

2022 12 07

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-7.67ポイント安の1041.02で引けた。HNXインデックスは-2.87ポイント安の209.93で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はVIC (+4.4%)、VHM (+0.55%)、CTG (+0.42%)、MWG (+0.18%)、FPT (+0.14%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-1.78%)、GAS (-1.3%)、VPB (-1.19%)、MSN (-0.72%)、NVL (-0.69%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比41.27%減の12兆7,610億ドンに達した。総売買代金が14兆440億ドンに達した。変動幅は24.87ポイントだった。上昇には101銘柄、変わらずには46銘柄、下落には360銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場及びHNX市場での買越額はそれぞれ、1兆27億9,000万ドン、267億8,000万ドンだった。最も買われたのはVIC (2,976億6,000万ドン)、VHM (1,191億1,000万ドン)、STB (830億2,000万ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間でサポート線1040ポイントの周りでもみ合った後、7.67ポイント安の1041.02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16業界が下落した。不動産業界、小売り業界は昨日大幅に下落した後、本日反発し、高値で引けた。2つの業界が上昇したのは主にVIC、MWGなどの大型株から由来した。特に、VICはビンファスト(VinFast)が米国で新規株式公開(IPO)を実施する計画というポジティブな情報を受けた後、ストップ高となった。一方、同業界には、他の株式は大きく明暗で分かれた。HSX市場での買越額は1兆ドン兆だった。VNインデックスは次の数日に1030~1050ポイントの範囲でもみ合う可能性がある。先物取引契約：VN30F2303とVN30F2306の以外、他の先物取引契約は証券市場の下落に対して上昇した。投資家は日中に先物取引契約を取引するべきだ。カバードワラント：2022年12月7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 1041.02

売買代金: 12761.26 億ドン **-7.67 (-0.73%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 209.93

売買代金: 0 億ドン **-2.87 (-1.35%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 70.45

#VALUE! **-0.57 (-0.8%)**
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	74.3	0.0%
金価格	1,772	0.1%
対USD為替レート	23,985	0.0%
対EUR為替レート	25,016	-0.6%
対円為替レート	17,447	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	6.62%	-0.5%
国債金利 (5年間物)	4.80%	-0.3%

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
VIC	297.66	VCB	-36.24
VHM	119.11	GAS	-14.83
STB	83.02	VRE	-14.10
DXG	61.50	SAB	-8.35
SHB	52.04	DGW	-7.00

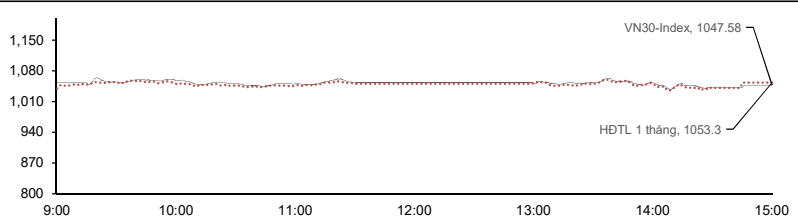
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2212	1053.30	0.70%	5.72	5.5%	503186	12/15/2022	10
VN30F2301	1045.00	0.29%	-2.58	47.4%	6347	1/19/2023	49
VN30F2203	1025.50	-0.27%	-22.08	-87.4%	126	6/15/2023	192
VN30F2206	1032.80	-0.01%	-14.78	-90.9%	203	3/16/2023	101

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
VIC	71.20	6.91	4.59
MWG	44.85	1.13	0.57
VHM	55.50	0.91	0.57
FPT	76.50	0.66	0.49
CTG	27.35	1.30	0.26

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄			
銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
VPB	16.2	1.18	-3.20
TCB	26.4	0.51	-1.55
MSN	100.0	1.94	-1.34
HPG	18.3	0.25	-1.17
NVL	19.2	0.28	-1.14

