

2023 06 08

Vietnam Daily Review

VNインデックス 6日ぶり反落。

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-8.22ポイント安の1101.32で引けた。HNXインデックスは-3.55ポイント安の226.78で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVCB (+3.56%)、HPG (+0.29%)、DHG (+0.19%)、HVN (+0.14%)、VGC (+0.12%)だった。
- ・主に下落した銘柄はBID (-0.82%)、TCB (-0.75%)、VPB (-0.68%)、GVR (-0.55%)、GAS (-0.43%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比+27.22%増の21億110億ドンに達した。総売買代金が23兆6,890億ドンに達した。変動幅は13.82ポイントだった。上昇には139銘柄、変わらずには38銘柄、下落には269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3,126億、6,000万ドンだった。最も売られたのはVNM (2,112億1,000万ドン)、GEX (702億3,000万ドン)、HCM (484億5,000万ドン)だった。HNX市場での買越額は467億4,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いた後、プラス圏でもみ合ったが、終盤に値を下げた。後場に入ると、下げ幅を拡大し、-8.22ポイント高の1101.32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、証券業界、化学業界、小売り業界は約2%安で引けた。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インデックスはサポート線1090~1100ポイントに続伸する可能性がある。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6月8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 1101.32

売買代金: 21011.09 億ドン **-8.22 (-0.74%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 226.78

売買代金: 0 億ドン **-3.55 (-1.54%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 84.02

#VALUE! **-0.54 (-0.64%)**
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	72.5	-0.1%
金価格	1,949	0.5%
対USD為替レート	23,495	0.0%
対EUR為替レート	25,183	0.2%
対円為替レート	16,826	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	4.13%	-0.1%
国債金利 (5年間物)	2.52%	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	66.72	VNM	-211.21
VCB	57.67	GEX	-70.23
VIX	56.84	HCM	-48.45
HPG	51.76	LPB	-40.82
VND	24.34	POW	-39.63

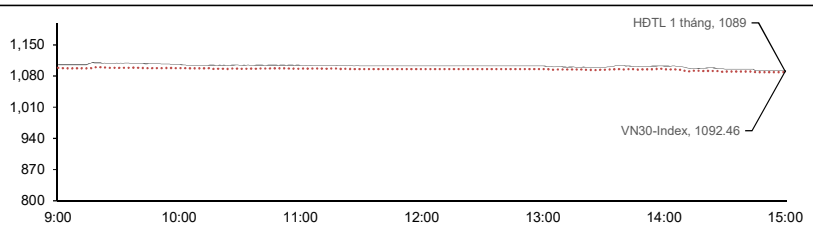
ソース：BSCリサーチ

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	1074.00	-0.51%	-18.46	6.6%	81	12/21/2023	196
VN30F2307	1085.30	-0.92%	-7.16	-24.4%	1148	7/20/2023	42
VN30F2306	1089.00	-0.82%	-3.46	-7.1%	146445	6/15/2023	7
VN30F2309	1078.00	-0.75%	-14.46	-61.9%	24	9/21/2023	105

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	100.00	3.09	1.61

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
PLX	38.3	0.88	-0.08
0/1/1900	0.0	0.62	0.00
0/1/1900	0.0	0.18	0.00
0/1/1900	0.0	2.19	0.00
TCB	31.8	0.36	-2.01

