

2023 01 30

Vietnam Daily Review

VNインデックス9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-14.53ポイント安の1102.57で引けた。HNXインデックスは+0.02ポイント高の220.78で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はHPG (+0.37%)、HDB (+0.35%)、DIG (+0.13%)、BHN (+0.12%)、MWG (+0.11%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-3.68%)、VHM (-1.97%)、VIC (-1.44%)、ACB (-0.81%)、GAS (-0.77%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比21.34%増の12兆5,870億ドンに達した。総売買代金が13兆6,280億ドンに達した。変動幅は15.89ポイントだった。上昇には210銘柄、変わらずには44銘柄、下落には218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、7,455億3,000万ドン、267億3,000万ドンだった。最も買われたのはFUEVFN (2,796億1,000万ドン)、HPG (2,481億9,000万ドン)、SSI (711億ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間で1100ポイントの周りでもみ合った後、終盤に上げ幅を拡大し14.53ポイント安の1102.57で引けた。19業界うちの5業界は上昇した。そのうち、最も上昇率は基本的なリソース業界（1.4%高以上）だった。外国人投資家の傾向について、HSX市場及びHNX市場で引き続き買い越した。VNインデックスは次の数日に続落する可能性がある。サポート線1090ポイントに接近したら、VNインデックスは反発すると予測されている。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1月30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 1102.57

売買代金: 12586.73 億ドン **-14.53 (-1.3%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

HNX-INDEX 220.78

売買代金: 0 億ドン **0.02 (0.01%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

UPCOM-INDEX 75.40

#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	79.1	-0.8%
金価格	1,922	-0.3%
対USD為替レート	23,454	0.0%
対EUR為替レート	25,482	0.0%
対円為替レート	18,103	0.0%
銀行間金利（1か月物）	7.84%	0.6%
国債金利（5年間物）	4.25%	-0.5%

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
FUEVFN	279.61	DGC	-34.37
HPG	248.19	KDC	-24.22
SSI	71.10	VNM	-22.58
VND	49.54	VCB	-21.97
HDB	46.66	BMP	-18.27

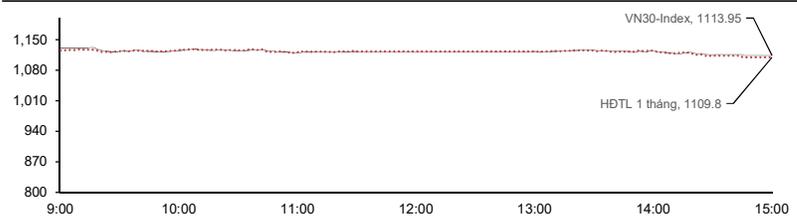
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2309	1090.00	-1.93%	-23.95	-53.4%	48	9/21/2023	236
VN30F2302	1109.80	-1.53%	-4.15	16.9%	209140	2/16/2023	19
VN30F2303	1108.40	-1.48%	-5.55	-19.0%	516	3/16/2023	47
VN30F2306	1097.10	-1.30%	-16.85	31.3%	344	6/15/2023	138

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	18.25	3.11	1.01
HPG	21.75	1.16	0.84
MWG	46.20	0.65	0.34
POW	12.35	1.23	0.07
SSI	21.00	0.24	0.06

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
ACB	25.4	0.36	-2.85
VPB	19.3	0.00	-2.05
VHM	51.5	0.00	-2.05
VCB	89.9	-0.11	-1.69
STB	25.9	-0.98	-1.58

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは16.7ポイント安の1113.95で引けた。変動幅は19.02ポイントだった。ACB、VPB、VHM、VCBとSTB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インデックスは売りに勢いが強まったことで、終盤にかけて値を下げた。殆どの大型株は下落した。売買代金が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、VN30F2302とVN30F2306の以外、他の先物取引契約が減少した。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。

