

20230302

Vietnam Daily Review

VNインデックス3日ぶり小幅反落。

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-2.94ポイント安の1037.61で引けた。HNXインデックスは-0.69ポイント安の206.14で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はBID (+0.95%)、VCB (+0.24%)、PNJ (+0.22%)、POW (+0.21%)、HDB (+0.19%)だった。
- ・主に下落した銘柄はSAB (-0.71%)、CTG (-0.54%)、MSN (-0.54%)、HPG (-0.44%)、VRE (-0.35%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比27.96%減の5兆1,440億ドンに達した。総売買代金が6兆3,630億ドンに達した。変動幅は10.73ポイントだった。上昇には150銘柄、変わらずには62銘柄、下落には235銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場での売越額は1,209億6,000万ドンだった。最も売られたのはVHM (346億1,000万ドン)、VCB (280億ドン)、MSN (227億1,000万ドン) だった。一方、HNX市場での買越額は17億ドンだった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間で抵抗線1040ポイントのマイナス圏でもみ合った後、2.94ポイント安の1037.61で引けた。市場の広さがポジ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、自動車・部品業界、基本的なリソース業界、小売り業界などは前日大幅に上昇したが、本日利益確定売りが強まった。外国人投資家の動向について、外国人投資家はHSX市場で引き続き売り越したが、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1040ポイントの周りでバランス点を設立し続ける可能性がある。

先物取引契約：先物取引契約は証券市場と共に下落した。投資家は次の数日に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3月2日には、カバードワラント市場は指定銘柄と共にみ合った。

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 1037.61

売買代金: 5143.63 億ドン **-2.94 (-0.28%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 206.14

売買代金: 0 億ドン **-0.69 (-0.33%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 76.28

#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	77.5	-0.2%
金価格	1,832	-0.3%
対USD為替レート	23,737	0.0%
対EUR為替レート	25,223	-0.5%
対円為替レート	17,384	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	7.05%	0.3%
国債金利 (5年間物)	4.10%	-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
STB	28.12	VHM	-34.61
NKG	22.64	VCB	-28.00
BID	19.84	MSN	-22.71
HDB	16.19	VRE	-21.54
VNM	15.59	PVD	-20.67

ソース：BSCリサーチ

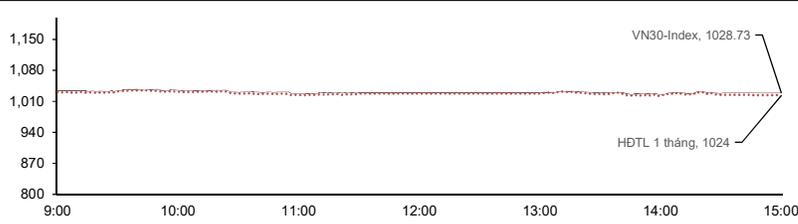
市場概要 A	ページ1
テクニク分析	ページ2
デリバティブ市場	ページ2
推奨ポートフォリオ	ページ3
大型株	ページ4
市場統計	ページ5
最新レポート	ページ6

先物取引契約

Le Quoc Trung
trunglq@bsc.com.vn

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	1020.50	-0.56%	-8.23	-44.2%	72	9/21/2023	203
VN30F2304	0.00		-1028.73		0	2/16/2023	0
VN30F2303	1024.00	-0.78%	-4.73	-17.3%	336940	3/16/2023	14
VN30F2306	1018.50	-1.02%	-10.23	-49.1%	86	6/15/2023	105

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の上昇幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
HDB	18.00	1.69	0.55
STB	25.60	0.79	0.39
POW	12.70	2.83	0.21
BID	46.40	1.64	0.16
NVL	10.35	0.98	0.11

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
MSN	79.0	0.22	-1.00
HPG	20.6	0.19	-1.00
VPB	17.3	0.96	-0.74
MBB	17.4	0.10	-0.65
MWG	40.3	0.00	-0.57

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは5.7ポイント安の1028.73で引けた。変動幅は12.6ポイントだった。MSN、HPG、VPB、MBBとMWG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。売買代金がMA20の下にある。投資家は日中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上昇した。売買高を見ると、全ての先物取引契約が減少した。売買高を見ると、VN30F2304の以外、他の先物取引契約が減少した。

