

2023 02 01

Vietnam Daily Review

VNインデックス大幅反落。

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-35.21ポイント安の1075.97で引けた。HNXインデックスは-6.42ポイント安の216.01で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はHDB (+0.22%)、MWG (+0.22%)、NVL (+0.17%)、SBT (+0.17%)、GAS (+0.14%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-3.33%)、VHM (-3.17%)、BID (-2.92%)、MSN (-2.11%)、VPB (-1.95%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比39.71%増の16兆3,940億ドンに達した。総売買代金が17兆6,230億ドンに達した。変動幅は40.99ポイントだった。上昇には89銘柄、変わらずには37銘柄、下落には351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、933億5,000万ドン、394億6,000万ドンだった。最も買われたのはHPG (2,011億5,000万ドン)、HCM (483億9,000万ドン)、HDB (444億ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは前場に1100ポイントの周りでもみ合ったが、後場に入ると、売りに勢いが強まったことで、値を消しマイナス圏に転落し3%安の1075.97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17業界が下落した。そのうち、証券業界は大幅に下落した。外国人投資家の傾向について、HSX市場及びHNX市場で買い越した。VNインデックスは本日急落すると共に、売買代金が急増したことを見ると、短期的に下落する可能性がある。BSCはVNインデックスがサポート線1050ポイントに接近すると、反発すると期待しております。

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2月1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 1075.97

売買代金: 16393.59 億ドン **-35.21 (-316.87%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 216.01

売買代金: 0 億ドン **-6.42 (-288.63%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 74.93

#VALUE! **-0.91 (-119.99%)**
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	79.6	0.9%
金価格	1,924	-0.2%
対USD為替レート	23,451	0.0%
対EUR為替レート	25,480	0.2%
対円為替レート	18,008	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	7.71%	0.5%
国債金利 (5年間物)	3.95%	-0.6%

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
HPG	201.15	VHM	-102.85
HCM	48.39	DGC	-42.06
HDB	44.40	VNM	-39.10
STB	39.47	MSN	-34.42
BID	38.61	CTG	-31.44

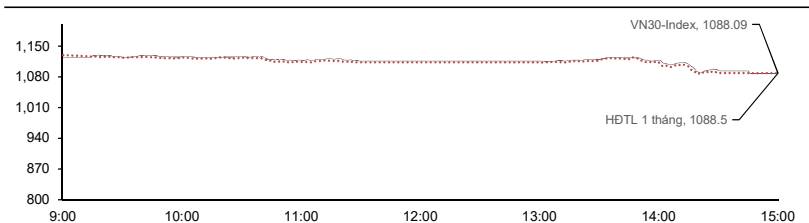
ソース：BSCリサーチ

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	1065.50	-3.41%	-22.59	-28.6%	65	9/21/2023	234
VN30F2302	1088.50	-3.24%	0.41	49.4%	321317	2/16/2023	17
VN30F2303	1085.00	-3.44%	-3.09	38.6%	812	3/16/2023	45
VN30F2306	1074.20	-3.19%	-13.89	57.1%	143	6/15/2023	136

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
MWG	47.10	1.29	0.69
HDB	19.00	1.88	0.65
NVL	14.55	2.46	0.29
VNM	77.20	0.13	0.09
VIB	23.60	0.21	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
VPB	18.3	0.28	-5.25
MSN	95.2	0.36	-3.95
HPG	21.1	-0.79	-3.35
VHM	48.0	-1.49	-3.30
TCB	28.2	-1.06	-2.87

