

2022 09 13

Vietnam Daily Review

VNインデックス小幅反落。

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1.22ポイント安の1248.4で引けた。HNXインデックスは1.49ポイント安の281.59で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はCTG (+0.55%)、GAS (+0.24%)、BCM (+0.24%)、VNM (+0.21%)、PVD (+0.15%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVHM (-0.77%)、SAB (-0.65%)、VCB (-0.6%)、MSN (-0.36%)、PDR (-0.31%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比1%増の10兆1,520億ドンに達した。総売買代金が12兆7,490億ドンに達した。変動幅は8.48ポイントだった。上昇には184銘柄、変わらずに87銘柄、下落には262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2,652億8,000万ドンだった。最も売られたのはSSI (1,055億1,000万ドン)、FUEVFN (587億1,000万ドン)、VCI (488億8,000万ドン)だった。一方、HNXでの買越額は484億2,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは小幅な変動幅でもみあった後、1.22ポイント安で引けた。市場の広さがネガティブな状態に転換し、19業界うちの7業界が小幅に上昇した。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1250~1260ポイントの範囲でもみ合う傾向にある。売買代金が低い水準で維持した。市場が明確な傾向を見せていない。投資家は次の数日に慎重に取引するべきだ。

先物取引契約：VN30F2303の以外、先物取引契約は証券市場と共に下落した。投資家は次の日に先物取引契約を慎重に取引するべきだ。

カバードワラント：2022年9月13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。

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 1248.40

売買代金: 10151.75 億ドン **-1.22 (-0.1%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 0.00

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

UPCOM-INDEX 0.00

#VALUE!
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	88.8	1.2%
金価格	1,726	0.1%
対USD為替レート	23,541	0.1%
対EUR為替レート	23,892	0.3%
対円為替レート	16,538	0.2%
銀行間金利 (1か月物)	-	0.0%
国債金利 (5年間物)	0	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
DGC	76.28	SSI	#####
PVD	72.29	FUEVFN	#####
HPG	34.19	VCI	#####
CTG	30.97	DXG	#####
DBC	26.38	VND	#####

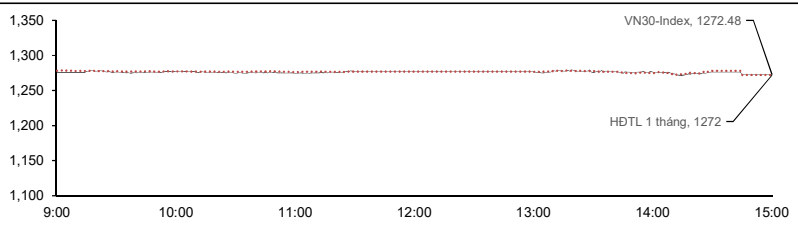
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2209	1272.00	-0.38%	-0.48	-4.5%	146366	9/15/2022	4
VN30F2210	1267.00	-0.08%	-5.48	24.4%	4621	10/20/2022	39
VN30F2212	1262.50	-0.14%	-9.98	85.7%	13	12/15/2022	95
VN30F2203	1259.80	0.02%	-12.68	-62.5%	15	3/16/2023	186

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
HDB	25.90	0.97	0.36
VNM	75.70	0.53	0.35
CTG	27.50	1.66	0.34
VPB	30.50	0.16	0.16
ACB	23.80	0.21	0.15

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
VHM	60.7	0.14	-0.95
MSN	114.0	0.16	-0.66
PDR	51.8	0.44	-0.50
TCB	37.3	0.35	-0.47
VRE	28.4	0.20	-0.38