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
CTCB2215	9/5/2023	187	4:1	51,500	44.33%	1,270	14.41%	1,700	1,008	32,180	26,500	27,200
CPOW2210	6/6/2023	96	1:1	67,100	43.54%	900	7.14%	1,870	1,054	13,980	13,000	12,700
CSTB2218	3/31/2023	29	2:1	732,800	51.05%	170	6.25%	2,100	326	28,600	28,000	25,600
CSTB2215	3/28/2023	26	5:1	493,500	51.05%	770	5.48%	1,100	732	26,372	22,222	25,600
CACB2207	3/31/2023	29	4:1	435,200	35.81%	250	4.17%	1,100	212	26,660	25,500	25,050
CHPG2226	9/5/2023	187	2:1	25,900	51.40%	2,150	2.38%	2,300	1,862	23,980	19,500	20,600
CSTB2225	11/1/2023	244	2:1	158,000	51.05%	3,890	1.83%	2,900	3,644	28,280	20,500	25,600
CMBB2215	11/1/2023	244	2:1	82,200	40.93%	1,500	0.67%	2,500	1,148	22,080	18,000	17,400
CVHM2219	9/5/2023	187	5:1	226,300	35.76%	410	0.00%	2,800	158	59,750	56,000	41,100
CMBB2213	6/6/2023	96	3:1	81,700	40.93%	810	-1.22%	1,550	579	19,970	17,000	17,400
CHPG2225	6/6/2023	96	3:1	309,900	51.40%	1,410	-1.40%	1,550	1,468	21,440	17,000	20,600
CFPT2210	8/31/2023	182	10:1	206,300	26.70%	560	-1.75%	2,350	312	96,700	90,000	80,000
CVHM2220	11/1/2023	244	5:1	223,700	35.76%	510	-1.92%	3,000	203	62,450	58,000	41,100
CHPG2227	11/1/2023	244	2:1	455,900	51.40%	2,140	-2.28%	2,400	1,875	25,020	-	20,600
CVPB2214	9/5/2023	187	4:1	205,400	38.77%	790	-2.47%	1,100	558	20,880	17,000	17,300
CVRE2216	8/31/2023	182	4:1	363,000	45.33%	430	-10.42%	1,650	477	33,880	31,000	26,200
CVRE2219	6/6/2023	96	3:1	311,600	45.33%	390	-11.36%	1,050	491	31,040	29,000	26,200
CMWG2213	6/6/2023	96	6:1	690,400	46.57%	190	-13.64%	2,760	105	56,520	54,000	40,300
CHPG2221	3/31/2023	29	4:1	4,004,400	51.40%	30	-40.00%	1,000	36	25,320	25,000	20,600
CVRE2215	3/31/2023	29	2:1	1,892,200	45.33%	90	-43.75%	2,600	140	31,180	30,000	26,200

ノート: * 理論的な価格は式Black-Scholes公式に基づき計算されます

非リスク金利 4.75%

** 転換率

評価:

