

2023 02 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-23.45ポイント安の1065.84で引けた。HNXインデックスは-4.47ポイント安の210で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はHVN (+0.28%)、GAS (+0.14%)、TPB (+0.12%)、FRT (+0.09%)、PLX (+0.07%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-4.75%)、HPG (-2.04%)、BID (-1.52%)、VHM (-1.26%)、VIC (-0.96%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比37.84%増の10兆210億ドンに達した。総売買代金が12兆1,680億ドンに達した。変動幅は26.94ポイントだった。上昇には77銘柄、変わらずには52銘柄、下落には342銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場での買越額は349億4,000万ドンだった。最も買われたのはSTB (1,757億1,000万ドン)、CTG (349億ドン)、E1VFN30 (348億4,000万ドン) だった。一方、HNX市場での売越額は91億4,000万ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で引けた後、前日終値付近で小幅な値動きでもみ合ったが、抵抗線1190まで上昇する局面もあった。その後、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23.45ポイント安の1065.84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、最も下落率は基本的なりソース業界及び化学業界だった。外国人投資家の傾向について、HSX市場で買い越したが、HNX市場で売り越した。直近の数日に、VNインデックスが下落し、売買代金が低い水準で留まったのは投資家の心理が消極的になっていたと示した。VNインデックスは短期的には続落する可能性がある。BSCはVNインデックスがサポート線1050~1060ポイントに下落すると、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7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 1065.84

売買代金: 10020.58 億ドン **-23.45 (-215.28%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 210.00

売買代金: 0 億ドン **-4.47 (-208.42%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 75.54

#VALUE! **-0.42 (-55.29%)**
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	75.8	2.3%
金価格	1,875	0.4%
対USD為替レート	23,504	0.0%
対EUR為替レート	25,226	0.2%
対円為替レート	17,816	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	7.45%	0.2%
国債金利 (5年間物)	3.85%	-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
STB	175.71	HPG	-53.98
CTG	34.90	VCB	-47.70
E1VFN30	34.84	VHM	-31.68
VNM	24.40	VND	-31.16
PLX	22.42	HSG	-30.94

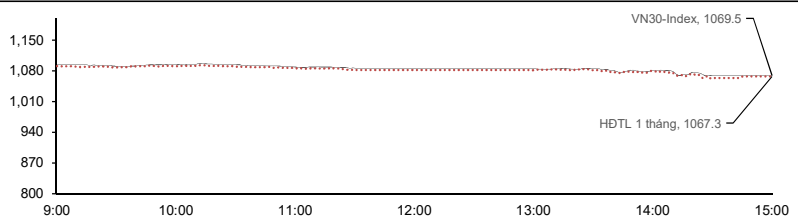
ソース：BSCリサーチ

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	1050.10	-1.97%	-19.40	-16.4%	56	9/21/2023	228
VN30F2302	1067.30	-2.14%	-2.20	-2.1%	278669	2/16/2023	11
VN30F2303	1062.30	-2.36%	-7.20	-45.6%	891	3/16/2023	39
VN30F2306	1055.00	-2.03%	-14.50	-20.9%	273	6/15/2023	130

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
TPB	24.40	1.24	0.30
FPT	80.70	0.25	0.20
STB	25.75	0.19	0.10
GAS	106.30	0.28	0.03
PLX	39.00	0.52	0.03

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
HPG	19.8	0.00	-4.67
VPB	18.0	-0.09	-2.70
VCB	92.0	-2.77	-2.17
MWG	45.7	-5.13	-1.66
MSN	94.1	-2.79	-1.47

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは-24.87ポイント安の1069.5で引けた。変動幅は28.22ポイントだった。HPG、VPB、VCB、MWGとMSN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インデックスは安値で寄り付いた後、下げ幅を拡大した。売買代金が低い水準で留まった。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、先物取引契約が減少した。売買高を見ると、VN30F2309の以外、他の先物取引契約が増加した。