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは3.12ポイント安の1272.48で引けた。変動幅は8.33ポイントだった。VHM、MSN、PDR、TCBとVRE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インデックスが殆どの取引時間でもみあった後、後場に低値に下落する局面があった。売買代金が20日間の平均水準の下にある。投資家は次の日に先物取引契約を慎重に取引するべきだ。
- ・VN30F2303の以外、他の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、VN30F2210とVN30F2212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、VN30F2210とVN30F2212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
CVPB2204	11/15/2022	63	4:1	1,000	37.35%	370	5.7%	1,000	426	31,448	30,888	30,500
CACB2204	11/7/2022	55	1.6:1	70,600	27.72%	750	4.2%	2,500	298	27,189	32,500	23,800
CMBB2206	10/3/2022	20	16.5:1	10,300	34.57%	530	1.9%	1,000	275	29,243	22,222	22,550
CVRE2212	1/13/2023	122	8:1	17,900	38.96%	860	1.2%	1,000	218	30,080	30,000	28,350
CVRE2204	10/7/2022	24	5:1	1,900	38.96%	110	0.0%	1,000	11	33,600	33,000	28,350
CVPB2205	9/19/2022	6	2:1	53,400	37.35%	20	0.0%	2,100	0	37,520	37,500	30,500
CMWG2206	1/9/2023	118	16:1	5,000	35.65%	1,320	0.0%	2,590	80	103,580	88,060	74,100
CHPG2210	10/20/2022	37	6.05:1	2,200	37.14%	30	0.0%	1,100	0	37,714	47,777	23,700
CVRE2209	12/27/2022	105	4:1	275,600	38.96%	390	0.0%	1,000	313	38,008	30,888	28,350
CVRE2211	3/28/2023	196	8:1	254,600	38.96%	680	-1.4%	1,000	364	31,928	28,888	28,350
CVRE2210	12/7/2022	85	8:1	755,800	38.96%	940	-2.1%	2,300	216	29,600	28,800	28,350
CMWG2208	12/26/2022	104	16:1	142,700	35.65%	2,310	-2.1%	3,000	651	66,200	63,000	74,100
CHPG2214	1/3/2023	112	7.56:1	233,400	37.14%	280	-3.4%	1,000	55	31,541	28,744	23,700
CKDH2207	11/7/2022	55	4.54:1	151,000	31.50%	180	-5.3%	1,700	9	45,840	50,000	35,800
CSTB2212	10/31/2022	48	4:1	299,100	45.12%	590	-6.3%	3,000	250	27,240	26,000	23,050
CHPG2213	10/31/2022	48	2.26:1	100,000	37.14%	710	-6.6%	4,000	122	26,905	35,000	23,700
CPDR2204	1/3/2023	112	24.8:1	176,400	31.14%	350	-10.3%	1,000	95	60,459	57,979	51,800
CPNJ2205	1/13/2023	122	2:1	45,200	39.40%	620	-15.1%	1,100	2,330	131,520	129,000	113,000
CSTB2208	10/20/2022	37	2:1	200	45.12%	40	-50.0%	1,100	68	30,631	30,111	23,050
CSTB2206	9/26/2022	13	8:1	107,900	45.12%	10	-50.0%	2,390	0	39,500	37,500	23,050

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:

- ・2022年9月13日には、カバードワラント市場は証券市場と共に明暗で分かれた。
- ・価格については、CVJC2203とCHPG2202はそれぞれ、+100%、+100%と最も上昇した。売買代金は前日比 - 10%と減少した。CFPT2206の売買代金は最大となり、全市場9.26%を占めた。
- ・カバードワラント銘柄はCFPT2207、CTPB2204、CSTB2214とCTPB2203の時価が理論価格と相当している。CFPT2206、CPDR2204、CHPG2214とCVPB2204の収益性は最も高かった。CFPT2207、CPNJ2202、CPNJ2201とCMSN2208の益回り率は最も高かった。

