

2023 05 30

Vietnam Daily Review

VNインデックス小幅続伸。

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+3.07ポイント高の1078.05で引けた。HNXインデックスは+1.02ポイント高の221.33で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVCB (+1.66%)、MSN (+0.43%)、MWG (+0.26%)、FPT (+0.25%)、DGC (+0.22%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVHM (-0.65%)、GAS (-0.43%)、VNM (-0.31%)、VIC (-0.29%)、PGV (-0.2%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比+16.8%増の13兆6,000億ドンに達した。総売買代金が16兆4,240億ドンに達した。変動幅は8.3ポイントだった。上昇には225銘柄、変わらずには60銘柄、下落には156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、5,039億5,000万ドン、117億3,000万ドンだった。最も売られたのはEIB (7,006億3,000万ドン)、VNM (515億2,000万ドン)、NVL (450億5,000万ドン)だった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いた後、上げ幅を拡大したが、前場の終盤にマイナス圏に転落した。後場に入ると、値を下げ、中盤に1070ポイントに下落する局面があったが、このサポート線を成功的にテストした。終盤に押し目狙いの買いが入ったことで、プラス圏に浮上し、VNインデックスは+3.07ポイント高の1078.05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業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は小売り業界だった。外国人投資家はHSX市場及びHNX市場で売り越した。VNインデックスは次の数日に1075~1085ポイントの範囲で推移する可能性がある。先物取引契約：VN30F2312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30日には、カバードワラント市場は指定銘柄と共にみ合った。

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 1078.05

売買代金: 13599.85 億ドン **3.07 (0.29%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 221.33

売買代金: 0 億ドン **1.02 (0.46%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 81.67

#VALUE!
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン **0.54 (0.67%)**

データ

	価値	増減率
石油価格	72.1	-0.8%
金価格	1,945	0.1%
対USD為替レート	23,486	0.0%
対EUR為替レート	25,124	-0.1%
対円為替レート	16,748	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	4.55%	0.1%
国債金利 (5年間物)	2.75%	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
FPT	295.01	EIB	-700.63
VIC	99.73	VNM	-51.52
FRT	22.60	NVL	-45.05
DGC	20.62	FUEVFN	-37.15
DGW	18.40	NKG	-22.50

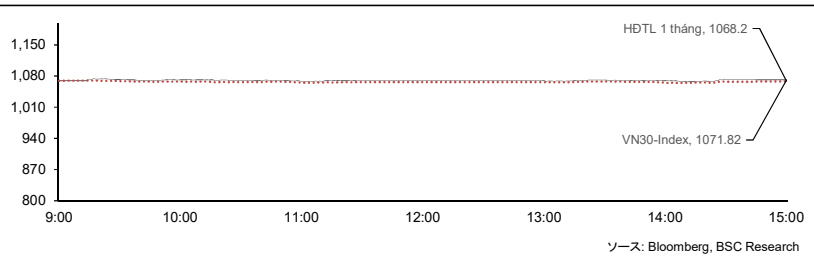
ソース：BSCリサーチ

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	1061.00	0.00%	-10.82	-31.4%	35	12/21/2023	207
VN30F2307	1064.40	0.04%	-7.42	-20.1%	211	7/20/2023	53
VN30F2306	1068.20	0.02%	-3.62	7.8%	139764	6/15/2023	18
VN30F2309	1063.00	0.09%	-8.82	53.2%	72	9/21/2023	116

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
FPT	84.00	1.08	0.87

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
CTG	28.1	1.68	0.04
0/1/1900	0.0	1.81	0.00
0/1/1900	0.0	1.50	0.00
0/1/1900	0.0	0.52	0.00
VHM	54.9	2.30	-0.68