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
CMBB2210	3/31/2023	60	2:1	1,136,000	43.62%	100	11.11%	2,000	70	25,800	25,500	19,250
CHDB2208	3/8/2023	37	3.99:1	650,100	33.54%	410	10.81%	1,100	107	20,828	19,189	18,250
CHPG2215	3/28/2023	57	10:1	975,200	51.46%	230	9.52%	1,000	118	25,499	22,999	21,750
CHPG2225	6/6/2023	127	3:1	1,437,600	51.46%	1,780	5.95%	1,550	1,805	20,870	17,000	21,750
CHPG2223	3/2/2023	31	2:1	711,800	51.46%	610	5.17%	2,300	454	23,900	22,500	21,750
CMWG2213	6/6/2023	127	6:1	646,100	48.30%	540	1.89%	2,760	445	57,840	54,000	46,200
CHPG2221	3/31/2023	60	4:1	7,222,700	51.46%	110	0.00%	1,000	176	25,520	25,000	21,750
CVRE2218	3/1/2023	30	5:1	537,100	45.73%	610	-1.61%	1,000	620	33,538	27,888	29,800
CVNM2207	3/28/2023	57	15.4:1	145,300	28.90%	970	-2.02%	1,100	786	88,476	67,462	79,400
CFPT2212	6/6/2023	127	10:1	135,900	32.45%	1,640	-2.38%	1,870	1,623	83,200	70,000	83,700
CMBB2213	6/6/2023	127	3:1	245,700	43.62%	1,180	-4.07%	1,550	1,234	20,600	17,000	19,250
CMBB2211	8/31/2023	213	4:1	1,422,400	43.62%	180	-5.26%	1,200	202	27,920	27,000	19,250
CVPB2212	8/31/2023	213	2.66:1	751,600	41.18%	600	-6.25%	1,700	414	25,497	24,644	19,250
CVNM2210	3/2/2023	31	5:1	77,200	28.90%	1,830	-7.11%	2,700	1,541	87,750	71,718	79,400
CSTB2222	3/1/2023	30	4:1	236,800	54.24%	1,530	-11.56%	1,000	1,640	24,622	20,222	25,850
CSTB2215	3/28/2023	57	5:1	180,700	54.24%	1,070	-11.57%	1,100	1,020	25,722	22,222	25,850
CSTB2223	3/1/2023	30	4:1	248,500	54.24%	1,360	-11.69%	1,000	1,431	24,471	21,111	25,850
CVPB2213	3/2/2023	31	1.33:1	715,300	41.18%	710	-19.32%	2,900	536	21,327	20,315	19,250
CSTB2218	3/31/2023	60	2:1	1,479,900	54.24%	570	-25.97%	2,100	930	28,560	28,000	25,850
CSTB2220	3/2/2023	31	2:1	247,200	54.24%	1,260	-30.00%	2,100	1,488	25,540	24,500	25,850