銘柄	セクタ	終値 (千VND)	% 日	Beta	時価総額 (百万 USD)	終値 (百万 USD)	1株当たり利益	P/E	P/B	外国人が所有する	ROE		
MWG	小売	62.7	1.5%	0.6	3,990	11.8	3,360	18.7	4.1	49.0%	24.2%		
PNJ	小売	116.0	0.0%	0.6	1,222	2.4	5,308	21.9	3.4	49.0%	19.9%		
BVH	保険	58.4	0.0%	1.2	1,885	4.8	2,380	24.5	2.0	26.6%	8.3%		
PVI	保険	45.1	-1.3%	0.7	459	0.1	3,287	13.7	1.3	58.5%	9.9%		
VIC	不動産	66.4	0.6%	0.5	11,011	3.3	(138)	N/A	N/A	2.4	12.2%	-0.4%	
VRE	不動産	29.0	-0.2%	1.1	2,865	1.5	571	50.8	2.1	32.0%	4.2%		
NVL	不動産	63.0	1.8%	0.8	11,927	14.2	6,442	9.8	2.3	23.2%	25.8%		
DXG	不動産	26.7	-1.1%	1.4	705	10.5	1,223	21.8	1.7	29.8%	8.2%		
SSI	証券	23.6	0.0%	1.7	1,526	21.4	2,692	8.7	1.6	23.8%	22.0%		
VCI	証券	43.6	-0.9%	1.0	635	9.6	4,546	9.6	2.0	18.4%	24.3%		
HCM	証券	27.5	2.4%	1.6	546	11.7	2,522	10.9	1.6	42.3%	17.5%		
FPT	技術	86.1	反落	1.0	4,107	11.4	4,517	19.1	4.8	49.0%	27.1%		
FOX	技術	72.0	0.0%	0.4	1,028	0.0	4,926	14.6	3.9	0.0%	30.2%		
GAS	オイルとガス	109.0	-2.7%	1.0	9,070	3.7	6,709	16.2	3.5	3.0%	24.3%		
PLX	オイルとガス	42.1	2.9%	1.5	2,326	2.7	514	81.9	2.3	17.6%	3.1%		
PVS	オイルとガス	23.6	-2.9%	1.6	490	7.7	1,115	21.2	0.9	8.8%	4.4%		
BSR	オイルとガス	24.3	-1.6%	0.8	3,276	10.6	2,108	11.5	2.0	41.1%	19.1%		
DHG	薬局	91.4	-0.5%	0.3	520	0.1	6,361	14.4	3.2	54.2%	23.1%		
DPM	肥料	47.5	-1.8%	1.3	808	4.7	12,920	3.7	1.5	15.8%	50.2%		
DCM	肥料	32.4	0.0%	1.2	746	4.8	7,062	4.6	1.7	8.9%	44.8%		
VCB	バンク	82.5	3.8%	0.8	16,975	8.0	#N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	23.5%	#VALUE!
BID	バンク	39.3	0.0%	1.2	8,643	4.1	2,574	15.3	2.2	16.9%	15.1%		
CTG	バンク	28.9	-0.9%	1.5	6,028	6.6	3,056	9.4	1.4	26.7%	15.1%		
VPB	バンク	29.4	1.4%	1.2	5,682	23.3	3,755	7.8	1.4	17.6%	22.2%		
MBB	バンク	27.0	0.2%	1.3	4,427	13.1	4,160	6.5	1.5	23.2%	26.0%		
ACB	バンク	25.0	0.2%	1.1	3,671	4.8	3,482	7.2	1.6	30.0%	25.4%		
BMP	プラスチック	62.9	0.0%	0.7	224	0.2	4,413	14.3	2.1	85.4%	15.2%		
NTP	プラスチック	40.7	-1.7%	0.6	229	0.1	3,914	10.4	1.8	17.8%	18.0%		
MSR	天然資源	20.6	-1.9%	1.6	984	0.2	178	115.7	1.6	10.1%	1.4%		
HPG	鋼	23.7	-0.4%	1.1	5,979	31.0	4,747	5.0	1.4	20.3%	31.8%		
HSG	鋼	19.9	1.8%	1.5	431	10.9	4,213	4.7	0.8	6.7%	19.3%		
VNM	消費者の主食	73.3	-0.1%	0.6	6,661	5.5	4,055	18.1	4.5	54.7%	25.8%		
SAB	消費者の主食	185.0	-2.6%	0.8	5,158	2.4	7,018	26.4	5.2	62.8%	21.0%		
MSN	消費者の主食	107.9	-1.9%	1.0	6,679	7.5	7,172	15.0	5.3	28.9%	40.2%		
SBT	消費者の主食	18.9	-0.8%	1.6	516	1.8	1,381	13.6	1.4	8.2%	8.3%		
ACV	輸送	85.8	-2.4%	0.8	8,121	0.2	363	236.5	5.0	3.8%	1.3%		
VJC	輸送	129.2	1.7%	1.1	3,042	4.1	695	185.9	4.0	16.8%	2.2%		
HVN	輸送	17.1	0.3%	1.7	1,646	1.1	(4,381)	N/A	N/A	N/A	N/A	5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	51.6	-2.3%	0.9	676	3.8	2,702	19.1	2.3	46.2%	12.5%		
PVT	輸送	20.5	-0.7%	1.4	288	2.1	2,000	10.2	1.2	13.6%	12.5%		
VCS	材料	77.4	0.8%	0.8	538	0.4	10,334	7.5	2.5	3.1%	36.9%		
VGC	材料	58.1	-4.9%	0.7	1,133	5.0	4,345	13.4	3.4	5.7%	27.6%		
HT1	材料	16.7	-0.6%	1.1	277	0.7	506	33.0	1.2	1.9%	3.6%		
CTD	建設	63.7	2.1%	1.2	205	3.2	(961)	N/A	N/A	0.6	52.4%	-0.8%	
CII	建設	20.8	-1.4%	1.5	228	6.9	1,253	16.6	1.0	10.6%	6.3%		
REE	電気	80.0	-1.5%	-1.4	1,236	3.3	6,593	12.1	2.0	49.1%	17.7%		
PC1	電気	38.7	-2.2%	-0.4	395	3.4	2,077	18.6	1.9	4.7%	10.5%		
POW	電気	13.6	-0.7%	0.6	1,385	5.8	674	20.2	1.1	2.3%	5.3%		
NT2	電気	26.3	-1.3%	0.6	329	1.3	3,116	8.4	1.7	14.2%	20.9%		