- ・2023年3月2日には、カワードワラント市場は証券市場と共にみ合った。
- ・価格については、CHPG2227は+20.12%と最も上昇した。売買代金は前日比32.27%減少した。CHPG2227の売買代金は最大となり、全市場の20.12%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCSTB2215、CVNM2207、CTPB2204とCVNM2209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	40.3	-1.2%	1.3	2,564	1.5	2,830	14.2	2.5	49.0%	18.5%
PNJ	小売	80.3	3.5%	0.8	1,145	1.0	6,073	13.2	3.1	49.0%	24.7%
BVH	保険	49.0	-0.9%	1.0	1,581	0.3	2,059	23.8	1.8	27.3%	7.4%
PVI	保険	50.4	0.2%	0.8	513	0.0	4,509	11.2	1.6	59.6%	10.6%
VIC	不動産	52.8	0.2%	0.5	8,755	1.8	2,252	23.4	1.8	12.7%	8.0%
VRE	不動産	26.2	-2.2%	1.1	2,588	2.3	1,204	21.8	1.8	32.5%	8.6%
NVL	不動産	41.1	-0.2%	0.9	7,781	3.5	6,575	6.3	1.2	24.0%	21.3%
DXG	不動産	10.2	-1.5%	2.1	269	4.0	255	39.8	0.7	22.3%	1.7%
SSI	証券	18.7	-1.6%	1.7	1,207	4.4	1,456	12.8	1.2	#VALUE!	9.3%
VCI	証券	26.9	-1.6%	1.0	509	2.3	2,004	13.4	1.8	22.7%	13.3%
HCM	証券	23.5	-2.1%	1.7	467	2.9	1,865	12.6	1.4	47.2%	11.2%
FPT	技術	80.0	反落。	0.8	3,816	1.5	4,838	16.5	4.2	49.0%	24.8%
FOX	技術	56.0	-1.8%	0.4	799	0.0	4,926	11.4	3.1	0.0%	30.2%
GAS	オイルとガス	105.0	-0.1%	0.7	8,738	0.5	7,647	13.7	3.4	3.0%	26.7%
PLX	オイルとガス	38.7	0.0%	1.5	2,135	0.6	1,156	33.4	2.0	18.0%	6.0%
PVS	オイルとガス	26.7	-1.1%	1.3	555	4.4	1,501	17.8	1.1	20.1%	6.0%
BSR	オイルとガス	16.1	-0.6%	0.8	2,170	2.1	2,108	7.6	1.3	41.1%	19.1%
DHG	薬局	97.2	-1.3%	0.3	553	0.0	7,318	13.3	3.0	54.3%	23.7%
DPM	肥料	34.9	0.0%	1.3	593	1.4	14,039	2.5	1.0	18.5%	45.8%
DCM	肥料	24.0	1.7%	1.4	552	1.6	7,702	3.1	1.2	10.2%	45.2%
VCB	バンク	93.2	0.2%	0.8	19,177	4.0	6,316	14.8	3.2	23.6%	24.2%
BID	バンク	46.4	1.6%	1.0	10,205	2.0	3,597	12.9	2.4	17.2%	19.9%
CTG	バンク	27.8	-1.6%	1.2	5,809	2.2	3,518	7.9	1.2	28.0%	16.9%
VPB	バンク	17.3	-0.9%	1.2	5,049	3.2	2,722	6.4	1.2	17.6%	20.7%
MBB	バンク	17.4	-1.4%	1.4	3,430	2.9	3,856	4.5	1.0	23.2%	25.8%
ACB	バンク	25.1	-0.4%	1.1	3,678	3.7	4,053	6.2	1.4	30.0%	26.5%
BMP	プラスチック	60.8	-0.7%	0.7	216	0.0	8,505	7.1	1.9	85.4%	28.3%
NTP	プラスチック	32.0	0.6%	0.6	180	0.0	3,701	8.6	1.5	17.8%	17.3%
MSR	天然資源	11.2	0.0%	1.5	535	0.0	178	62.9	0.9	10.1%	1.4%
HPG	鋼	20.6	-1.4%	1.6	5,208	8.0	1,459	14.1	1.2	23.5%	9.1%
HSG	鋼	15.5	-0.3%	2.1	403	8.2	(1,776)	#N/A N/A	0.9	9.6%	-10.0%
VNM	消費者の主食	76.5	-0.5%	0.5	6,951	3.6	3,632	21.1	5.4	55.8%	24.1%
SAB	消費者の主食	188.1	-1.8%	0.8	5,245	0.3	8,006	23.5	5.2	62.6%	23.6%
MSN	消費者の主食	79.0	-1.9%	1.1	4,890	1.9	2,515	31.4	4.3	30.6%	12.1%
SBT	消費者の主食	15.2	2.7%	1.2	445	2.4	965	15.8	1.1	#VALUE!	7.0%
ACV	輸送	83.8	-0.2%	0.8	7,932	0.0	363	231.0	4.9	3.8%	1.3%
VJC	輸送	101.6	0.1%	1.1	2,393	1.3	(4,010)	#N/A N/A	3.9	17.3%	-14.0%
HVN	輸送	12.2	-1.6%	1.7	1,170	0.3	(4,720)	#N/A N/A #N/A N/A		5.9%	#VALUE!
GMD	輸送	50.3	-0.4%	0.7	659	0.6	3,037	16.6	2.2	48.8%	13.8%
PVT	輸送	21.1	1.7%	1.3	296	3.8	2,587	8.1	1.1	18.5%	14.9%
VCS	材料	50.7	0.6%	0.8	353	0.0	6,671	7.6	1.7	3.1%	23.6%
VGC	材料	34.2	-2.4%	1.5	666	0.3	3,896	8.8	2.0	5.3%	23.7%
HT1	材料	14.5	-1.0%	1.4	240	0.3	685	21.1	1.1	3.1%	5.1%
CTD	建設	35.1	-1.5%	1.8	113	0.4	281	124.8	0.3	49.2%	0.3%
CII	建設	13.3	-1.1%	1.8	145	0.7	3,003	4.4	0.6	8.6%	14.2%
REE	電気	68.7	1.0%	-1.4	1,062	0.3	7,563	9.1	1.6	49.0%	18.7%
PC1	電気	27.8	-2.6%	-0.4	326	2.5	1,664	16.7	1.5	6.5%	9.2%
POW	電気	12.7	2.8%	0.6	1,293	12.5	809	15.7	1.0	6.1%	6.4%
NT2	電気	30.8	5.3%	0.8	386	2.7	2,457	12.5	2.0	16.4%	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
BID	46.40	1.64	0.95	976200.00
VCB	93.20	0.22	0.24	984700.00
PNJ	80.30	3.48	0.22	296800.00
POW	12.70	2.83	0.21	22.74MLN
HDB	18.00	1.69	0.19	1.84MLN

