

2023 04 12

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-0.01ポイント安の1069.45で引けた。HNXインデックスは-0.4ポイント安の211.94で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はMSN (+0.57%)、NVL (+0.42%)、SHB (+0.35%)、TCB (+0.26%)、KDH (+0.24%)だった。
- ・主に下落した銘柄はSAB (-0.64%)、VPB (-0.59%)、VIC (-0.48%)、VJC (-0.35%)、SSI (-0.23%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比+8.56%増の11兆2,380ドンに達した。総売買代金が11兆5,910億ドンに達した。変動幅は6.27ポイントだった。上昇には190銘柄、変わらずには70銘柄、下落には188銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場及びHNX市場での売越額はそれぞれ、3,417億6,000万ドン、621億4,000万ドンだった。最も売られたのはCTG (993億9,000万ドン)、FUEVFVND (412億7,000万ドン)、KBC (365億1,000万ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは高値で寄り付いた後、1070ポイントの周りでもみ合った。市場の広さがバランスを取る状態に留まり、19業界うちの12業界が上昇した。そのうち、最も上昇率は電力・水道・ガス業界及び化学業界だった。外国人投資家はHSX市場及びHNX市場で売り越した。VNインデックスは次の数日に1060~1080ポイントの範囲でもみ合う可能性がある。

先物取引契約：VN30F2304の以外、他の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4月12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。

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 **1069.45**売買代金: 11238.48 億ドン **-0.01 (0%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン**HNX-INDEX** **211.94**売買代金: 0 億ドン **-0.4 (-0.19%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン**UPCOM-INDEX** **79.15**#VALUE! **0.34 (0.43%)**
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	81.6	0.1%
金価格	2,011	0.4%
対USD為替レート	23,448	0.0%
対EUR為替レート	25,619	0.1%
対円為替レート	17,531	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	5.41%	0.3%
国債金利 (5年間物)	3.06%	0.0%

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
HDB	31.93	CTG	-99.39
VHM	21.29	FUEVFVN	-41.27
PNJ	19.68	KBC	-36.51
HDG	12.09	HPG	-27.99
NLG	11.40	SSI	-26.12

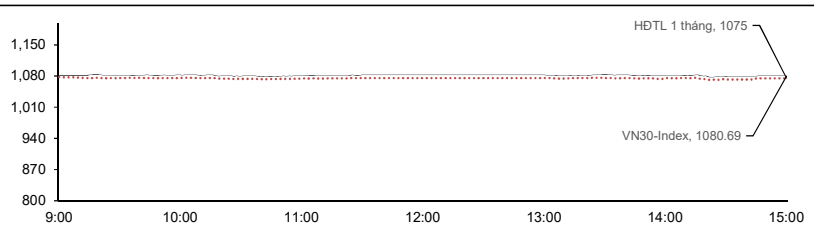
ソース：BSCリサーチ

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
VN30F2304	1075.00	-0.09%	-5.69	-15.9%	187416	4/20/2023	10
VN30F2305	1071.40	0.07%	-9.29	-14.3%	1015	5/18/2023	38
VN30F2306	1069.90	-0.11%	-10.79	-40.0%	57	6/15/2023	66
VN30F2309	1066.00	-0.19%	-14.69	-33.9%	72	9/21/2023	164

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
MSN	79.50	2.05	1.07
NVL	15.05	5.99	0.95
TCB	30.70	0.99	0.72
STB	26.10	0.58	0.30
VIB	21.30	0.95	0.22

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	20.7	4.81	-1.72
VJC	99.7	0.51	-0.74
SSI	22.0	1.87	-0.66
VIC	53.1	0.19	-0.50
VRE	28.7	0.12	-0.33

