

2023 02 09

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8.19ポイント安の1064.03で引けた。HNXインデックスは+0.29ポイント高の210.91で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はGAS (+0.38%)、PLX (+0.23%)、GVR (+0.2%)、PVD (+0.19%)、OCB (+0.14%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVCB (-1.42%)、VHM (-1.42%)、VJC (-0.83%)、BID (-0.63%)、VIB (-0.63%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比32.4%減の6兆7,740億ドンに達した。総売買代金が9兆2,220億ドンに達した。変動幅は1.17ポイントだった。上昇には178銘柄、変わらずには73銘柄、下落には217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110億9,000万ドン、51億4,000万ドンだった。最も買われたのはS TB (2,831億ドン)、HPG (318億8,000万ドン)、HCM (260億6,000億ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間で1060~1080ポイントの範囲でもみ合った後、8.19ポイント安の1064.03で引けた。市場の広さがネガティブな状態に維持し、19業界うちの11業界が下落した。前日に大幅に上昇した業界は本日、小幅に反落した。一方、石油業界は3%以上上昇した。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インデックスは明確な傾向を見せていないことで、投資家が次の数日に慎重的に取引するべきだ。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9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 1064.03

売買代金: 6773.65 億ドン **-8.19 (-76.38%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 210.91

売買代金: 0 億ドン **0.29 (13.77%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 77.25

#VALUE! **0.82 (107.29%)**
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	78.7	0.2%
金価格	1,883	0.4%
対USD為替レート	23,565	0.0%
対EUR為替レート	25,330	0.3%
対円為替レート	17,994	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	7.43%	0.4%
国債金利 (5年間物)	4.05%	-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	283.10	BCM	-86.88
HPG	31.88	VHM	-60.72
HCM	26.06	VNM	-55.67
SSI	17.72	VIC	-38.30
HSG	8.23	MSN	-24.34

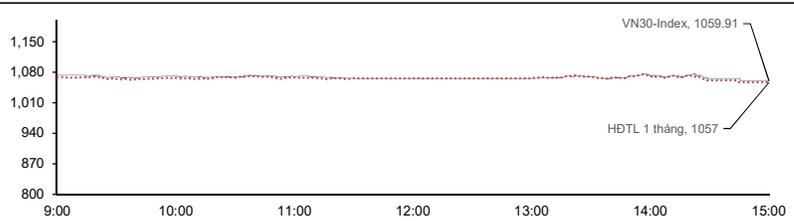
ソース：BSCリサーチ

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	1046.90	-1.48%	-13.01	39.4%	99	9/21/2023	224
VN30F2302	1057.00	-1.40%	-2.91	28.3%	371900	2/16/2023	7
VN30F2303	1055.00	-1.17%	-4.91	11.1%	2080	3/16/2023	35
VN30F2306	1048.90	-0.79%	-11.01	-57.5%	34	6/15/2023	126

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
VPB	18.00	0.28	0.25
MBB	18.45	0.27	0.13
PLX	37.90	1.88	0.09
GAS	108.10	0.75	0.08
GVR	14.95	1.36	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
VJC	101.9	0.24	-1.72
VHM	45.3	0.20	-1.48
VIB	22.0	-2.43	-1.32
TCB	27.3	-1.12	-1.31
MSN	91.8	-2.04	-1.14