VNインデックス3日ぶり小幅反落。

VNX指数マイナス寄与上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対に貢献したポイント	売買高
SAB	188.10	-2.29	-0.71	38300.00
CTG	27.80	-1.59	-0.54	1.83MLN
MSN	79.00	-1.86	-0.54	540200.00
HPG	20.60	-1.44	-0.44	8.87MLN
VRE	26.20	-2.24	-0.35	1.98MLN

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
LM8	10.55	7.00	0.00	300.00
HAS	7.07	6.96	0.00	2800.00
OGC	8.78	6.94	0.04	1.46MLN
IBC	2.70	6.72	0.00	858500.00
CVT	37.95	6.30	0.02	800.00

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
SAB	188.10	-2.29	-0.71	38300
CTG	27.80	-1.59	-0.54	1.83MLN
MSN	79.00	-1.86	-0.54	540200
HPG	20.60	-1.44	-0.44	8.87MLN
VRE	26.20	-2.24	-0.35	1.98MLN

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
HUT	15.60	5.41	0.44	3.27MLN
NVB	16.70	3.09	0.41	22300
DNP	24.50	5.15	0.18	6200
BAB	14.60	0.69	0.12	118200
SCG	66.30	1.07	0.07	147000

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
KSF	42.00	-6.46	-0.71	16200
IDC	38.90	-2.26	-0.34	1.48MLN
SHS	8.30	-2.35	-0.25	3.77MLN
PVS	26.70	-1.11	-0.12	3.81MLN
THD	39.10	-0.51	-0.12	7500

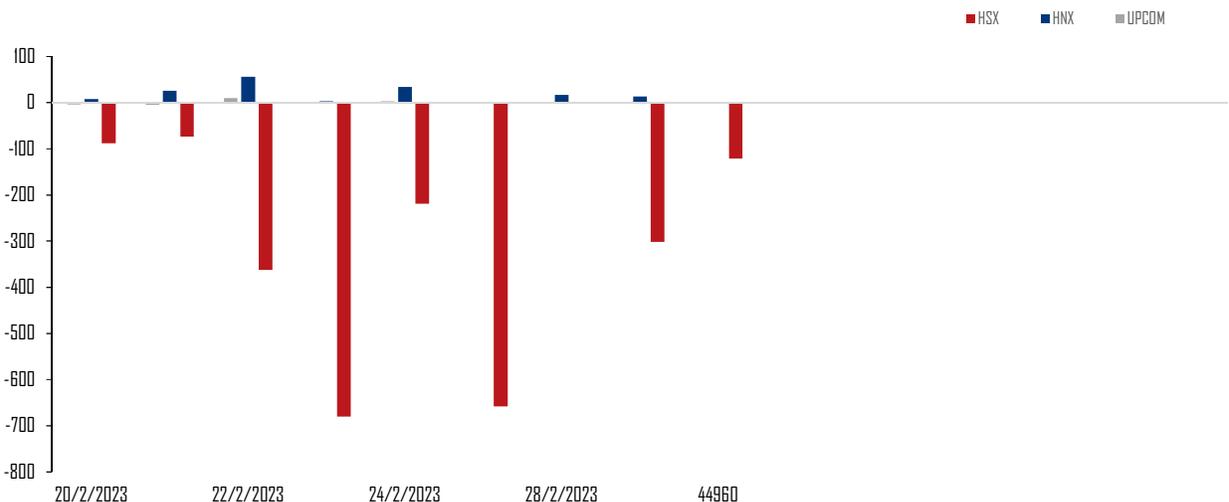
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対に貢献したポイント	売買高
DP3	111.10	10.00	0.06	3000
VIG	5.50	10.00	0.03	760800
VBC	20.00	9.89	0.00	200
PRC	56.80	9.86	0.01	9300
SDG	15.70	9.79	0.00	900

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
LBE	16.20	-10.00	0.00	11300
PCE	24.30	-10.00	-0.01	100
DNM	19.00	-9.95	-0.01	200
PIA	25.20	-9.68	-0.01	100
ALT	14.40	-9.43	-0.01	3700

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