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
CVRE2211	3/28/2023	49	8:1	33,200	44.51%	330	3.13%	1,000	262	34,728	28,888	28,550
CPOW2210	6/6/2023	119	1:1	57,200	44.91%	960	-2.04%	1,870	968	13,850	13,000	12,200
CVNM2207	3/28/2023	49	15.4:1	94,700	27.63%	760	-2.56%	1,100	536	88,476	67,462	76,100
CFPT2210	8/31/2023	205	10:1	215,000	30.32%	660	-4.35%	2,350	442	98,500	90,000	80,700
CMBB2213	6/6/2023	119	3:1	325,800	41.74%	980	-4.85%	1,550	920	20,600	17,000	18,350
CTCB2214	6/6/2023	119	3:1	37,700	44.45%	1,200	-5.51%	2,470	988	31,680	27,000	27,400
CSTB2222	3/1/2023	22	4:1	154,600	52.56%	1,440	-5.88%	1,000	1,480	24,622	20,222	25,750
CVRE2216	8/31/2023	205	4:1	193,600	44.51%	730	-6.41%	1,650	865	36,320	31,000	28,550
CVRE2215	3/31/2023	52	2:1	291,100	44.51%	660	-7.04%	2,600	845	33,900	30,000	28,550
CSTB2218	3/31/2023	52	2:1	859,900	52.56%	500	-9.09%	2,100	691	28,560	28,000	25,750
CVPB2212	8/31/2023	205	2.66:1	128,700	39.47%	420	-10.64%	1,700	222	25,497	24,644	17,950
CACB2207	3/31/2023	52	4:1	353,700	36.46%	330	-13.16%	1,100	252	27,580	25,500	24,600
CVRE2218	3/1/2023	22	5:1	658,300	44.51%	410	-14.58%	1,000	412	33,538	27,888	28,550
CVHM2218	6/6/2023	119	6:1	250,700	34.41%	510	-16.39%	1,650	316	63,180	54,000	46,800
CVHM2216	8/31/2023	205	8:1	454,700	34.41%	240	-17.24%	1,900	180	70,080	62,000	46,800
CPOW2209	4/10/2023	62	4:1	498,500	44.91%	130	-18.75%	1,000	17	17,373	16,333	12,200
CHPG2225	6/6/2023	119	3:1	1,606,500	50.43%	1,360	-19.05%	1,550	1,665	20,870	17,000	19,750
CHPG2215	3/28/2023	49	10:1	2,426,700	50.43%	150	-21.05%	1,000	87	25,499	22,999	19,750
CVPB2213	3/2/2023	23	1.33:1	303,900	39.47%	260	-25.71%	2,900	108	21,327	20,315	17,950
CHPG2224	3/1/2023	22	4:1	448,400	50.43%	170	-39.29%	1,000	161	24,502	22,222	19,750

