

2023 02 14

Vietnam Daily Review

VNインデックス4日続落。

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-5.06ポイント安の1038.64で引けた。HNXインデックスは+0.37ポイント高の204.86で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はHPG (+0.58%)、EIB (+0.23%)、TCB (+0.22%)、TPB (+0.2%)、BCM (+0.18%)だった。
- ・主に下落した銘柄はVHM (-1.8%)、BID (-1.27%)、VCB (-1.19%)、SAB (-0.63%)、CTG (-0.54%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比38.45%減の5兆4,890億ドンに達した。総売買代金が6兆7,230億ドンに達した。変動幅は13.88ポイントだった。上昇には221銘柄、変わらずには70銘柄、下落には175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、557億5,000万ドン、151億6,000万ドンだった。最も買われたのはHPG (960億8,000万ドン)、KBC (217億3,000万ドン)、VND (188億7,000万ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で引けた後、1045ポイントに上昇すると、マイナス圏に転落した。後場に入ると、売りに勢いが強まったことで、下げ幅を拡大し0.48%安の1038.64で引けた。19業界うちの12業界が上昇し、基本的なりソース業界が大幅に上昇した。一方、最も下落率は不動産業界（約1%安）だった。VNインデックスは次の数日にサポート線1030ポイントをテストする可能性がある。投資家は次の数日に慎重的に取引するべきだ。VNインデックスは今晚（2月14日）に発表される1月米消費者物価指数（CPI）という情報に対して反応する可能性がある。

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2月14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 1038.64

売買代金: 5488.93 億ドン **-5.06 (-0.48%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

HNX-INDEX 204.86

売買代金: 0 億ドン **0.37 (0.18%)**
外国人投資家の売買代金（買い越し・売り越し） 億ドン

UPCOM-INDEX 77.94

#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	79.2	-1.2%
金価格	1,860	0.3%
対USD為替レート	23,601	0.0%
対EUR為替レート	25,345	0.6%
対円為替レート	17,871	0.0%
銀行間金利（1か月物）	6.79%	0.2%
国債金利（5年間物）	3.80%	-0.2%

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	96.08	VIC	-43.30
KBC	21.73	STB	-40.38
VND	18.87	VHM	-35.50
HSG	14.49	DXG	-22.05
MSN	11.70	DGC	-17.26

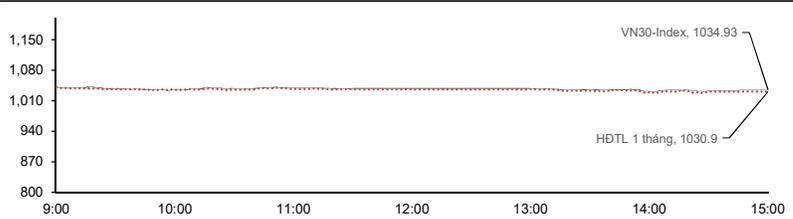
ソース：BSCリサーチ

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	1018.00	-0.71%	-16.93	-46.6%	39	9/21/2023	221
VN30F2302	1030.90	-0.74%	-4.03	-4.4%	276784	2/16/2023	4
VN30F2303	1025.20	-0.85%	-9.73	35.8%	9526	3/16/2023	32
VN30F2306	1021.30	-0.74%	-13.63	14.8%	70	6/15/2023	123

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
HPG	20.60	1.98	1.34
TCB	26.85	0.94	0.60
TPB	23.50	2.17	0.50
SSI	18.90	2.16	0.44
VIB	20.50	1.49	0.33

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
VHM	42.8	0.12	-1.87
VPB	16.7	1.28	-1.47
NVL	12.0	1.24	-0.95
HDB	17.7	0.84	-0.74
VCB	92.5	1.07	-0.54

