	7,698	3.0	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	13.5	-1.1%	1.2	1,375	2.9	3,895	3.5	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	66.3	-1.0%	1.2	6,025	6.8	2,605	25.5	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	71.8	2.0%	1.1	4,444	2.9	3,456	20.8	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	38.0	-0.8%	1.3	2,415	2.1	7,475	5.1	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	71.5	-1.0%	0.7	1,020	1.4	2,965	24.1	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	57.3	0.5%	1.2	457	1.1	12,800	4.5	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	50.2	1.2%	0.7	658	1.0	7,059	7.1	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	81.3	-0.9%	0.8	3,904	1.6	5,901	13.8	91,900	49.0%	Link

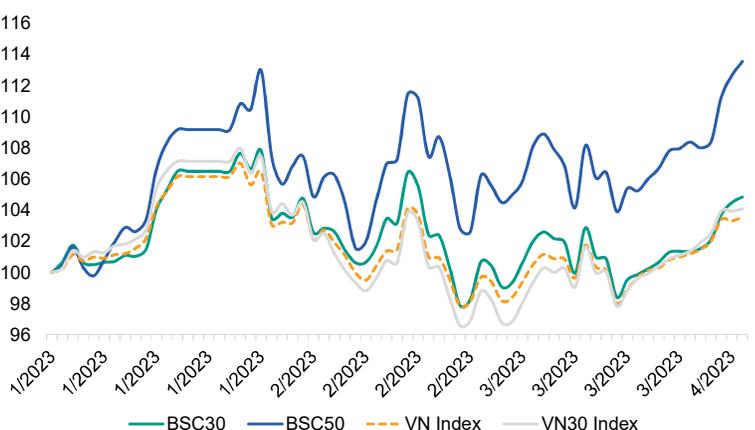
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討すべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	-0.7%	-0.3%	-0.4%	-0.6%
1 tuần	0.5%	2.6%	0.1%	-0.1%
1 tháng	2.2%	6.6%	2.0%	1.5%
3 tháng	2.5%	10.9%	2.1%	3.0%



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インデックス続落。

VNX指数マイナス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対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	対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	対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	対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	対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!

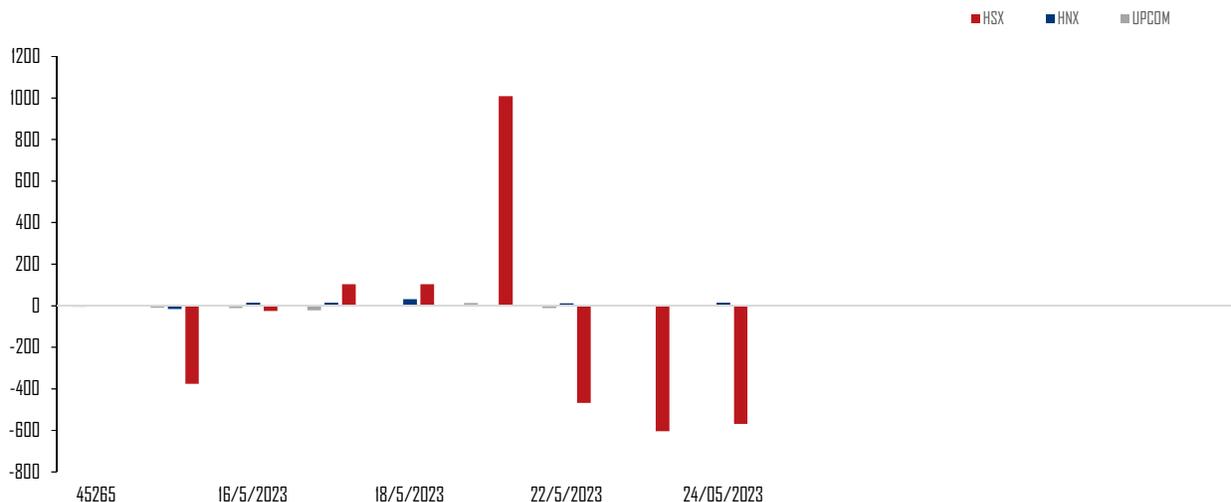
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対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	対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