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7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+14.85%と最も上昇した。売買代金は前日比変動しなかった。CHPG2225の売買代金は最大となり、全市場の14.85%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCVRE2219、CHPG2221、CSTB2218とCVRE2215の時価が理論価格と相当している。CSTB2222、CVNM2207、CVPB2207とCHPG2225の収益性は最も高かった。CSTB2222、CHPG2225、CVNM2211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	-3.1%	1.2	2,908	4.1	2,830	16.2	2.8	49.0%	18.5%
PNJ	小売	83.1	-0.8%	0.8	1,185	1.1	6,073	13.7	3.2	49.0%	24.7%
BVH	保険	49.2	-2.8%	0.9	1,588	1.0	2,059	23.9	1.8	27.1%	7.4%
PVI	保険	50.1	1.8%	0.8	510	0.3	4,509	11.1	1.5	59.6%	10.6%
VIC	不動産	55.0	-1.8%	0.5	9,120	3.9	2,252	24.4	1.9	13.1%	8.0%
VRE	不動産	28.6	-3.2%	1.1	2,821	1.7	1,204	23.7	1.9	33.4%	8.6%
NVL	不動産	46.8	-2.4%	0.9	8,860	5.2	6,575	7.1	1.4	24.4%	21.3%
DXG	不動産	12.7	-5.9%	2.1	337	5.5	255	49.8	0.8	27.6%	1.7%
SSI	証券	19.1	-4.8%	1.7	1,233	14.8	1,456	13.1	1.3	43.2%	9.3%
VCI	証券	27.2	-0.2%	1.0	515	7.0	2,004	13.6	1.8	22.4%	13.3%
HCM	証券	23.3	-2.1%	1.7	463	4.8	1,865	12.5	1.3	46.5%	11.2%
FPT	技術	80.7	継続落。	0.8	3,849	2.6	4,838	16.7	4.2	49.0%	24.8%
FOX	技術	55.5	-3.3%	0.4	792	0.0	4,926	11.3	3.0	0.0%	30.2%
GAS	オイルとガス	106.3	0.3%	0.8	8,846	1.3	7,647	13.9	3.4	3.0%	26.7%
PLX	オイルとガス	39.0	0.5%	1.5	2,154	2.5	1,156	33.7	2.0	18.3%	6.0%
PVS	オイルとガス	23.3	-0.9%	1.3	484	4.9	1,501	15.5	0.9	19.4%	6.0%
BSR	オイルとガス	16.0	-0.6%	0.8	2,157	5.8	2,108	7.6	1.3	41.1%	19.1%
DHG	薬局	97.4	0.6%	0.3	554	0.2	7,318	13.3	3.0	54.2%	23.7%
DPM	肥料	42.7	-1.0%	1.3	726	2.2	14,039	3.0	1.2	19.1%	45.8%
DCM	肥料	26.0	-2.3%	1.4	598	2.6	7,605	3.4	1.3	11.5%	46.7%
VCB	バンク	92.0	-4.2%	0.8	18,930	4.9	6,316	14.6	3.2	23.6%	24.2%
BID	バンク	43.8	-2.7%	1.1	9,633	3.0	3,597	12.2	2.2	17.2%	19.9%
CTG	バンク	29.2	-2.3%	1.2	6,101	4.2	3,518	8.3	1.3	28.0%	16.9%
VPB	バンク	18.0	-3.0%	1.2	5,239	12.4	2,722	6.6	1.2	17.7%	20.7%
MBB	バンク	18.4	-1.9%	1.4	3,617	6.2	3,856	4.8	1.1	23.2%	25.8%
ACB	バンク	24.6	-1.2%	1.2	3,612	2.6	4,053	6.1	1.4	30.0%	26.5%
BMP	プラスチック	59.3	1.4%	0.8	211	0.4	8,505	7.0	1.9	85.2%	28.3%
NTP	プラスチック	32.8	-0.6%	0.6	185	0.0	3,701	8.9	1.5	17.8%	17.3%
MSR	天然資源	11.2	-4.3%	1.5	535	0.1	178	62.9	0.9	10.1%	1.4%
HPG	鋼	19.8	-6.6%	1.5	4,993	38.2	1,459	13.5	1.2	23.3%	9.1%
HSG	鋼	13.6	-6.9%	2.0	352	16.1	(1,776) #N/A	N/A	0.8	8.7%	-10.0%
VNM	消費者の主食	76.1	-1.7%	0.4	6,915	4.3	3,632	21.0	5.3	55.8%	24.1%
SAB	消費者の主食	191.2	-2.1%	0.8	5,331	0.2	8,006	23.9	5.3	62.6%	23.6%
MSN	消費者の主食	94.1	-2.3%	1.1	5,825	3.5	2,515	37.4	5.1	30.6%	12.1%
SBT	消費者の主食	14.6	-6.7%	1.2	426	3.5	965	15.1	1.1	12.0%	7.1%
ACV	輸送	84.8	0.4%	0.8	8,026	0.1	363	233.7	4.9	3.8%	1.3%
VJC	輸送	109.4	-0.1%	1.1	2,576	0.7	(4,010) #N/A	N/A	4.2	17.1%	-14.0%
HVN	輸送	12.7	4.1%	1.7	1,218	0.9	(4,720) #N/A	N/A	#N/A	5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	53.6	-4.6%	0.7	702	0.8	3,037	17.6	2.3	49.0%	13.8%
PVT	輸送	18.5	-3.4%	1.3	260	2.0	2,587	7.2	1.0	18.8%	14.9%
VCS	材料	51.9	-0.8%	0.8	361	0.2	6,671	7.8	1.7	3.1%	23.6%
VGC	材料	35.5	-5.0%	1.5	692	0.9	3,896	9.1	2.1	5.3%	23.7%
HT1	材料	13.0	-3.0%	1.4	216	0.5	685	19.0	1.0	2.9%	5.1%
CTD	建設	36.0	-2.7%	1.8	116	0.4	281	128.1	0.3	52.3%	0.3%
CII	建設	13.5	-2.9%	1.7	148	1.5	3,003	4.5	0.6	9.8%	14.2%
REE	電気	73.5	0.8%	-1.4	1,136	2.4	7,563	9.7	1.7	49.1%	18.7%
PC1	電気	24.9	0.0%	-0.4	293	2.1	1,664	15.0	1.3	5.3%	9.2%
POW	電気	12.2	-2.8%	0.6	1,242	5.0	809	15.1	0.9	5.7%	6.4%
NT2	電気	28.1	0.2%	0.8	352	0.8	2,457	11.4	1.8	15.8%	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
HVN	12.65	4.12	0.28	1.71MLN
GAS	106.30	c xanh dầu n:	0.14	287400.00
TPB	24.40	1.24	0.12	17.62MLN
FRT	76.10	4.25	0.09	2.86MLN
PLX	39.00	0.52	0.07	1.47MLN