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは-36.98ポイント安の1088.09で引けた。変動幅は42.11ポイントだった。VPB、MSN、HPG、VHMとTCB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インデックスは赤色を染まれ、多くの株式が約2%安となった。VN30インデックスの多くの銘柄は売りに勢いが強まった。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。
- ・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、VN30F2309の以外、他の先物取引契約が増加した。売買高を見ると、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
CHDB2208	3/8/2023	35	3.99:1	1,929,800	33.11%	490	11.36%	1,100	246	20,828	19,189	19,000
CHPG2221	3/31/2023	58	4:1	7,882,800	50.57%	110	0.00%	1,000	227	25,520	25,000	21,100
CPOW2210	6/6/2023	125	1:1	163,000	45.48%	990	0.00%	1,870	1,265	13,850	13,000	11,950
CVNM2207	3/28/2023	55	15.4:1	221,800	28.58%	800	-3.61%	1,100	640	88,476	67,462	77,200
CHPG2225	6/6/2023	125	3:1	591,300	50.57%	1,800	-4.76%	1,550	2,034	20,870	17,000	21,100
CMBB2213	6/6/2023	125	3:1	938,500	42.38%	1,140	-6.56%	1,550	1,215	20,600	17,000	18,900
CHPG2215	3/28/2023	55	10:1	981,400	50.57%	220	-8.33%	1,000	150	25,499	22,999	21,100
CHPG2223	3/2/2023	29	2:1	949,000	50.57%	590	-9.23%	2,300	620	23,900	22,500	21,100
CSTB2222	3/1/2023	28	4:1	181,000	53.36%	1,560	-10.34%	1,000	1,696	24,622	20,222	25,650
CVPB2212	8/31/2023	211	2.66:1	855,700	39.67%	520	-13.33%	1,700	346	25,497	24,644	18,300
CVHM2216	8/31/2023	211	8:1	469,400	34.09%	360	-14.29%	1,900	243	70,080	62,000	48,000
CSTB2215	3/28/2023	55	5:1	357,500	53.36%	1,010	-15.83%	1,100	1,053	25,722	22,222	25,650
CMSN2214	6/6/2023	125	10:1	511,300	44.31%	650	-17.72%	1,640	1,068	111,900	100,000	95,200
CVRE2211	3/28/2023	55	8:1	550,300	44.35%	340	-19.05%	1,000	288	34,728	28,888	28,000
CVHM2218	6/6/2023	125	6:1	985,700	34.09%	590	-19.18%	1,650	447	63,180	54,000	48,000
CVRE2215	3/31/2023	58	2:1	302,300	44.35%	760	-22.45%	2,600	938	33,900	30,000	28,000
CVPB2211	3/31/2023	58	1.33:1	604,900	39.67%	240	-22.58%	2,450	168	23,605	23,312	18,300
CSTB2218	3/31/2023	58	2:1	1,233,100	53.36%	530	-24.29%	2,100	949	28,560	28,000	25,650
CVPB2213	3/2/2023	29	1.33:1	1,219,500	39.67%	450	-35.71%	2,900	396	21,327	20,315	18,300
CVHM2215	3/31/2023	58	6:1	1,616,300	34.09%	90	-40.00%	2,100	58	64,920	60,000	48,000