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは - 6.48ポイントの1047.58で引けた。変動幅は27.58ポイントだった。VPB、TCB、MSN、HPGとNVL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インデックスはもみ合う傾向を見せていた。売買代金が平均水準で維持した。市場の現在傾向は大きな変動幅にある。投資家は日中に先物取引契約を取引するべきだ。
- ・VN30F2303とVN30F2306の以外、他の先物取引契約は証券市場の下落に対して上昇した。売買高を見ると、VN30F2303とVN30F2306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、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
CVHM2216	8/31/2023	267	8:1	370,200	33.05%	900	16.88%	1,900	566	70,080	62,000	55,500
CVHM2217	3/1/2023	84	10:1	884,200	33.05%	880	1.15%	1,000	579	61,999	51,999	55,500
CSTB2222	3/1/2023	84	4:1	294,500	54.01%	980	1.03%	1,000	557	24,622	20,222	20,300
CVRE2218	3/1/2023	84	5:1	1,132,000	43.88%	930	-3.13%	1,000	694	33,538	27,888	29,500
CSTB2218	3/31/2023	114	2:1	1,164,200	54.01%	260	-3.70%	2,100	286	28,560	28,000	20,300
CMWG2213	6/6/2023	181	6:1	468,600	50.09%	460	-6.12%	2,760	591	57,840	54,000	44,850
CVNM2207	3/28/2023	111	15.4:1	269,000	30.09%	1,190	-6.30%	1,100	1,005	88,476	68,668	82,500
CHPG2224	3/1/2023	84	4:1	1,680,100	48.82%	420	-6.67%	1,000	142	24,502	22,222	18,250
CHPG2221	3/31/2023	114	4:1	9,275,800	48.82%	130	-7.14%	1,000	99	25,520	25,000	18,250
CSTB2223	3/1/2023	84	4:1	233,900	54.01%	740	-7.50%	1,000	461	24,471	21,111	20,300
CMBB2211	8/31/2023	267	4:1	1,478,800	43.89%	210	-8.70%	1,200	137	27,920	27,000	17,300
CSTB2215	3/28/2023	111	5:1	630,400	54.01%	610	-10.29%	1,100	351	25,722	22,222	20,300
CVRE2215	3/31/2023	114	2:1	1,050,400	43.88%	1,480	-12.43%	2,600	1,426	33,900	30,000	29,500
CHPG2215	3/28/2023	111	10:1	2,427,900	48.82%	210	-12.50%	1,000	63	25,499	22,999	18,250
CVPB2212	8/31/2023	267	2.66:1	1,364,800	42.05%	330	-13.16%	1,700	191	25,497	37,000	16,200
CVHM2214	1/3/2023	27	4:1	665,500	33.05%	240	-14.29%	2,400	134	61,320	60,000	55,500
CVHM2211	3/28/2023	111	16:1	449,600	33.05%	340	-17.07%	1,000	81	71,559	64,999	55,500
CVPB2213	3/2/2023	85	1.33:1	606,800	42.05%	610	-18.67%	2,900	203	21,327	30,500	16,200
CVJC2206	3/10/2023	93	20:1	1,145,100	22.55%	200	-20.00%	1,300	8	138,599	132,999	106,000
CACB2206	1/3/2023	27	2:1	1,348,300	38.85%	130	-23.53%	1,600	57	26,020	25,500	22,300