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	92.00	-4.17	-4.75	1.20MLN
HPG	19.75	-6.62	-2.04	43.38MLN
BID	43.80	-2.67	-1.52	1.57MLN
VHM	46.80	-2.40	-1.26	2.54MLN
VIC	55.00	-1.79	-0.96	1.65MLN

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
TNT	3.69	6.96	0.00	271700.00
PTL	4.62	6.94	0.01	327100.00
DCL	26.30	6.91	0.03	301900.00
ST8	12.00	6.67	0.01	546200.00
ABR	12.15	6.58	0.00	1000.00

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	92.00	-4.17	-4.75	1.20MLN
HPG	19.75	-6.62	-2.04	43.38MLN
BID	43.80	-2.67	-1.52	1.57MLN
VHM	46.80	-2.40	-1.26	2.54MLN
VIC	55.00	-1.79	-0.96	1.65MLN

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
PVI	50.10	1.83	0.05	116700
DVM	13.40	8.94	0.05	408300
SJE	25.00	5.93	0.04	1000
SHN	7.90	2.60	0.04	500
CTB	21.00	8.25	0.04	100

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	37.20	-5.82	-0.87	5.65MLN
SHS	8.60	-4.44	-0.51	15.18MLN
HUT	14.20	-5.96	-0.49	1.97MLN
KSF	57.00	-2.90	-0.42	56000
CEO	21.70	-5.65	-0.41	10.12MLN

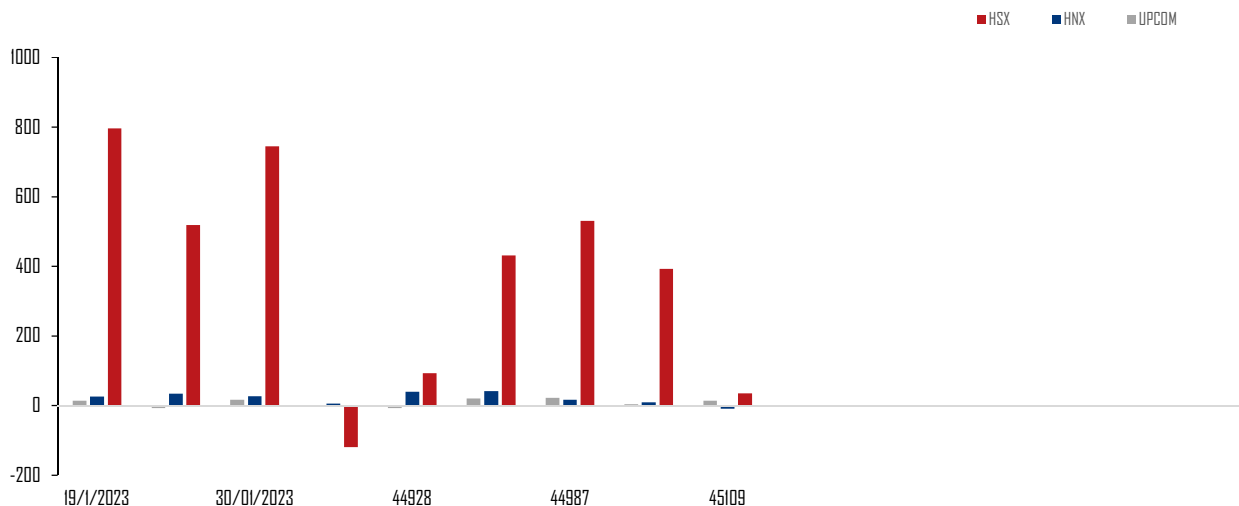
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
DVM	13.40	8.94	0.05	408300
DL1	3.90	8.33	0.03	2.53MLN
CTB	21.00	8.25	0.04	100
VE8	5.30	8.16	0.00	2100
RCL	14.50	6.62	0.01	7000

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
CAN	35.70	-9.85	-0.01	1200
TFC	6.50	-9.72	-0.01	400
HMH	12.50	-9.42	-0.02	600
BDB	10.70	-9.32	0.00	5000
ICG	5.90	-9.23	-0.01	30600

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