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは13.22ポイント高の1092.46で引けた。変動幅は18.41ポイントだった。TCB、VPB、STB、FPTとMWG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、+1%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
CHPG2226	9/5/2023	89	2:1	308,300	48.53%	2,320	4.04%	1,510	2,030	96,000	19,500	22,800
CHPG2227	11/1/2023	146	2:1	1,107,800	48.53%	2,380	3.48%	1,100	2,016	19,589	20,500	22,800
CHPG2306	11/9/2023	154	3:1	1,831,400	48.53%	1,310	0.77%	1,970	1,468	23,300	20,000	22,800
CACB2208	9/5/2023	89	4:1	170,500	35.39%	1,390	-2.11%	1,100	450	25,900	21,500	21,600
CVPB2214	9/5/2023	89	4:1	720,700	38.25%	980	-2.97%	1,650	858	42,040	17,000	19,500
CVPB2214	9/5/2023	89	4:1	720,700	38.25%	980	-2.97%	1,650	858	42,040	17,000	19,500
CVPB2301	9/27/2023	111	4:1	35,100	38.25%	760	-3.80%	2,100	464	44,520	19,800	19,500
CVPB2212	8/31/2023	84	2.66:1	337,400	38.25%	190	-5.00%	4,500	103	27,620	24,644	19,500
CSTB2225	11/1/2023	146	2:1	3,087,700	49.32%	4,360	-5.01%	2,600	4,371	108,400	20,500	27,600
CFPT2213	9/5/2023	89	10:1	156,000	24.29%	1,310	-5.07%	2,350	1,186	94,700	74,500	83,600
CTCB2216	11/1/2023	146	4:1	102,900	44.70%	1,880	-5.53%	1,200	1,718	80,159	27,500	31,750
CSTB2224	9/5/2023	89	2:1	1,020,500	49.32%	4,270	-5.74%	1,640	4,371	103,200	20,000	27,600
CMBB2301	6/27/2023	19	4:1	178,300	39.50%	1,000	-6.54%	1,380	1,022	23,510	16,300	20,000
CMBB2214	9/5/2023	89	2:1	904,400	39.50%	1,990	-7.01%	2,700	1,921	26,140	17,000	20,000
CSTB2303	11/9/2023	154	2:1	889,900	49.32%	3,600	-7.93%	1,100	3,822	50,700	22,000	27,600
CVIB2201	9/5/2023	89	1.87:1	153,800	36.19%	2,720	-9.33%	2,700	2,588	26,380	20,500	22,850
CTCB2215	9/5/2023	89	4:1	158,100	44.70%	1,710	-10.00%	1,350	1,732	53,060	26,500	31,750
CMWG2302	11/9/2023	154	6:1	2,906,300	44.11%	260	-10.34%	1,100	390	22,200	50,000	40,650
CVNM2212	9/5/2023	89	7.85:1	1,317,700	21.88%	170	-10.53%	1,700	17	30,340	80,560	65,500
CTPB2301	8/7/2023	60	2.7:1	143,200	35.86%	1,300	-10.96%	1,000	1,258	14,229	26,000	25,600

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6月8日には、カバ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、CSTB2225は+37.57%と最も上昇した。売買代金は前日比+37.51%増となった。CSTB2225の売買代金は最大となり、全市場の37.57%を占めた。
- ・カバードワラント銘柄はCVIB2301、CSTB2302、CMBB2303とCMWG2302の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CTPB2301とCHPG2302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	100.0	3.1%	0.9	20,576	5.8	7,311	13.7	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	43.7	-1.5%	1.0	9,611	3.2	4,208	10.4	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	19.5	-2.0%	1.2	5,692	14.2	3,972	4.9	23,685	28.1%	Link
VPB	銀行	31.8	-2.6%	1.4	4,855	8.1	14,982	2.1	-	17.6%	Link
ACB	銀行	20.0	3.1% 3ぶり反落。	1.4	3,943	12.0	14,982	1.3	24,400	17.6%	Link
MBB	銀行	27.6	-2.6%	1.3	2,262	24.7	4,640	5.9	31,200	30.0%	Link
STB	銀行	18.0	-3.0%	1.1	3,130	5.4	4,603	3.9	19,100	23.2%	Link
SSI	証券	27.5	-2.8%	1.7	918	21.4	4,880	5.6	29,800	29.2%	Link
GVR	工業団地区不動産	42.1	0.2%	1.7	604	11.6	-	0.0	52,400	42.8%	Link
HPG	建設用材料	42.9	2.6%	1.7	836	10.2	1,217	35.3	-	0.5%	Link
HSG	建設用材料	22.8	0.9%	1.0	5,764	42.4	1,916	11.9	25,000	23.4%	Link
VHM	有働さん	55.4	0.2%	0.9	10,488	5.6	1,896	29.2	68,300	10.6%	Link
VRE	不動産	26.9	-1.3%	1.1	2,658	5.2	5,227	5.1	36,200	23.9%	Link
NLG	不動産	30.4	-0.2%	0.4	947	4.8	1,576	19.3	37,700	32.5%	Link
DPM	肥料	32.4	-3.3%	1.5	541	5.1	2,557	12.7	38,100	44.9%	Link
GAS	石油・ガス	59.0	-2.3%	1.5	974	12.6	14,120	4.2	60,500	18.4%	Link
PLX	石油・ガス	32.9	-0.9%	1.3	560	5.2	6,793	4.8	42,000	3.0%	Link
BSR	石油・ガス	24.9	-2.5%	0.8	573	5.0	2,625	9.5	29,000	18.1%	Link
PVS	石油・ガス	93.6	-1.0%	0.7	7,789	2.6	2,292	40.8	122,300	41.1%	Link
PVT	石油・ガス	38.3	-1.5%	1.1	2,116	0.9	1,340	28.6	45,000	20.4%	Link
POW	エネルギー	30.6	-1.3%	1.2	636	15.5	993	30.8	33,000	6.3%	Link
REE	エネルギー	23.7	-3.3%	1.5	572	6.6	7,698	3.1	26,000	49.0%	Link
VNM	消費財	13.8	0.4%	1.1	1,405	9.2	3,895	3.5	14,500	55.8%	Link
MSN	省資材	65.5	-1.1%	1.2	5,952	14.4	2,605	25.1	84,500	30.6%	Link
MWG	小売	74.4	-1.5%	1.1	4,605	4.1	3,456	21.5	96,000	49.0%	Link
PNJ	小売	40.7	-2.8%	1.3	2,586	8.1	7,475	5.4	55,200	49.0%	Link
FRT	小売	72.2	-0.6%	0.7	1,030	1.6	2,965	24.4	95,000	29.0%	Link
VHC	水産	61.0	0.5%	1.2	486	3.1	12,800	4.8	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	50.0	-2.0%	0.7	655	2.3	7,059	7.1	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	83.6	-1.6%	0.8	4,014	4.5	5,901	14.2	91,900	49.0%	Link