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12月7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、CVRE2212とCVHM2210はそれぞれ、+204.34%、+180%と最も上昇した。売買代金は前日比13.03%と減少した。CVRE2215の売買代金は最大となり、全市場10.07%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCFPT2207、CVRE2212、CMWG2213とCVRE2219の時価が理論価格と相当している。CVNM2211、CVRE2219、CVNM2207とCVRE2217の収益性は最も高かった。CVNM2211、CVNM2210、CVRE2217とCVNM2207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	44.9	1.1%	1.0	2,854	5.6	3,504	12.8	2.8	49.0%	24.0%
PNJ	小売	108.7	-2.2%	0.6	1,163	1.5	7,720	14.1	3.2	49.0%	25.9%
BVH	保険	48.3	0.6%	1.0	1,559	1.3	2,359	20.5	1.6	26.5%	8.0%
PVI	保険	44.3	0.5%	0.8	451	0.0	2,959	15.0	1.4	59.1%	9.6%
VIC	不動産	71.2	6.9%	0.5	11,807	28.9	290	245.6	2.4	12.7%	1.0%
VRE	不動産	29.5	0.5%	1.1	2,914	2.9	909	32.5	2.1	33.1%	6.6%
NVL	不動産	55.5	0.9%	0.9	10,507	8.7	7,221	7.7	1.8	24.0%	25.2%
DXG	不動産	13.1	-6.8%	1.9	347	13.8	1,390	9.4	0.8	24.5%	9.2%
SSI	証券	19.3	-1.5%	1.7	1,246	17.9	2,253	8.5	1.3	39.7%	14.5%
VCI	証券	25.5	1.6%	1.0	482	9.3	3,018	8.4	1.7	18.3%	20.2%
HCM	証券	21.2	-3.0%	1.6	420	7.7	2,087	10.1	1.2	41.1%	14.5%
FPT	技術	76.5	継続落	0.9	3,649	3.4	4,803	15.9	4.2	49.0%	28.5%
FOX	技術	49.5	-1.0%	0.4	707	0.0	4,926	10.0	2.7	0.0%	30.2%
GAS	オイルとガス	106.8	-2.5%	0.8	8,887	1.6	6,968	15.3	3.6	3.0%	25.5%
PLX	オイルとガス	29.2	-3.3%	1.5	1,613	0.9	738	39.6	1.6	17.9%	3.8%
PVS	オイルとガス	23.5	0.4%	1.4	488	7.9	1,044	22.5	0.9	17.5%	4.1%
BSR	オイルとガス	14.1	-2.1%	0.8	1,901	6.2	2,108	6.7	1.2	41.1%	19.1%
DHG	薬局	84.5	-0.6%	0.3	480	0.0	6,822	12.4	2.7	54.2%	23.2%
DPM	肥料	42.5	0.5%	1.4	723	3.5	15,533	2.7	1.3	19.0%	56.1%
DCM	肥料	29.1	-3.2%	1.3	670	3.9	7,691	3.8	1.6	12.1%	49.8%
VCB	バンク	78.5	-1.9%	0.8	16,152	5.0	5,584	14.1	2.9	23.6%	22.2%
BID	バンク	39.0	-0.3%	1.0	8,577	3.0	3,201	12.2	2.0	17.2%	18.1%
CTG	バンク	27.4	1.3%	1.4	5,715	4.9	3,239	8.4	1.2	27.5%	15.5%
VPB	バンク	16.2	-4.1%	1.2	4,728	18.7	2,995	5.4	1.1	17.7%	23.3%
MBB	バンク	17.3	-2.3%	1.4	3,410	9.3	3,876	4.5	1.1	23.2%	27.3%
ACB	バンク	22.3	0.0%	1.1	3,275	3.2	3,922	5.7	1.4	30.0%	27.0%
BMP	プラスチック	56.6	2.7%	0.7	201	0.3	6,869	8.2	1.8	85.7%	22.9%
NTP	プラスチック	32.0	0.0%	0.6	180	0.1	3,961	8.1	1.4	17.8%	17.8%
MSR	天然資源	10.6	-4.5%	1.6	507	0.1	178	59.6	0.8	10.1%	1.4%
HPG	鋼	18.3	-1.9%	1.4	4,614	27.5	2,662	6.9	1.1	21.0%	17.0%
HSG	鋼	11.6	-5.3%	1.9	302	9.4	439	26.4	0.6	6.4%	2.3%
VNM	消費者の主食	82.5	0.0%	0.4	7,497	6.6	3,778	21.8	5.5	55.9%	25.4%
SAB	消費者の主食	179.0	0.3%	0.8	4,991	1.7	8,428	21.2	4.7	62.6%	24.1%
MSN	消費者の主食	100.0	-2.0%	1.0	6,190	3.3	6,744	14.8	5.6	30.4%	40.5%
SBT	消費者の主食	13.1	0.8%	1.5	410	3.0	1,206	10.9	1.0	12.5%	9.1%
ACV	輸送	84.9	-0.1%	0.8	8,036	0.1	363	234.0	4.9	3.8%	1.3%
VJC	輸送	106.0	0.0%	1.1	2,496	2.1	114	928.4	3.3	16.7%	0.4%
HVN	輸送	10.6	-0.5%	1.7	1,016	0.4	(4,005)	#N/A	#N/A	5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	48.6	0.2%	0.8	637	0.5	3,063	15.9	2.1	48.9%	14.2%
PVT	輸送	19.4	1.6%	1.3	273	1.8	2,528	7.7	1.1	18.3%	15.3%
VCS	材料	48.5	-0.8%	0.9	337	0.1	7,783	6.2	1.5	3.0%	26.5%
VGC	材料	39.0	1.8%	1.0	760	1.1	4,399	8.9	2.3	6.0%	28.0%
HT1	材料	10.1	-2.0%	1.3	167	0.2	652	15.4	0.8	2.0%	4.7%
CTD	建設	32.1	-4.5%	1.5	103	0.5	(832)	#N/A	#N/A	52.6%	-0.7%
CII	建設	13.3	-6.7%	1.6	145	4.0	1,464	9.1	0.6	8.6%	7.1%
REE	電気	77.4	-0.8%	-1.4	1,196	1.5	7,767	10.0	1.9	49.1%	20.2%
PC1	電気	18.8	-0.3%	-0.4	221	1.6	1,507	12.5	1.0	4.2%	8.7%
POW	電気	11.0	0.5%	0.6	1,115	4.2	499	22.0	0.9	4.6%	3.9%
NT2	電気	26.8	1.3%	0.7	335	0.7	2,858	9.4	1.7	16.1%	19.2%