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは13.47ポイント安の1059.91で引けた。変動幅は16.57ポイントだった。VJC、VHM、VIB、TCBとMSNなどの主力株が堅調で、VN30インデックスを牽引した。
- ・VN30インデックスは殆どの取引時間で前日終値のマイナス圏でもみ合った後、安値で引けた。売買代金がMA20の下にあるのは投資家の慎重な心理を示した。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、VN30F2306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
CVRE2211	3/28/2023	47	8:1	128,200	44.72%	320	6.67%	1,000	192	34,728	28,888	28,200
CHPG2215	3/28/2023	47	10:1	659,500	51.40%	170	6.25%	1,000	68	25,499	22,999	20,600
CVRE2215	3/31/2023	50	2:1	369,800	44.72%	590	1.72%	2,600	608	33,900	30,000	28,200
CMBB2213	6/6/2023	117	3:1	307,100	41.64%	990	0.00%	1,550	875	20,600	17,000	18,450
CHPG2225	6/6/2023	117	3:1	120,200	51.40%	1,480	-1.33%	1,550	1,530	20,870	17,000	20,600
CVHM2218	6/6/2023	117	6:1	181,600	34.65%	410	-2.38%	1,650	182	63,180	54,000	45,300
CVPB2212	8/31/2023	203	2.66:1	810,700	39.29%	400	-2.44%	1,700	196	25,497	24,644	18,000
CHPG2223	3/2/2023	21	2:1	322,500	51.40%	290	-3.33%	2,300	191	23,900	22,500	20,600
CVPB2213	3/2/2023	21	1.33:1	843,900	39.29%	220	-4.35%	2,900	68	21,327	20,315	18,000
CVHM2216	8/31/2023	203	8:1	298,700	34.65%	220	-4.35%	1,900	113	70,080	62,000	45,300
CMBB2211	8/31/2023	203	4:1	244,000	41.64%	160	-5.88%	1,200	107	27,920	27,000	18,450
CHPG2224	3/1/2023	20	4:1	303,100	51.40%	210	-8.70%	1,000	107	24,502	22,222	20,600
CVRE2218	3/1/2023	20	5:1	1,122,400	44.72%	350	-10.26%	1,000	274	33,538	27,888	28,200
CHPG2221	3/31/2023	50	4:1	690,200	51.40%	80	-11.11%	1,000	92	25,520	25,000	20,600
CSTB2215	3/28/2023	47	5:1	375,300	51.71%	830	-11.70%	1,100	623	25,722	22,222	24,450
CSTB2222	3/1/2023	20	4:1	765,100	51.71%	1,210	-12.32%	1,000	1,086	24,622	20,222	24,450
CACB2207	3/31/2023	50	4:1	502,200	36.36%	290	-14.71%	1,100	240	27,580	25,500	24,500
CSTB2223	3/1/2023	20	4:1	709,100	51.71%	990	-16.10%	1,000	884	24,471	21,111	24,450
CSTB2218	3/31/2023	50	2:1	1,883,700	51.71%	300	-33.33%	2,100	371	28,560	28,000	24,450
CMSN2209	3/28/2023	47	19.8:1	443,300	41.62%	120	-33.33%	1,400	35	123,325	111,413	91,800

