

2023 06 05

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+6.98ポイント高の1097.82で引けた。HNXインデックスは+0.53ポイント高の226.56で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVCB (+3.67%)、GAS (+0.96%)、MSN (+0.64%)、FPT (+0.33%)、VHM (+0.33%)だった。
- ・主に下落した銘柄はGVR (-0.55%)、TCB (-0.26%)、EIB (-0.2%)、NVL (-0.17%)、VPB (-0.17%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比-3.35%減の16兆3,160億ドンに達した。総売買代金が17兆5,610億ドンに達した。変動幅は12.97ポイントだった。上昇には201銘柄、変わらずには39銘柄、下落には199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1,135億3,000万ドンだった。最も売られたのはVNM (972億8,000万ドン)、HCM (323億3,000万ドン)、CTG (321億4,000万ドン)だった。一方、HNX市場での買越額は153億7,000万ドンだった。

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、後場に入ると、利益確定売りが入ったことで、値を消し、上げ幅を縮小し、+6.98ポイント高の1097.82で引けた。市場の広さがバランスを取る状態で維持し、19業界うちの12業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は電気・ガス・熱供給・水道業界だった。また、OPEC+が原油生産量削減を同意した情報を受けた後、石油業界は大幅に上昇した。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インデックスは大きく回復した後、次の数日に反落する可能性がある。

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6月5日には、カバードワラント市場は指定銘柄と共に上昇した。

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 1097.82

売買代金: 16315.67 億ドン **6.98 (0.64%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 226.56

売買代金: 0 億ドン **0.53 (0.23%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 84.11

#VALUE!
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン **0.15 (0.18%)**

データ

	価値	増減率
石油価格	73.6	2.5%
金価格	1,942	-0.3%
対USD為替レート	23,499	0.0%
対EUR為替レート	25,133	-0.1%
対円為替レート	16,756	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	4.43%	0.1%
国債金利 (5年間物)	2.56%	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
VHM	49.78	VNM	-97.28
SSI	35.19	HCM	-32.33
KBC	25.02	CTG	-32.14
VCB	19.40	MSN	-28.21
CTD	15.85	NLG	-19.11

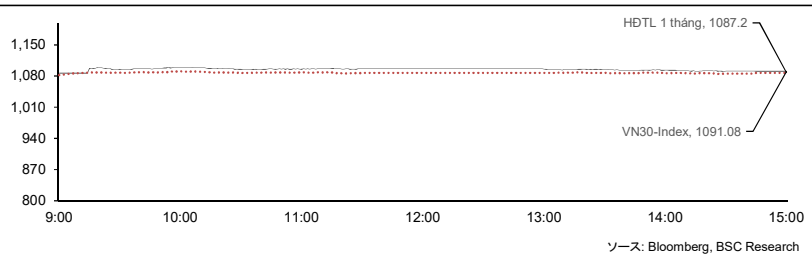
ソース：BSCリサーチ

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	1072.30	0.22%	-18.78	-48.5%	105	12/21/2023	201
VN30F2307	1083.80	0.54%	-7.28	-24.7%	432	7/20/2023	47
VN30F2306	1087.20	0.78%	-3.88	-28.9%	150708	6/15/2023	12
VN30F2309	1075.60	0.42%	-15.48	-43.6%	93	9/21/2023	110

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
VCB	98.00	3.27	1.67

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
HPG	21.7	2.49	0.17
0/1/1900	0.0	1.43	0.00
0/1/1900	0.0	0.91	0.00
0/1/1900	0.0	0.98	0.00
TCB	31.9	0.56	-0.71