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは5.47ポイント安の1034.93で引けた。変動幅は12.45ポイントだった。VHM、VPB、NVL、HDBとVCB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インデックスは殆どの取引時間で赤い色を染まれた。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、VN30F2302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、VN30F2302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
CHPG2223	3/2/2023	16	2:1	656,300	51.09%	190	46.15%	2,300	137	23,080	22,500	20,600
CSTB2218	3/31/2023	45	2:1	331,200	51.10%	280	12.00%	2,100	314	28,600	28,000	24,400
CHPG2225	6/6/2023	112	3:1	213,400	51.09%	1,480	8.82%	1,550	1,513	21,440	17,000	20,600
CHPG2226	9/5/2023	203	2:1	128,000	51.09%	2,160	8.54%	2,300	1,923	23,980	19,500	20,600
CSTB2223	3/1/2023	15	4:1	129,600	51.10%	860	7.50%	1,000	853	25,071	21,111	24,400
CHPG2227	11/1/2023	260	2:1	64,700	51.09%	2,190	7.35%	2,400	1,927	25,020	-	20,600
CSTB2222	3/1/2023	15	4:1	175,600	51.10%	1,050	7.14%	1,000	1,062	25,062	20,222	24,400
CVRE2215	3/31/2023	45	2:1	188,800	44.31%	380	5.56%	2,600	513	31,180	30,000	28,000
CSTB2215	3/28/2023	42	5:1	749,600	51.10%	720	4.35%	1,100	595	26,372	22,222	24,400
CSTB2225	11/1/2023	260	2:1	80,800	51.10%	3,490	3.87%	2,900	3,244	28,280	20,500	24,400
CFPT2210	8/31/2023	198	10:1	169,000	28.99%	620	1.64%	2,350	423	96,700	90,000	80,800
CSTB2224	9/5/2023	203	2:1	126,700	51.10%	3,250	1.25%	2,700	3,156	27,200	20,000	24,400
CMBB2213	6/6/2023	112	3:1	387,500	41.24%	850	1.19%	1,550	722	19,970	17,000	17,850
CFPT2213	9/5/2023	203	10:1	65,000	28.99%	1,460	0.00%	1,800	1,148	89,600	74,500	80,800
CVPB2212	8/31/2023	198	2.66:1	228,300	39.02%	300	0.00%	1,700	105	25,710	24,644	16,700
CVRE2216	8/31/2023	198	4:1	129,100	44.31%	570	-1.72%	1,650	692	33,880	31,000	28,000
CVPB2214	9/5/2023	203	4:1	216,000	39.02%	810	-4.71%	1,100	496	20,880	17,000	16,700
CVRE2218	3/1/2023	15	5:1	575,500	44.31%	200	-4.76%	1,000	217	29,638	27,888	28,000
CVHM2218	6/6/2023	112	6:1	377,400	34.88%	330	-8.33%	1,650	95	56,460	54,000	42,750
CVHM2220	11/1/2023	260	5:1	129,100	34.88%	680	-10.53%	3,000	276	62,450	58,000	42,750