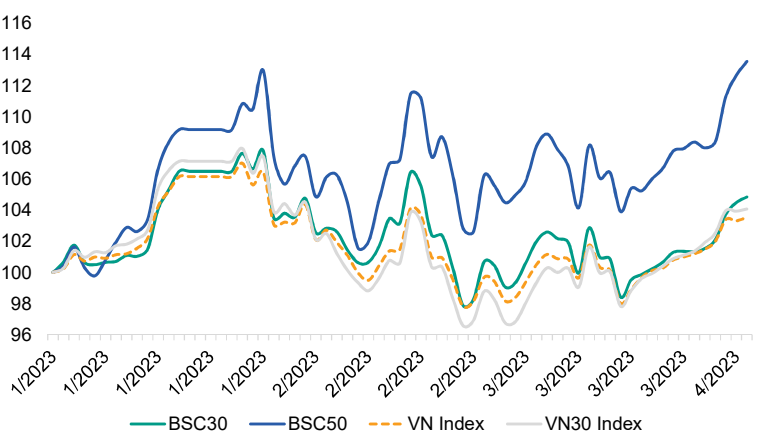
BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討するべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	-1.2%	-2.3%	-0.7%	-1.2%
1 tuần	1.8%	0.5%	2.1%	2.3%
1 tháng	4.7%	8.1%	4.5%	4.1%
3 tháng	5.5%	15.6%	4.6%	4.0%



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6日ぶり反落。

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!

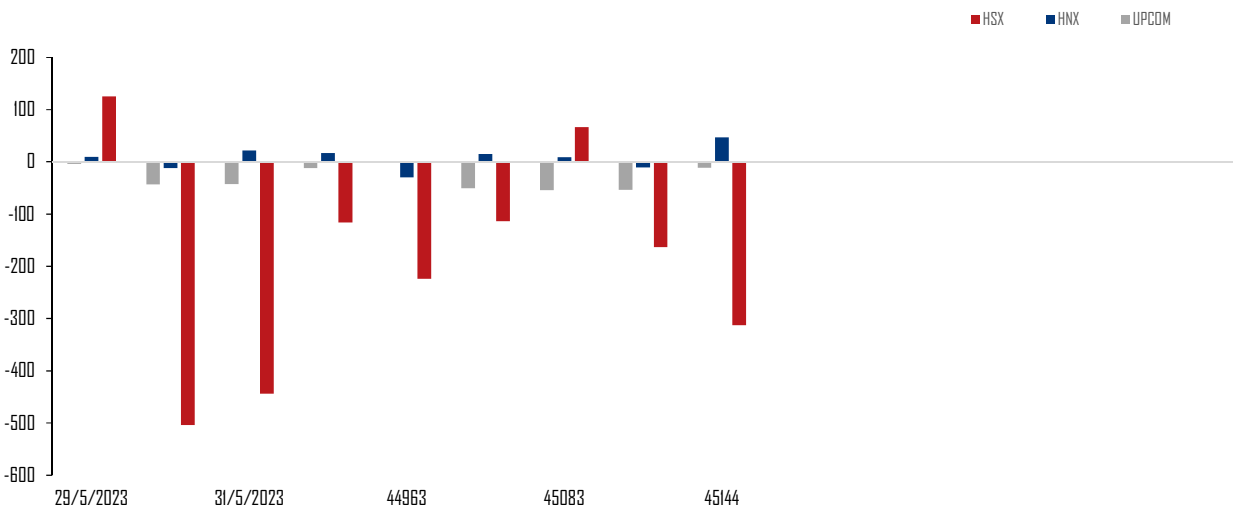
HNXの上昇率上位5銘柄

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