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
VIC	71.20	6.91	4.40	9.42MLN
VHM	55.50	0.91	0.55	3.60MLN
CTG	27.35	1.30	0.42	4.10MLN
MWG	44.85	1.13	0.18	2.93MLN
FPT	76.50	0.66	0.14	1.03MLN

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	日に貢献したポイント	売買高
VCB	78.50	-1.88	-1.78	1.46MLN
GAS	106.80	-2.47	-1.30	336900.00
VPB	16.20	-4.14	-1.19	26.22MLN
MSN	100.00	-1.96	-0.72	734100.00
NVL	19.20	-6.80	-0.69	23.23MLN

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
POM	5.66	6.99	0.03	525400.00
SSC	30.75	6.96	0.01	100.00
HTL	17.00	6.92	0.00	1500.00
VIC	71.20	6.91	4.40	9.42MLN
TNC	68.40	6.88	0.02	2000.00

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
VCB	78.50	-1.88	-1.78	1.46MLN
GAS	106.80	-2.47	-1.30	336900
VPB	16.20	-4.14	-1.19	26.22MLN
MSN	100.00	-1.96	-0.72	734100
NVL	19.20	-6.80	-0.69	23.23MLN

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
NVB	18.30	6.40	0.86	59200
THD	41.50	1.22	0.29	53800
DNP	24.50	6.06	0.21	1500
IDC	34.30	1.48	0.20	3.88MLN
HJS	33.70	9.77	0.05	8600

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	19.70	-9.63	-0.67	19.62MLN
SHS	8.60	-4.44	-0.48	24.92MLN
BAB	13.70	-2.14	-0.36	7200
L14	61.20	-10.00	-0.26	1.50MLN
HUT	17.00	-3.95	-0.23	3.64MLN

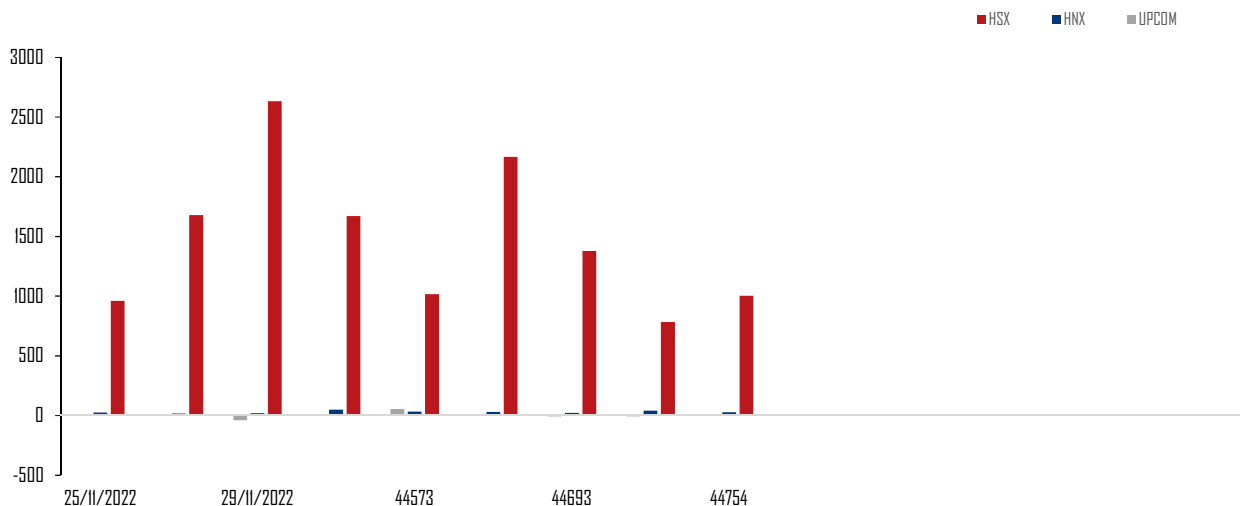
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
VHL	16.60	9.93	0.03	100
NBW	17.90	9.82	0.01	400
HJS	33.70	9.77	0.05	8600
SCI	10.20	9.68	0.02	343500
VMS	14.00	9.38	0.01	7200

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
DS3	4.50	-10.00	-0.01	252400
L14	61.20	-10.00	-0.26	1.50MLN
MST	4.50	-10.00	-0.05	2.36MLN
TVC	5.40	-10.00	-0.09	889100
VKC	1.80	-10.00	-0.01	355500

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