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2月1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、CHPG2227は+8.63%と最も上昇した。売買代金は前日比+23.6%増となった。CHPG2227の売買代金は最大となり、全市場の8.63%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCHPG2221、CSTB2218、CMSN2214とCVRE2219の時価が理論価格と相当している。CSTB2222、CSTB2223、CHPG2225とCVNM2211の収益性は最も高かった。CSTB2214、CHPG2225、CSTB2222とCVNM2211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	1.3%	1.3	2,997	15.9	2,830	16.6	2.9	49.0%	18.5%
PNJ	小売	86.7	-3.9%	0.7	1,236	1.8	6,073	14.3	3.3	49.0%	24.7%
BVH	保険	50.0	-0.8%	1.0	1,614	3.0	2,059	24.3	1.8	27.0%	7.4%
PVI	保険	50.9	1.8%	0.8	518	0.5	2,959	17.2	1.6	#VALUE!	9.6%
VIC	不動産	55.2	-3.3%	0.4	9,153	4.5	2,252	24.5	1.9	12.8%	8.0%
VRE	不動産	28.0	-5.7%	1.1	2,766	2.4	1,204	23.3	1.9	32.5%	8.6%
NVL	不動産	48.0	-5.7%	0.8	9,087	7.9	6,575	7.3	1.4	24.4%	21.3%
DXG	不動産	13.9	-6.7%	2.1	369	12.8	255	54.5	0.9	27.6%	1.7%
SSI	証券	20.2	-6.7%	1.7	1,305	24.4	1,456	13.8	1.3	42.7%	9.3%
VCI	証券	27.9	-6.9%	1.0	527	12.4	2,004	13.9	1.9	22.0%	13.3%
HCM	証券	23.5	-6.9%	1.7	466	8.0	1,865	12.6	1.4	44.7%	11.2%
FPT	技術	82.0	反落。	0.8	3,911	3.8	4,838	16.9	4.3	49.0%	24.8%
FOX	技術	58.0	0.0%	0.4	828	0.0	4,926	11.8	3.2	#VALUE!	30.2%
GAS	オイルとガス	106.6	0.3%	0.8	8,871	3.5	7,647	13.9	3.4	3.0%	26.7%
PLX	オイルとガス	36.3	-1.5%	1.5	2,003	2.1	1,156	31.3	2.0	17.9%	3.8%
PVS	オイルとガス	24.0	-6.3%	1.3	499	8.5	1,044	23.0	0.9	#VALUE!	6.0%
BSR	オイルとガス	16.1	-4.7%	0.8	2,170	9.8	2,108	7.6	1.3	#VALUE!	19.1%
DHG	薬局	93.8	-0.6%	0.3	533	0.0	7,318	12.8	2.9	54.2%	23.7%
DPM	肥料	42.2	-3.5%	1.3	717	6.2	14,039	3.0	1.3	19.3%	56.1%
DCM	肥料	26.7	-4.8%	1.4	613	6.0	7,605	3.5	1.5	11.8%	49.8%
VCB	バンク	89.1	-3.0%	0.9	18,333	4.5	6,316	14.1	3.3	23.6%	22.2%
BID	バンク	42.8	-5.1%	1.1	9,413	4.9	3,597	11.9	2.2	17.2%	19.9%
CTG	バンク	29.0	-4.9%	1.2	6,059	5.6	3,518	8.2	1.3	28.1%	15.5%
VPB	バンク	18.3	-5.9%	1.2	5,341	26.6	2,722	6.7	1.3	17.6%	20.7%
MBB	バンク	18.9	-3.3%	1.4	3,726	13.3	3,856	4.9	1.2	23.2%	27.3%
ACB	バンク	25.2	-3.3%	1.1	3,700	3.9	4,053	6.2	1.5	30.0%	26.5%
BMP	プラスチック	61.6	-5.2%	0.7	219	1.3	8,505	7.2	1.9	86.0%	28.3%
NTP	プラスチック	33.5	-1.2%	0.6	189	0.1	3,701	9.1	1.5	#VALUE!	17.3%
MSR	天然資源	11.8	-6.3%	1.5	564	0.2	178	66.3	0.9	#VALUE!	1.4%
HPG	鋼	21.1	-4.5%	1.6	5,334	49.8	1,459	14.5	1.3	22.6%	9.1%
HSG	鋼	14.7	-5.5%	2.1	381	21.1	(1,776)	#N/A #N/A	0.9	8.4%	-10.0%
VNM	消費者の主食	77.2	0.1%	0.4	7,015	6.1	3,632	21.3	5.4	56.0%	24.1%
SAB	消費者の主食	187.0	-1.1%	0.8	5,214	1.4	8,006	23.4	5.2	62.6%	23.6%
MSN	消費者の主食	95.2	-5.8%	1.1	5,893	4.1	2,515	37.9	5.2	30.6%	12.1%
SBT	消費者の主食	15.8	6.8%	1.2	461	7.9	965	16.3	1.2	14.7%	7.1%
ACV	輸送	85.0	0.0%	0.8	8,045	0.4	363	234.3	4.9	#VALUE!	1.3%
VJC	輸送	113.9	-2.1%	1.1	2,682	1.7	114	997.6	3.5	17.1%	0.4%
HVN	輸送	13.5	-4.6%	1.7	1,295	1.2	(4,720)	#N/A #N/A #N/A #N/A	5.9%	#VALUE!	
GMD	輸送	51.5	-2.8%	0.8	675	2.2	3,037	17.0	2.2	49.0%	13.8%
PVT	輸送	20.0	-6.8%	1.3	281	3.9	2,587	7.7	1.1	19.5%	15.3%
VCS	材料	55.0	-1.1%	0.8	383	0.5	7,783	7.1	1.7	#VALUE!	26.5%
VGC	材料	37.1	-5.5%	1.4	723	1.8	3,896	9.5	2.2	5.3%	23.7%
HT1	材料	13.4	-7.0%	1.4	221	0.7	685	19.5	1.0	2.6%	5.1%
CTD	建設	36.6	-7.0%	1.8	117	0.8	281	130.1	0.3	49.2%	-0.7%
CII	建設	14.3	-6.8%	1.7	157	4.8	3,003	4.8	0.7	8.5%	7.1%
REE	電気	73.1	-2.0%	-1.4	1,130	1.4	7,563	9.7	1.7	49.0%	18.7%
PC1	電気	24.3	-6.9%	-0.4	286	3.2	1,664	14.6	1.3	5.1%	8.7%
POW	電気	12.0	-3.6%	0.6	1,217	8.5	809	14.8	0.9	5.5%	3.9%
NT2	電気	27.6	-4.2%	0.8	345	1.3	2,457	11.2	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
HDB	19.00	1.88	0.22	5.42MLN
MWG	47.10	c xanh đầu n	0.22	7.84MLN
NVL	14.55	2.46	0.17	33.62MLN
SBT	15.75	6.78	0.17	11.65MLN
GAS	106.60	0.28	0.14	732800.00