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは+2.05ポイント高の1071.82で引けた。変動幅は7.48ポイントだった。FPT、MSN、MWG、VCBとVPBなどの主力株が堅調で、VN30インデックスを牽引した。
- ・VN30インデックスは高値で寄り付いた後、上げ幅を拡大したが、後場に入ると、売りに勢いが強まったことで、マイナス圏に転落した。しかし、終盤にプラス圏に浮上し、高値で引けた。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。
- ・VN30F2312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
CFPT2210	8/31/2023	93	10:1	335,100	24.24%	370	15.63%	1,300	221	29,260	90,000	84,000
CFPT2212	6/6/2023	7	10:1	527,100	24.24%	1,420	10.08%	1,850	1,405	88,200	70,000	84,000
CFPT2214	11/1/2023	155	10:1	13,200	24.24%	1,550	8.39%	1,870	1,112	81,200	76,000	84,000
CACB2301	8/7/2023	69	2:1	331,200	35.39%	230	4.55%	1,400	360	26,660	27,700	25,200
CTCB2214	6/6/2023	7	3:1	247,300	43.96%	1,040	4.00%	1,800	1,075	51,200	27,000	30,200
CFPT2213	9/5/2023	98	10:1	189,500	24.24%	1,340	3.08%	2,350	1,114	94,700	74,500	84,000
CMBB2213	6/6/2023	7	3:1	209,900	38.89%	580	1.75%	2,800	588	26,140	17,000	18,750
CVPB2214	9/5/2023	98	4:1	592,000	38.24%	950	1.06%	1,650	781	42,040	17,000	19,450
CHPG2225	6/6/2023	7	3:1	91,800	48.42%	1,500	0.67%	2,300	1,454	98,100	17,000	21,350
CHPG2227	11/1/2023	155	2:1	670,500	48.42%	1,970	0.51%	1,100	1,637	19,589	20,500	21,350
CHPG2306	11/9/2023	163	3:1	492,400	48.42%	1,120	0.00%	1,970	1,203	23,300	20,000	21,350
CMBB2214	9/5/2023	98	2:1	207,000	38.89%	1,550	-0.64%	2,700	1,301	26,140	17,000	18,750
CSTB2225	11/1/2023	155	2:1	79,000	49.45%	4,350	-0.68%	2,600	4,121	108,400	20,500	27,700
CACB2208	9/5/2023	98	4:1	534,400	35.39%	1,260	-0.79%	1,100	1,089	25,900	21,500	25,200
CTCB2216	11/1/2023	155	4:1	30,100	43.96%	1,540	-1.28%	1,200	1,283	80,159	27,500	30,200
CSTB2303	11/9/2023	163	2:1	163,900	49.45%	3,530	-2.49%	1,100	3,596	50,700	22,000	27,700
CVRE2216	8/31/2023	93	4:1	886,100	43.34%	270	-3.57%	1,700	335	31,020	31,000	27,700
CTPB2301	8/7/2023	69	2.7:1	69,100	35.16%	750	-3.85%	1,000	708	14,229	26,000	24,100
CVHM2216	8/31/2023	93	8:1	266,200	39.62%	220	-4.35%	1,000	265	16,453	62,000	54,900
CSTB2224	9/5/2023	98	2:1	23,400	49.45%	4,270	-4.90%	1,640	4,099	103,200	20,000	27,700

ノート: * 理論的な価格は式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30日には、カワードワラント市場は証券市場と共にみ合った。
- ・価格については、CHPG2227は+21.42%と最も上昇した。売買代金は前日比+4.46%増となった。CHPG2227の売買代金は最大となり、全市場の21.42%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCACB2301、CSTB2302、CVRE2216とCVHM2216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、CSTB2225、CSTB2303とCHPG2225の益回り率は最も高かった。

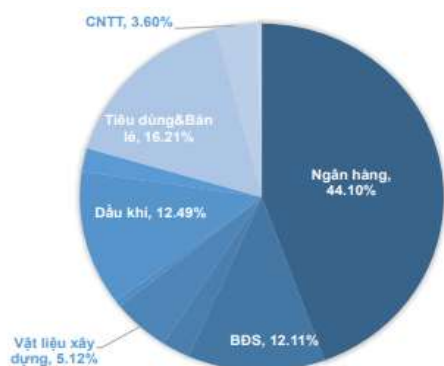
BSC30 Portfolio

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	94.5	1.5%	0.9	19,444	2.3	7,311	12.9	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	43.8	-0.2%	1.0	9,633	1.5	4,208	10.4	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.5	0.5%	1.2	5,677	7.6	3,972	4.9	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	30.2	0.0%	1.4	4,618	2.8	14,982	2.0	-	17.6%	Link
ACB	銀行	18.8	小幅続伸。	1.4	3,696	5.4	14,982	1.3	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	27.7	0.0%	1.3	2,270	10.9	4,640	6.0	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	18.4	1.1%	1.1	3,200	3.6	4,603	4.0	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	27.9	-1.1%	1.7	929	10.7	4,880	5.7	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	41.8	-0.2%	1.7	600	5.9	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	40.9	1.7%	1.7	797	3.1	1,217	33.6	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	21.4	-0.5%	1.0	5,398	12.5	1,916	11.1	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	54.9	-1.1%	0.9	10,394	3.3	1,896	29.0	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	27.7	0.0%	1.2	2,737	3.8	5,227	5.3	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	30.1	0.5%	0.4	938	3.4	1,576	19.1	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	32.3	0.6%	1.5	539	2.9	2,557	12.6	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	53.8	4.5%	1.5	888	17.3	14,120	3.8	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	32.0	2.1%	1.3	544	3.6	6,793	4.7	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	24.4	2.5%	0.8	560	4.9	2,625	9.3	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	92.9	-1.0%	0.7	7,731	2.4	2,292	40.5	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	37.9	0.0%	1.1	2,094	0.8	1,340	28.3	45,000	20.4%	Link
POW	イリティ	30.6	2.3%	1.2	636	11.0	993	30.8	33,000	6.3%	Link
REE	イリティ	24.1	1.5%	1.5	581	5.6	7,698	3.1	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	13.7	0.4%	1.2	1,390	3.4	3,895	3.5	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	66.5	-0.9%	1.2	6,043	5.1	2,605	25.5	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	72.8	1.7%	1.1	4,506	3.0	3,456	21.1	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	39.4	1.8%	1.3	2,507	8.2	7,475	5.3	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	71.1	-0.4%	0.8	1,014	1.5	2,965	24.0	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	58.4	0.5%	1.2	466	1.3	12,800	4.6	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	50.1	0.6%	0.7	656	2.0	7,059	7.1	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	84.0	1.1%	0.8	4,033	6.0	5,901	14.2	91,900	49.0%	Link