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
CTG	29.00	6.42	2.37	9.43M
VCB	59.60	2.41	1.83	3.45M
SAB	217.30	1.97	0.98	30.53k
BVH	89.80	3.22	0.69	268.66k
MBB	30.25	3.24	0.63	6.60M

VNインデックス小幅反落。

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
GAS	96.50	-6.94	-5.00	1.51M
VIC	123.00	-1.60	-1.92	4.73M
NVL	54.20	-6.87	-1.24	1.61M
VJC	173.00	-3.67	-1.08	598.90k
MSN	92.00	-1.50	-0.59	1.15M

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
HLG	9.67	6.97	0.01	920.00
IDI	14.05	6.84	0.06	4.40M
TCO	11.75	6.82	0.01	20.00
CLC	36.85	6.81	0.02	23.54k
CEE	20.50	6.77	0.02	359.43k

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
CMX	4.65	-7.00	0.00	38.99k
CMT	8.91	-6.99	0.00	20
AGR	3.99	-6.99	-0.02	367.62k
HII	17.65	-6.98	-0.01	46.95k
PLP	13.35	-6.97	-0.01	58.17k

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
ACB	43.50	3.57	1.26	3.70M
PVS	16.90	3.05	0.12	4.26M
SHB	11.00	0.92	0.11	15.24M
VGC	23.80	2.15	0.06	1.19M
SHS	19.00	2.15	0.04	1.37M

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
CEO	13.80	-8.61	-0.13	3.58M
VCG	16.90	-3.98	-0.08	1.46M
DBC	20.00	-2.91	-0.04	27.72k
NVB	9.40	-1.05	-0.03	81.30k
PTI	20.30	-6.02	-0.03	120

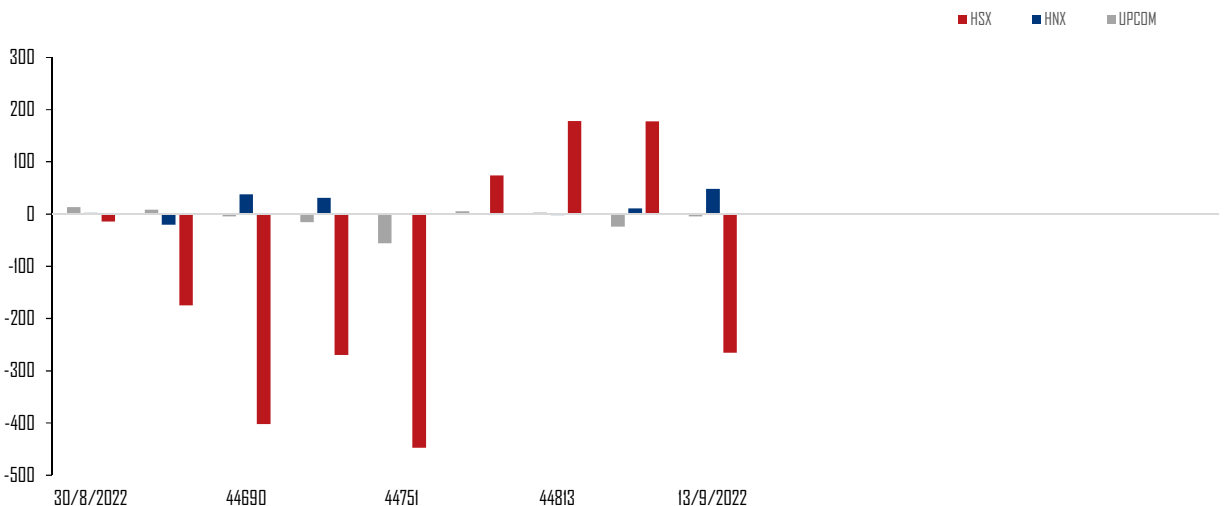
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
DPC	16.50	10.00	0.00	2.00k
TAG	34.60	9.84	0.02	23.80k
V12	11.20	9.80	0.00	100
TV3	32.50	9.80	0.01	100
ARM	33.70	9.77	0.00	100

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
PXA	0.80	-11.11	0.00	31.10k
ACM	0.80	-11.11	0.00	58.30k
VE4	9.00	-10.00	0.00	100
NHC	32.60	-9.94	-0.01	1.82k
MAS	58.40	-9.88	-0.02	52.27k

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