VNインデックス大幅反落。

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
VCB	89.10	-3.05	-3.33	1.14MLN
VHM	48.00	-5.70	-3.17	3.65MLN
BID	42.80	-5.10	-2.92	2.51MLN
MSN	95.20	-5.84	-2.11	958200.00
VPB	18.30	-5.91	-1.95	32.20MLN

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
LSS	7.49	7.00	0.01	1.53MLN
SSC	30.65	6.98	0.01	600.00
TNC	55.60	6.92	0.02	500.00
ASP	5.77	6.85	0.00	248400.00
VCA	11.70	6.85	0.00	2900.00

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
VCB	89.10	-3.05	-3.33	1.14MLN
VHM	48.00	-5.70	-3.17	3.65MLN
BID	42.80	-5.10	-2.92	2.51MLN
MSN	95.20	-5.84	-2.11	958200.00
VPB	18.30	-5.91	-1.95	32.20MLN

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
SLS	149.40	5.58	0.06	29700
PVI	50.90	1.80	0.05	208000
INN	41.90	3.97	0.04	1300
EVS	11.80	2.61	0.03	364300
DDG	40.50	0.75	0.03	402900

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
SHS	9.30	-7.00	-0.84	34.26MLN
CEO	22.20	-9.76	-0.76	15.01MLN
THD	40.20	-3.13	-0.75	15900
HUT	15.40	-8.33	-0.64	4.70MLN
PVS	24.00	-6.25	-0.63	7.86MLN