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9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、CSTB2222は+10.72%と最も上昇した。売買代金は前日比-3.56%減少した。CSTB2222の売買代金は最大となり、全市場の10.72%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCVRE2219、CSTB2218、CMSN2214とCHPG2221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。CHPG2225、CVNM2211、CFPT2207とCFPT2212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	44.0	-1.1%	1.2	2,800	2.8	2,830	15.5	2.7	49.0%	18.5%
PNJ	小売	82.9	0.0%	0.8	1,182	1.5	6,073	13.7	3.2	49.0%	24.7%
BVH	保険	49.4	0.2%	0.9	1,593	0.3	2,059	24.0	1.8	27.2%	7.4%
PVI	保険	49.9	0.0%	0.8	508	0.0	4,509	11.1	1.5	59.6%	10.6%
VIC	不動産	54.2	-0.4%	0.5	8,988	7.0	2,252	24.1	1.8	13.1%	8.0%
VRE	不動産	28.2	-1.1%	1.1	2,786	1.5	1,204	23.4	1.9	33.4%	8.6%
NVL	不動産	45.3	-2.8%	0.9	8,576	6.2	6,575	6.9	1.4	24.3%	21.3%
DXG	不動産	12.3	-1.6%	2.1	326	2.6	255	48.2	0.8	27.6%	1.7%
SSI	証券	19.4	-0.8%	1.7	1,253	6.3	1,456	13.3	1.3	43.4%	9.3%
VCI	証券	27.2	-2.9%	1.0	515	4.3	2,004	13.6	1.8	22.5%	13.3%
HCM	証券	24.1	-0.4%	1.7	478	3.4	1,865	12.9	1.4	46.7%	11.2%
FPT	技術	80.7	反落。	0.8	3,849	2.6	4,838	16.7	4.2	49.0%	24.8%
FOX	技術	56.8	-0.2%	0.4	811	0.0	4,926	11.5	3.1	0.0%	30.2%
GAS	オイルとガス	108.1	0.7%	0.8	8,996	1.5	7,647	14.1	3.5	3.0%	26.7%
PLX	オイルとガス	37.9	1.9%	1.5	2,094	0.8	1,156	32.8	2.0	18.3%	6.0%
PVS	オイルとガス	24.4	3.4%	1.3	507	9.2	1,501	16.3	1.0	19.4%	6.0%
BSR	オイルとガス	16.6	3.1%	0.8	2,238	13.0	2,108	7.9	1.4	41.1%	19.1%
DHG	薬局	95.4	-0.8%	0.3	542	0.0	7,318	13.0	2.9	54.2%	23.7%
DPM	肥料	42.6	-1.4%	1.3	725	2.1	14,039	3.0	1.2	19.1%	45.8%
DCM	肥料	25.9	-1.5%	1.4	596	1.5	7,605	3.4	1.3	11.5%	46.7%
VCB	バンク	93.0	-1.3%	0.8	19,136	3.1	6,316	14.7	3.2	23.6%	24.2%
BID	バンク	44.0	-1.1%	1.1	9,677	2.3	3,597	12.2	2.2	17.2%	19.9%
CTG	バンク	29.4	-1.7%	1.2	6,143	3.5	3,518	8.4	1.3	28.1%	16.9%
VPB	バンク	18.0	0.3%	1.2	5,254	12.0	2,722	6.6	1.2	17.7%	20.7%
MBB	バンク	18.5	0.3%	1.4	3,637	5.1	3,856	4.8	1.1	23.2%	25.8%
ACB	バンク	24.5	-0.6%	1.2	3,598	3.5	4,053	6.0	1.4	30.0%	26.5%
BMP	プラスチック	60.8	-0.3%	0.8	216	0.3	8,505	7.1	1.9	84.9%	28.3%
NTP	プラスチック	32.3	-0.9%	0.6	182	0.0	3,701	8.7	1.5	17.8%	17.3%
MSR	天然資源	11.2	-1.8%	1.5	535	0.0	178	62.9	0.9	10.1%	1.4%
HPG	鋼	20.6	-1.2%	1.5	5,208	14.8	1,459	14.1	1.2	23.3%	9.1%
HSG	鋼	14.3	-1.4%	2.0	371	6.2	(1,776)	#N/A N/A	0.8	8.7%	-10.0%
VNM	消費者の主食	75.0	-1.1%	0.4	6,815	5.2	3,632	20.6	5.3	55.8%	24.1%
SAB	消費者の主食	193.8	-1.7%	0.8	5,403	0.4	8,006	24.2	5.4	62.6%	23.6%
MSN	消費者の主食	91.8	-1.8%	1.1	5,683	3.1	2,515	36.5	5.0	30.6%	12.1%
SBT	消費者の主食	14.6	0.0%	1.2	426	0.9	965	15.1	1.1	12.0%	7.1%
ACV	輸送	84.5	0.0%	0.8	7,998	0.0	363	232.9	4.9	3.8%	1.3%
VJC	輸送	101.9	-5.6%	1.1	2,400	1.0	(4,010)	#N/A N/A	3.9	17.2%	-14.0%
HVN	輸送	12.5	-0.8%	1.7	1,203	0.2	(4,720)	#N/A N/A #N/A N/A		5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	53.8	3.3%	0.7	705	1.2	3,037	17.7	2.3	49.0%	13.8%
PVT	輸送	19.5	2.1%	1.3	274	1.0	2,587	7.5	1.1	18.6%	14.9%
VCS	材料	53.0	1.5%	0.8	369	0.1	6,671	7.9	1.7	3.1%	23.6%
VGC	材料	35.6	-1.1%	1.5	694	0.4	3,896	9.1	2.1	5.3%	23.7%
HT1	材料	13.1	-0.8%	1.4	217	0.3	685	19.1	1.0	2.9%	5.1%
CTD	建設	36.1	0.3%	1.8	116	0.2	281	128.3	0.3	52.3%	0.3%
CII	建設	13.8	-0.7%	1.7	151	0.7	3,003	4.6	0.6	9.8%	14.2%
REE	電気	72.5	-1.4%	-1.4	1,120	0.5	7,563	9.6	1.7	49.1%	18.7%
PC1	電気	25.3	0.4%	-0.4	297	1.4	1,664	15.2	1.3	5.5%	9.2%
POW	電気	12.0	-2.0%	0.6	1,222	2.0	809	14.8	0.9	5.7%	6.4%
NT2	電気	28.0	-0.4%	0.8	350	0.3	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
GAS	108.10	0.75	0.38	314600.00
PLX	37.90	1.88	0.23	454900.00
GVR	14.95	1.36	0.20	1.33MLN
PVD	20.85	6.92	0.19	6.24MLN
OCB	18.50	2.21	0.14	373000.00

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
VCB	93.00	-1.27	-1.42	759400.00
VHM	45.30	-2.79	-1.42	3.12MLN
VJC	101.90	-5.65	-0.83	217800.00
BID	44.00	-1.12	-0.63	1.18MLN
VIB	22.00	-5.17	-0.63	1.77MLN

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
CMX	9.52	6.97	0.02	4.79MLN
DAT	9.99	6.96	0.01	5400.00
ANV	33.05	6.96	0.07	2.51MLN
TSC	4.00	6.95	0.01	3.93MLN
BBC	61.70	6.93	0.02	1400.00

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	93.00	-1.27	-1.42	759400
VHM	45.30	-2.79	-1.42	3.12MLN
VJC	101.90	-5.65	-0.83	217800
BID	44.00	-1.12	-0.63	1.18MLN
VIB	22.00	-5.17	-0.63	1.77MLN