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは+4.12ポイント高の1091.08で引けた。変動幅は9.85ポイントだった。VCB、MSN、FPT、VNMとMWG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。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上昇した。売買高を見ると、全ての先物取引契約が減少した。先物取引契約数を見ると、VN30F2306の以外、他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
CFPT2213	9/5/2023	92	10:1	263,400	24.25%	1,430	4.38%	2,350	1,085	94,700	74,500	85,000
CHPG2227	11/1/2023	149	2:1	760,200	48.31%	2,100	3.96%	1,100	1,686	19,589	20,500	21,650
CMBB2214	9/5/2023	92	2:1	601,700	39.33%	1,930	2.66%	2,700	1,656	26,140	17,000	19,800
CMWG2215	11/1/2023	149	10:1	3,013,900	44.05%	530	1.92%	1,170	327	19,740	45,000	41,200
CMBB2301	6/27/2023	22	4:1	769,600	39.33%	960	1.05%	1,380	863	23,510	16,300	19,800
CMBB2215	11/1/2023	149	2:1	271,900	39.33%	1,920	0.52%	1,700	1,532	25,600	18,000	19,800
CVIB2201	9/5/2023	92	1.87:1	89,000	36.15%	2,820	0.00%	2,700	2,334	26,380	20,500	23,200
CFPT2214	11/1/2023	149	10:1	128,100	24.25%	1,550	0.00%	1,870	1,085	81,200	76,000	85,000
CVPB2214	9/5/2023	92	4:1	675,700	38.25%	1,010	-0.98%	1,650	852	42,040	17,000	19,750
CVPB2214	9/5/2023	92	4:1	675,700	38.25%	1,010	-0.98%	1,650	852	42,040	17,000	19,750
CTCB2216	11/1/2023	149	4:1	189,200	44.62%	1,900	-1.04%	1,200	1,647	80,159	27,500	31,900
CVPB2301	9/27/2023	114	4:1	356,500	38.25%	800	-1.23%	2,100	463	44,520	19,800	19,750
CVPB2301	9/27/2023	114	4:1	356,500	38.25%	800	-1.23%	2,100	463	44,520	19,800	19,750
CHPG2306	11/9/2023	157	3:1	1,191,900	48.31%	1,140	-1.72%	1,970	1,238	23,300	20,000	21,650
CACB2208	9/5/2023	92	4:1	316,700	35.42%	1,370	-2.14%	1,100	450	25,900	21,500	21,750
CSTB2225	11/1/2023	149	2:1	663,300	49.29%	4,480	-2.61%	2,600	4,360	108,400	20,500	28,050
CSTB2303	11/9/2023	157	2:1	214,600	49.29%	3,910	-3.22%	1,100	3,814	50,700	22,000	28,050
CTCB2215	9/5/2023	92	4:1	154,400	44.62%	1,780	-3.26%	1,350	1,654	53,060	26,500	31,900
CSTB2224	9/5/2023	92	2:1	60,800	49.29%	4,380	-4.58%	1,640	4,358	103,200	20,000	28,050
CVPB2212	8/31/2023	87	2.66:1	169,200	38.25%	190	-5.00%	4,500	106	27,620	24,644	19,750

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6月5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、CSTB2225は+17.26%と最も上昇した。売買代金は前日比-3.49%減となった。CSTB2225の売買代金は最大となり、全市場の17.26%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCMBB2303、CVIB2301、CSTB2302とCMWG2302の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CSTB2301とCVIB2201の収益性は最も高かった。CSTB2224、CSTB2225、CSTB2303とCVIB2201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	98.0	3.3%	0.9	20,165	5.5	7,311	13.4	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	44.7	0.0%	1.0	9,831	1.9	4,208	10.6	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.8	-0.5%	1.2	5,765	11.6	3,972	5.0	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	31.9	-0.9%	1.4	4,878	8.2	14,982	2.1	-	17.6%	Link
ACB	銀行	19.8	ス3日続伸。	1.4	3,903	16.9	14,982	1.3	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	28.1	-0.9%	1.3	2,299	17.5	4,640	6.0	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	18.4	-2.9%	1.1	3,191	4.2	4,603	4.0	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	27.9	-2.6%	1.7	931	18.0	4,880	5.7	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	41.3	-1.7%	1.7	593	5.6	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	40.3	-2.9%	1.7	786	5.9	1,217	33.1	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	21.7	0.2%	1.0	5,473	19.0	1,916	11.3	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	53.7	0.6%	0.9	10,167	3.4	1,896	28.3	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	27.1	0.0%	1.1	2,677	3.9	5,227	5.2	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	29.9	1.5%	0.4	930	2.9	1,576	18.9	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	31.9	-1.8%	1.5	532	3.9	2,557	12.5	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	59.1	5.0%	1.5	976	21.4	14,120	4.2	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	33.1	2.6%	1.3	563	4.7	6,793	4.9	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	25.5	3.0%	0.8	586	6.6	2,625	9.7	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	94.0	2.2%	0.7	7,822	2.1	2,292	41.0	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	39.1	2.2%	1.1	2,160	2.5	1,340	29.2	45,000	20.4%	Link
POW	エネルギー	31.1	0.3%	1.2	646	6.7	993	31.3	33,000	6.3%	Link
REE	エネルギー	24.2	-0.4%	1.5	585	5.5	7,698	3.1	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	14.0	2.2%	1.1	1,420	10.1	3,895	3.6	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	66.5	0.9%	1.2	6,043	9.6	2,605	25.5	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	74.1	2.5%	1.1	4,587	6.5	3,456	21.4	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	41.2	1.0%	1.3	2,621	11.8	7,475	5.5	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	73.7	1.0%	0.7	1,051	1.8	2,965	24.9	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	60.8	4.3%	1.2	485	3.1	12,800	4.8	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	52.0	1.2%	0.7	681	2.5	7,059	7.4	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	85.0	1.4%	0.8	4,081	5.2	5,901	14.4	91,900	49.0%	Link