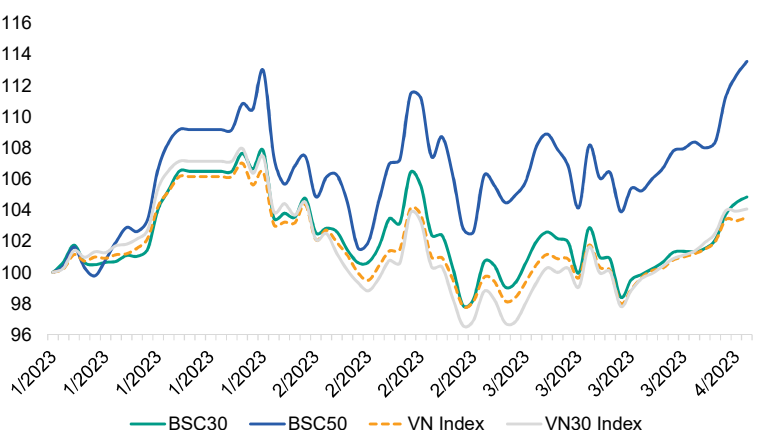
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討するべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	0.7%	1.1%	0.3%	0.2%
1 tuần	2.0%	2.9%	1.1%	0.4%
1 tháng	3.8%	7.5%	2.8%	1.9%
3 tháng	5.3%	15.2%	3.9%	4.2%



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インデックス小幅続伸。

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!

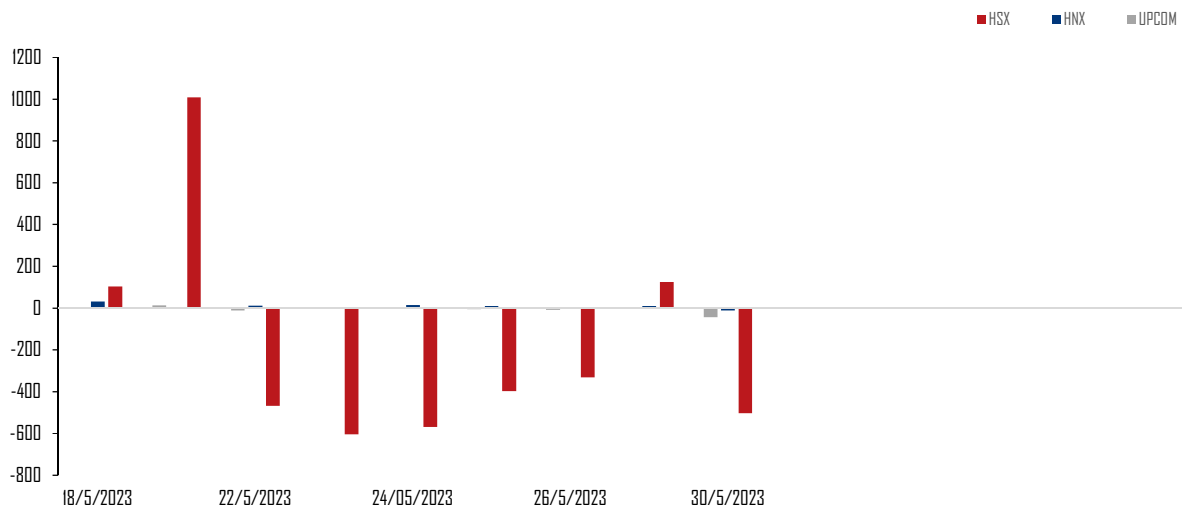
HNXの上昇率上位5銘柄

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