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
PVS	24.40	3.39	0.31	8.71MLN
TNG	16.30	7.24	0.12	5.01MLN
HUT	14.30	1.42	0.11	920200
IDC	37.60	0.53	0.08	1.66MLN
PLC	27.00	5.47	0.05	656400

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
THD	39.60	-1.00	-0.23	12100
CEO	21.40	-2.28	-0.16	3.52MLN
SHS	8.60	-1.15	-0.13	6.10MLN
NVB	19.50	-0.51	-0.08	5500
VC3	28.40	-2.07	-0.05	298500

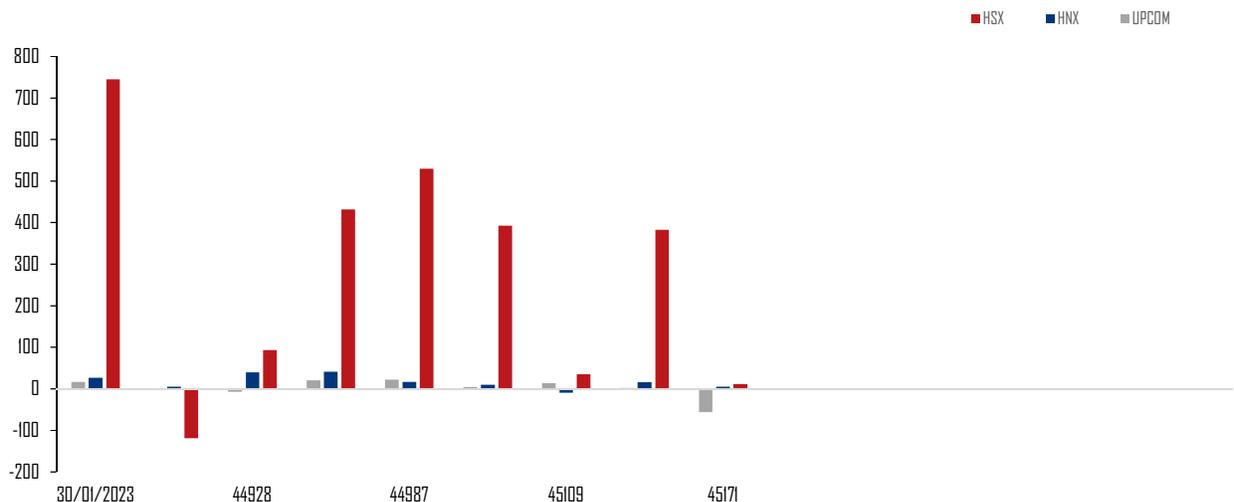
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
BPC	11.00	10.00	0.00	100
CTB	20.90	10.00	0.04	1200
VSA	24.20	10.00	0.01	1900
SDN	48.50	9.98	0.00	3800
CAN	43.10	9.95	0.01	1000

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
SGH	57.60	-9.86	-0.03	100
BTS	6.50	-9.72	-0.01	156300
GDW	25.10	-9.71	-0.01	500
SJ1	13.20	-9.59	-0.02	2200
QST	10.00	-9.09	0.00	100

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

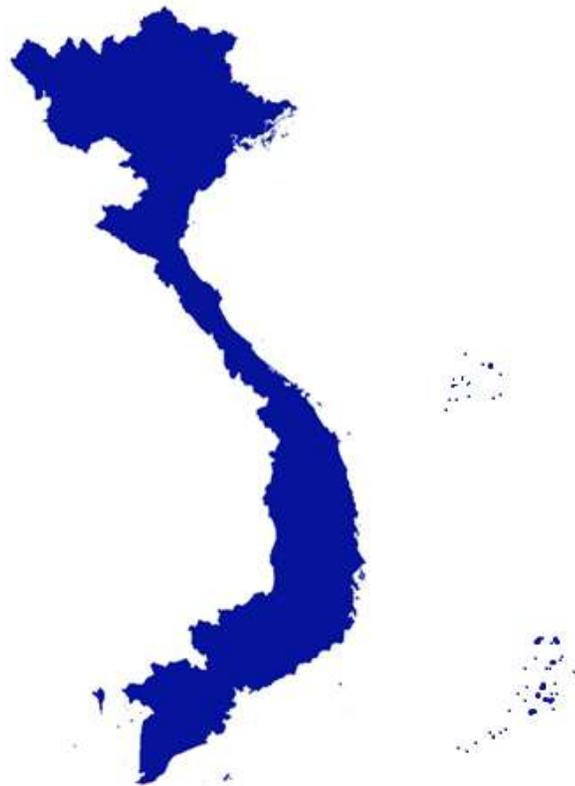
Thai Holding Tower, 8th & 9th Floor
210 Tran Quang Khai – Hoan Kiem – Hanoi
Tel: +84 4 3935 2722
Fax: +84 4 2220 0669

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