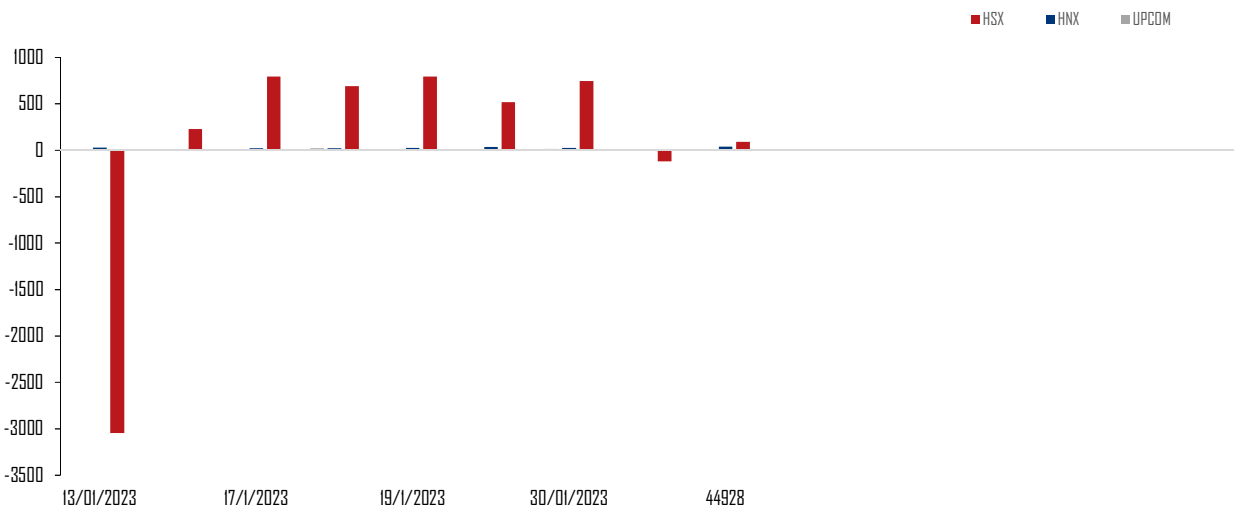
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対に貢献したポイント	売買高
KHS	15.40	10.00	0.01	200
PEN	7.70	10.00	0.00	3500
MDC	12.20	9.91	0.01	262800
SDN	39.00	9.86	0.00	500
TSB	46.80	9.86	0.02	98100

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
ADC	16.30	-9.94	-0.01	20900
VC6	9.20	-9.80	-0.01	2700
CEO	22.20	-9.76	-0.76	15.01MLN
VNT	59.70	-9.68	-0.02	100
PVC	14.10	-9.62	-0.08	2.69MLN

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

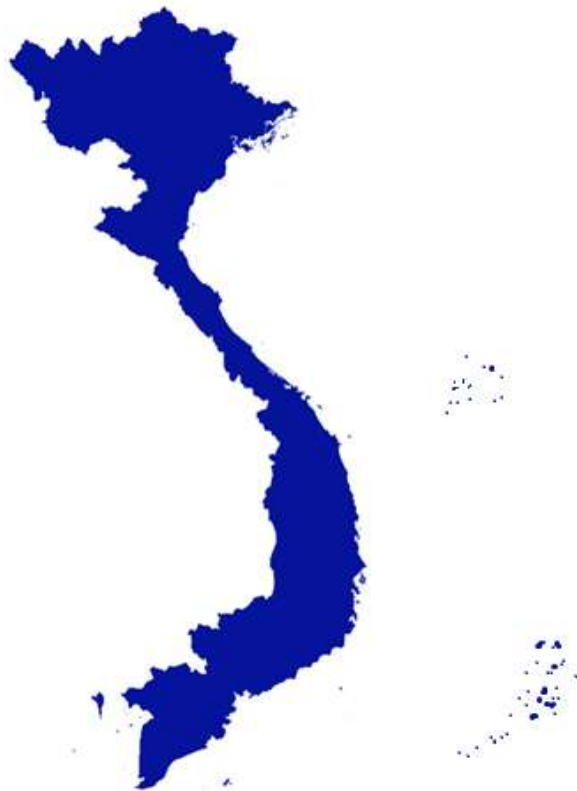
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

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