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1月30日には、カワ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、CHPG2225は+18.83%と最も上昇した。売買代金は前日比+28.9%増となった。CHPG2225の売買代金は最大となり、全市場の18.83%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCMSN2214、CSTB2218、CHPG2221とCVRE2219の時価が理論価格と相当している。CSTB2222、CSTB2223、CHPG2225、và CVNM2211の収益性は最も高かった。CVNM2211、CSTB2214、CFPT2207とCSTB2222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	đầu năm	0.7%	1.3	2,939	6.4	3,504	13.2	2.9	49.0%	24.0%
PNJ	小売	92.2	-1.9%	0.7	1,315	1.4	5,790	15.9	3.6	49.0%	25.9%
BVH	保険	50.5	-1.0%	1.0	1,630	1.4	2,359	21.4	1.7	27.0%	8.0%
PVI	保険	49.8	-0.4%	0.8	507	0.0	2,959	16.8	1.6	#VALUE!	9.6%
VIC	不動産	57.7	-2.5%	0.4	9,568	2.8	290	199.1	1.9	12.8%	1.0%
VRE	不動産	29.8	-1.7%	1.1	2,944	2.1	1,204	24.8	2.0	32.5%	8.6%
NVL	不動産	51.5	-3.4%	0.8	9,750	3.1	7,221	7.1	1.7	24.4%	25.2%
DXG	不動産	14.4	2.1%	2.1	382	10.3	255	56.5	1.0	27.6%	1.7%
SSI	証券	21.0	0.2%	1.7	1,360	17.7	1,456	14.4	1.4	42.7%	9.3%
VCI	証券	29.3	-0.8%	1.0	555	11.4	2,004	14.6	2.0	22.0%	13.3%
HCM	証券	24.3	0.0%	1.7	483	6.2	1,865	13.0	1.4	44.7%	11.2%
FPT	技術	83.7	反落。	0.8	3,992	3.3	4,838	17.3	4.4	49.0%	24.8%
FOX	技術	58.0	-2.5%	0.4	828	0.0	4,926	11.8	3.2	#VALUE!	30.2%
GAS	オイルとガス	106.6	-1.5%	0.8	8,871	1.3	6,968	15.3	3.6	3.0%	25.5%
PLX	オイルとガス	37.1	-2.8%	1.5	2,047	1.1	738	50.2	2.0	17.9%	3.8%
PVS	オイルとガス	24.6	-2.4%	1.3	511	8.8	1,044	23.6	1.0	#VALUE!	4.1%
BSR	オイルとガス	16.7	-1.8%	0.8	2,251	9.1	2,108	7.9	1.4	#VALUE!	19.1%
DHG	薬局	94.2	1.2%	0.3	535	0.1	7,318	12.9	2.9	54.2%	23.7%
DPM	肥料	43.3	2.2%	1.3	736	3.4	15,533	2.8	1.3	19.3%	56.1%
DCM	肥料	27.4	0.9%	1.4	631	4.1	7,691	3.6	1.5	11.8%	49.8%
VCB	バンク	89.9	-3.3%	0.9	18,498	4.1	5,584	16.1	3.3	23.6%	22.2%
BID	バンク	44.5	-0.1%	1.1	9,787	2.3	3,201	13.9	2.3	17.2%	18.1%
CTG	バンク	29.8	-2.0%	1.2	6,216	4.9	3,239	9.2	1.4	28.1%	15.5%
VPB	バンク	19.3	-2.3%	1.2	5,619	20.2	2,736	7.0	1.4	17.6%	23.3%
MBB	バンク	19.3	-2.3%	1.4	3,795	10.7	3,876	5.0	1.2	23.2%	27.3%
ACB	バンク	25.4	-3.6%	1.1	3,730	6.0	3,922	6.5	1.5	30.0%	27.0%
BMP	プラスチック	67.2	5.2%	0.7	239	1.2	8,505	7.9	2.1	86.0%	28.3%
NTP	プラスチック	33.8	0.6%	0.6	190	0.0	3,701	9.1	1.5	#VALUE!	17.3%
MSR	天然資源	12.8	3.2%	1.5	612	0.2	178	71.9	1.0	#VALUE!	1.4%
HPG	鋼	21.8	1.2%	1.6	5,499	40.4	2,662	8.2	1.3	22.6%	17.0%
HSG	鋼	15.0	0.0%	2.1	389	11.5	(1,776)	#N/A N/A	0.9	8.4%	-10.0%
VNM	消費者の主食	79.4	-0.8%	0.4	7,215	5.6	3,778	21.0	5.3	56.0%	25.4%
SAB	消費者の主食	190.0	-1.6%	0.8	5,298	1.5	8,428	22.5	5.0	62.6%	24.1%
MSN	消費者の主食	102.0	-1.6%	1.1	6,314	1.5	2,515	40.6	5.7	30.6%	40.5%
SBT	消費者の主食	14.6	1.0%	1.2	426	1.9	965	15.1	1.1	14.7%	7.1%
ACV	輸送	85.5	-0.6%	0.8	8,093	0.4	363	235.7	4.9	#VALUE!	1.3%
VJC	輸送	113.0	-2.8%	1.1	2,661	1.7	114	989.7	3.5	17.1%	0.4%
HVN	輸送	13.9	-2.8%	1.7	1,333	1.8	(4,720)	#N/A N/A #N/A N/A		5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	51.6	-0.6%	0.8	676	1.5	3,063	16.8	2.2	49.0%	14.2%
PVT	輸送	20.9	-0.5%	1.3	294	2.5	2,528	8.3	1.2	19.5%	15.3%
VCS	材料	56.0	-2.4%	0.8	390	1.0	7,783	7.2	1.7	#VALUE!	26.5%
VGC	材料	38.2	-3.2%	1.4	744	2.1	3,896	9.8	2.2	5.3%	23.7%
HT1	材料	13.8	1.1%	1.4	229	1.1	685	20.2	1.0	2.6%	5.1%
CTD	建設	39.3	-0.5%	1.8	126	0.7	(832)	#N/A N/A	0.4	49.2%	-0.7%
CII	建設	15.3	3.0%	1.7	167	4.4	1,464	10.4	0.7	8.5%	7.1%
REE	電気	73.5	1.4%	-1.4	1,136	3.6	7,563	9.7	1.8	49.0%	20.2%
PC1	電気	25.5	-1.5%	-0.4	300	1.3	1,507	16.9	1.4	5.1%	8.7%
POW	電気	12.4	1.2%	0.6	1,257	6.0	499	24.8	1.0	5.5%	3.9%
NT2	電気	27.4	-3.0%	0.8	342	1.2	2,457	11.1	1.8	16.2%	16.3%