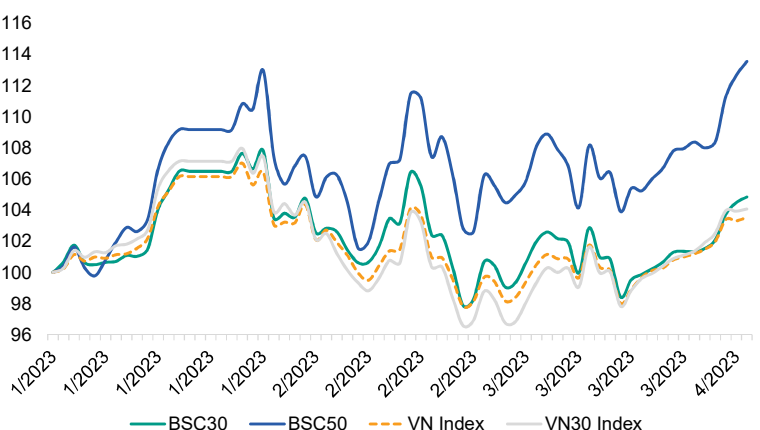
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討するべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	0.6%	0.1%	0.6%	0.4%
1 tuần	2.6%	3.0%	2.1%	2.0%
1 tháng	6.7%	9.2%	5.5%	4.9%
3 tháng	5.6%	14.6%	4.6%	4.9%



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	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!

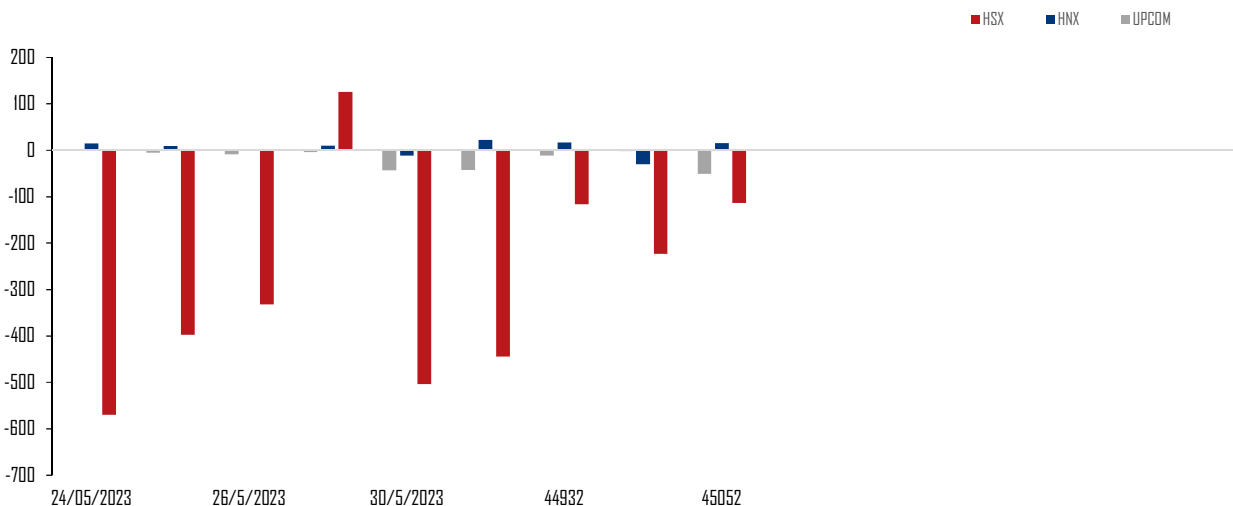
HNXの上昇率上位5銘柄

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