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14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、CSTB2215は+10.98%と最も上昇した。売買代金は前日比-42.69%減少した。CSTB2215の売買代金は最大となり、全市場の10.98%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCSTB2215、CVNM2207、CVRE2211とCTPB2204の時価が理論価格と相当している。CHDB2208、CVNM2207、CSTB2215とCMSN2212の収益性は最も高かった。CSTB2224、CSTB2225、CVNM2211とCHPG2225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	42.5	0.0%	1.2	2,704	1.5	2,830	15.0	2.6	49.0%	18.5%
PNJ	小売	82.1	-1.7%	0.8	1,171	0.9	6,073	13.5	3.1	49.0%	24.7%
BVH	保険	49.1	1.2%	1.0	1,585	0.4	2,059	23.8	1.8	27.2%	7.4%
PVI	保険	49.8	1.6%	0.8	507	0.1	4,509	11.0	1.5	59.6%	10.6%
VIC	不動産	52.9	-0.9%	0.5	8,772	7.1	2,252	23.5	1.8	12.9%	8.0%
VRE	不動産	28.0	-1.8%	1.1	2,766	1.7	1,204	23.3	1.9	32.6%	8.6%
NVL	不動産	42.8	-3.7%	0.9	8,093	7.2	6,575	6.5	1.3	24.3%	21.3%
DXG	不動産	10.3	-5.1%	2.1	272	4.9	255	40.2	0.7	27.1%	1.7%
SSI	証券	18.9	2.2%	1.7	1,224	5.0	1,456	13.0	1.3	43.5%	9.3%
VCI	証券	25.4	1.4%	1.0	480	2.7	2,004	12.7	1.7	22.5%	13.3%
HCM	証券	22.8	0.4%	1.7	453	1.6	1,865	12.2	1.3	47.0%	11.2%
FPT	技術	80.8	日続落。	0.8	3,854	2.2	4,838	16.7	4.2	49.0%	24.8%
FOX	技術	55.5	0.0%	0.4	792	0.0	4,926	11.3	3.0	0.0%	30.2%
GAS	オイルとガス	105.6	-0.3%	0.7	8,788	0.5	7,647	13.8	3.4	3.0%	26.7%
PLX	オイルとガス	38.0	0.3%	1.5	2,099	0.3	1,156	32.9	2.0	18.0%	6.0%
PVS	オイルとガス	24.4	0.4%	1.3	507	3.8	1,501	16.3	1.0	19.5%	6.0%
BSR	オイルとガス	15.6	-1.3%	0.8	2,103	3.4	2,108	7.4	1.3	41.1%	19.1%
DHG	薬局	98.5	0.5%	0.3	560	0.0	7,318	13.5	3.0	54.3%	23.7%
DPM	肥料	42.6	0.1%	1.3	725	2.2	14,039	3.0	1.2	19.1%	45.8%
DCM	肥料	25.2	1.0%	1.4	579	0.9	7,605	3.3	1.3	11.4%	46.7%
VCB	バンク	92.5	-1.1%	0.8	19,033	4.6	6,316	14.6	3.2	23.6%	24.2%
BID	バンク	43.4	-2.3%	1.0	9,545	2.5	3,597	12.1	2.2	17.2%	19.9%
CTG	バンク	28.7	-1.5%	1.2	5,997	2.2	3,518	8.2	1.3	28.1%	16.9%
VPB	バンク	16.7	-1.8%	1.2	4,874	12.4	2,722	6.1	1.2	17.6%	20.7%
MBB	バンク	17.9	-0.8%	1.4	3,519	5.2	3,856	4.6	1.1	23.2%	25.8%
ACB	バンク	23.9	-0.2%	1.1	3,502	1.5	4,053	5.9	1.4	30.0%	26.5%
BMP	プラスチック	62.0	4.7%	0.7	221	0.3	8,505	7.3	1.9	84.8%	28.3%
NTP	プラスチック	31.7	-0.6%	0.6	179	0.0	3,701	8.6	1.5	17.8%	17.3%
MSR	天然資源	11.1	0.9%	1.5	530	0.0	178	62.4	0.9	10.1%	1.4%
HPG	鋼	20.6	2.0%	1.6	5,208	15.4	1,459	14.1	1.2	23.5%	9.1%
HSG	鋼	14.9	3.1%	2.1	386	10.1	(1,776) #N/A	N/A	0.9	8.5%	-10.0%
VNM	消費者の主食	74.7	-0.8%	0.4	6,788	3.5	3,632	20.6	5.2	55.8%	24.1%
SAB	消費者の主食	188.0	-2.0%	0.8	5,242	0.4	8,006	23.5	5.2	62.7%	23.6%
MSN	消費者の主食	92.9	0.0%	1.1	5,751	1.6	2,515	36.9	5.1	30.6%	12.1%
SBT	消費者の主食	14.2	1.4%	1.2	416	0.8	965	14.7	1.1	12.0%	7.1%
ACV	輸送	84.4	-0.1%	0.8	7,988	0.1	363	232.6	4.9	3.8%	1.3%
VJC	輸送	102.8	-0.3%	1.1	2,421	0.8	(4,010) #N/A	N/A	3.9	17.2%	-14.0%
HVN	輸送	11.8	1.3%	1.7	1,136	0.3	(4,720) #N/A	N/A	#N/A	5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	51.7	-0.6%	0.7	677	0.5	3,037	17.0	2.2	48.9%	13.8%
PVT	輸送	19.3	4.1%	1.3	271	0.8	2,587	7.4	1.0	18.4%	14.9%
VCS	材料	50.0	0.2%	0.8	348	0.1	6,671	7.5	1.6	3.1%	23.6%
VGC	材料	32.9	1.1%	1.5	641	0.5	3,896	8.4	1.9	5.4%	23.7%
HT1	材料	14.1	-1.7%	1.5	233	0.6	685	20.5	1.0	2.9%	5.1%
CTD	建設	33.5	1.5%	1.8	108	0.3	281	119.2	0.3	49.2%	0.3%
CII	建設	12.7	0.4%	1.8	139	1.0	3,003	4.2	0.6	8.6%	14.2%
REE	電気	70.3	-0.3%	-1.4	1,086	0.4	7,563	9.3	1.6	49.0%	18.7%
PC1	電気	24.4	-0.4%	-0.4	287	1.4	1,664	14.7	1.3	5.7%	9.2%
POW	電気	11.9	1.3%	0.6	1,207	1.8	809	14.6	0.9	5.8%	6.4%
NT2	電気	28.8	-1.5%	0.8	360	0.5	2,457	11.7	1.9	16.0%	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	20.60	1.98	0.58	17.29MLN
EIB	22.10	3.51	0.23	1.79MLN
TCB	26.85	0.94	0.22	2.95MLN
TPB	23.50	2.17	0.20	2.69MLN
BCM	84.50	0.84	0.18	80100.00