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
HPG	21.75	1.16	0.37	42.34MLN
HDB	18.25	c xanh đầu n	0.35	3.77MLN
DIG	17.00	5.26	0.13	17.89MLN
BHN	47.50	4.51	0.12	1600.00
MWG	46.20	0.65	0.11	3.21MLN

VNインデックス9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
VCB	89.90	-3.33	-3.68	1.05MLN
VHM	51.50	-3.38	-1.97	1.35MLN
VIC	57.70	-2.53	-1.44	1.12MLN
ACB	25.40	-3.61	-0.81	5.40MLN
GAS	106.60	-1.48	-0.77	267500.00

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
BCE	6.42	7.00	0.00	163300.00
HU1	7.49	7.00	0.00	100.00
SC5	21.40	7.00	0.01	1300.00
ITA	4.74	7.00	0.07	3.73MLN
TNC	52.00	7.00	0.02	100.00

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	89.90	-3.33	-3.68	1.05MLN
VHM	51.50	-3.38	-1.97	1.35MLN
VIC	57.70	-2.53	-1.44	1.12MLN
ACB	25.40	-3.61	-0.81	5.40MLN
GAS	106.60	-1.48	-0.77	267500

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
HUT	16.60	3.75	0.28	4.86MLN
BAB	14.10	1.44	0.24	12100
CEO	22.80	3.17	0.22	12.12MLN
TAR	13.90	9.45	0.08	2.90MLN
TVC	5.50	10.00	0.07	829000

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
IDC	39.20	-2.73	-0.45	3.73MLN
NVB	19.60	-2.49	-0.39	56900
KSF	62.10	-2.20	-0.31	43000
THD	41.50	-1.19	-0.29	7500
PVS	24.60	-2.38	-0.24	8.10MLN

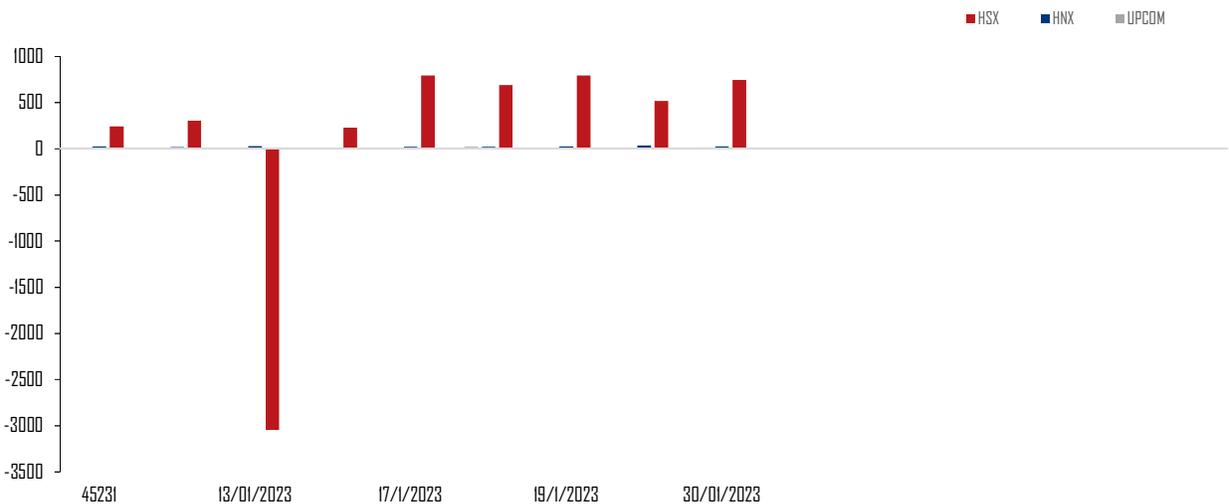
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
CTT	15.40	10.00	0.01	200
PCG	6.60	10.00	0.01	35300
PPY	8.80	10.00	0.00	5800
TVC	5.50	10.00	0.07	829000
VLA	63.80	10.00	0.01	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
VHL	22.50	-10.00	-0.05	600
VCC	13.80	-9.80	-0.01	9000
PSE	12.40	-9.49	-0.01	43100
SGC	78.00	-9.30	-0.02	100
KKC	8.00	-9.09	0.00	1700

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