VNインデックス4日続落。

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
VHM	42.75	-3.72	-1.80	3.88MLN
BID	43.40	-2.25	-1.27	1.33MLN
VCB	92.50	-1.07	-1.19	1.14MLN
SAB	188.00	-2.03	-0.63	51400.00
CTG	28.70	-1.54	-0.54	1.75MLN

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
BTT	34.40	7.00	0.01	200.00
APG	6.28	6.98	0.02	3.46MLN
PDN	144.50	6.96	0.04	300.00
HOT	18.75	6.84	0.00	300.00
SII	14.85	6.83	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
VHM	42.75	-3.72	-1.80	3.88MLN
BID	43.40	-2.25	-1.27	1.33MLN
VCB	92.50	-1.07	-1.19	1.14MLN
SAB	188.00	-2.03	-0.63	51400.00
CTG	28.70	-1.54	-0.54	1.75MLN

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
IDC	38.60	2.66	0.38	2.03MLN
SHS	8.10	1.25	0.13	5.86MLN
CEO	19.70	1.55	0.10	4.23MLN
TIG	8.30	3.75	0.05	1.17MLN
VIT	21.00	6.60	0.05	23700

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
BAB	13.30	-1.48	-0.24	3100
THD	38.20	-1.04	-0.23	51800
KSF	51.50	-0.77	-0.10	18800
NVB	18.90	-0.53	-0.08	37900
SHN	8.20	-4.65	-0.08	1000

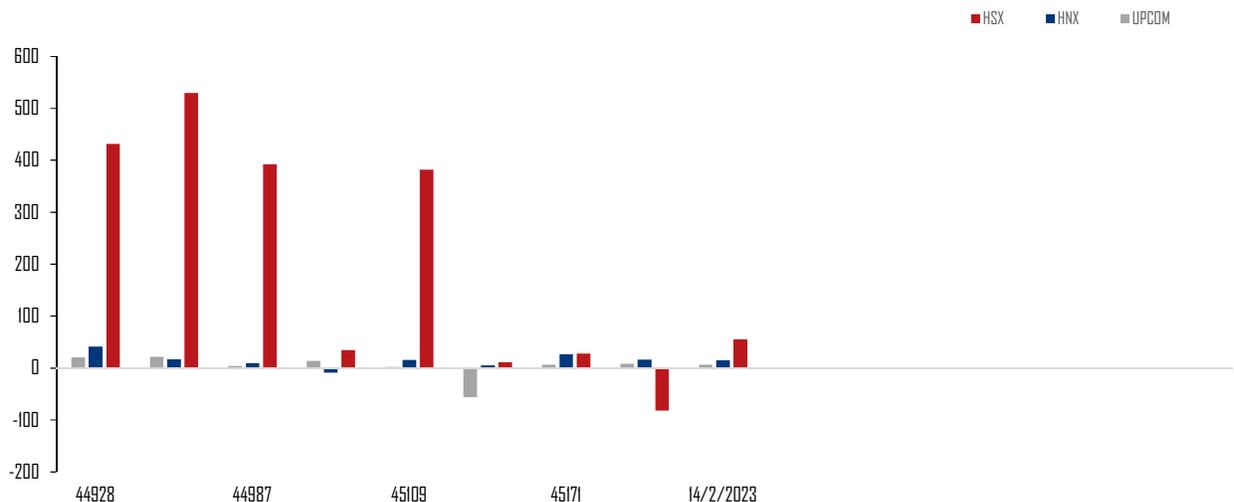
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
PIA	25.40	9.96	0.01	100
PRC	44.50	9.88	0.00	4100
SEB	53.20	9.69	0.04	400
POT	15.90	9.66	0.01	1600
HMR	8.00	9.59	0.00	6900

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
HAT	18.90	-10.00	0.00	200
SGC	64.80	-10.00	-0.02	1800
VTH	7.20	-10.00	0.00	500
TJC	17.60	-9.74	-0.01	1000
KKC	6.50	-9.72	0.00	1000

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