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは - 1.02ポイント安の1080.69で引けた。変動幅は6.4ポイントだった。VPB、VJC、SSI、VICとVRE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一進一退でもみ合った後、終盤に売りに勢いが強まったことで、高値で引けた。売買代金はMA20の上にある。投資家は次の数日に先物取引契約を慎重的に取引する
- ・VN30F2304の以外、他の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、VN30F2305の以外、他の先物取引契約が減少した。先物取引契約数を見ると、全て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
CMSN2215	9/5/2023	146	10:1	1,123,400	39.99%	410	10.81%	2,600	217	108,400	102,000	79,500
CPOW2210	6/6/2023	55	5:1	262,700	39.36%	1,030	7.29%	1,870	244	13,920	13,000	13,650
CTCB2215	9/5/2023	146	4:1	104,900	43.19%	1,780	5.33%	1,700	1,489	31,020	26,500	30,700
CMWG2215	11/1/2023	203	6:1	430,700	44.73%	680	4.62%	1,300	699	51,500	45,000	40,750
CMWG2214	9/5/2023	146	10:1	258,100	44.73%	470	4.44%	1,100	277	50,700	46,500	40,750
CSTB2303	11/9/2023	211	4:1	322,000	49.63%	2,890	2.48%	4,500	1,594	27,620	22,000	26,100
CHPG2227	11/1/2023	203	3:1	117,400	49.39%	2,040	2.00%	2,400	1,128	24,500	20,500	20,750
CSTB2224	9/5/2023	146	1:1	81,500	49.63%	3,750	1.90%	2,700	7,157	26,380	20,000	26,100
CSTB2225	11/1/2023	203	5:1	298,800	49.63%	3,890	1.57%	2,900	1,456	27,180	20,500	26,100
CSTB2301	7/17/2023	96	2:1	72,700	49.63%	1,550	1.31%	2,500	1,320	31,080	26,400	26,100
CMBB2213	6/6/2023	55	3:1	135,200	39.32%	790	1.28%	1,550	736	19,280	17,000	18,700
CTCB2214	6/6/2023	55	2:1	185,300	43.19%	1,290	0.00%	2,470	2,215	29,160	27,000	30,700
CMWG2302	11/9/2023	211	10:1	557,000	44.73%	340	0.00%	1,350	288	53,060	50,000	40,750
CHPG2225	6/6/2023	55	2:1	77,500	49.39%	1,440	0.00%	1,550	2,055	21,290	17,000	20,750
CVHM2216	8/31/2023	141	16:1	419,800	38.94%	260	0.00%	1,900	124	63,280	62,000	51,600
CHPG2306	11/9/2023	211	8:1	595,900	49.39%	1,050	-0.94%	1,380	460	23,510	20,000	20,750
CFPT2212	6/6/2023	55	10:1	110,300	24.41%	1,120	-1.75%	1,870	1,096	81,200	70,000	80,300
CVPB2214	9/5/2023	146	15.7:1	216,300	38.73%	1,330	-3.62%	1,100	283	21,480	17,000	20,650
CVRE2219	6/6/2023	55	1.33:1	341,100	44.32%	490	-9.26%	1,050	1,417	30,470	29,000	28,700
CVRE2216	8/31/2023	141	2.66:1	254,300	44.32%	510	-10.53%	1,650	919	33,240	31,000	28,700

ノート: * 理論的な価格は式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4月12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、CSTB2225は+16.09%と最も上昇した。売買代金は前日比+19.02%増加した。CSTB2225の売買代金は最大となり、全市場の16.09%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCVNM2211、CVRE2219、CSTB2224とCVRE2216の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CVPB2214とCVPB2301の収益性は最も高かった。CSTB2224、CVNM2211、CHPG2225とCTCB2214の益回り率は最も高かった。

BSC30 Portfolio

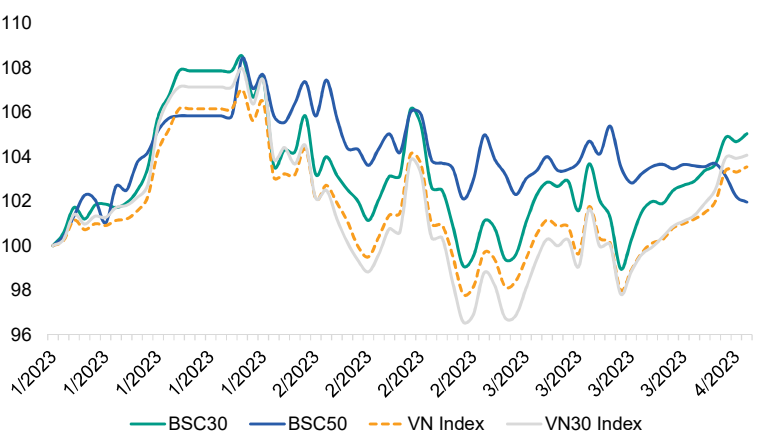
銘柄	業界	終値(1千 VND)	変動率%	Beta	時価総額(100万USD)	売買代金(100万USD)	EPS fw (VND)	P/E fw	目標価格(VND/株)	外国人保有率	レポートのリンク
VCB	銀行	88.3	0.1%	0.9	18,169	2.0	7,311	12.1	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	44.4	0.0%	1.0	9,765	1.5	4,208	10.6	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	29.5	-0.3%	1.2	6,164	1.8	-	-	-	28.1%	Link
VPB	銀行	20.7	-1.7%	1.2	6,027	7.8	-	-	-	17.6%	Link
ACB	銀行	24.9	小幅反落。	1.1	3,649	3.5	4,640	5.4	26,000	30.0%	Link
MBB	銀行	18.7	-0.3%	1.1	3,686	6.5	4,603	4.1	24,600	23.2%	Link
STB	銀行	26.1	0.6%	1.3	2,139	23.1	4,880	5.3	31,200	29.2%	Link
SSI	証券	22.0	-2.7%	1.7	1,434	16.5	N/A	-	-	42.8%	Link
GVR	工業団地区不動産	16.4	0.6%	1.9	2,843	3.6	1,217	13.4	19,100	0.5%	Link
HPG	建設用材料	20.8	-0.2%	1.0	5,246	9.6	1,916	10.8	25,000	23.4%	Link
HSG	建設用材料	15.6	-1.6%	2.1	404	5.7	1,896	8.2	18,500	10.6%	Link
VHM	有働さん	51.6	0.2%	0.9	9,769	4.6	5,227	9.9	68,300	23.9%	Link
VRE	不動産	28.7	-1.2%	0.4	2,835	3.5	1,576	18.2	31,800	32.5%	Link
NLG	不動産	32.0	6.8%	1.5	534	7.1	2,557	12.5	38,700	44.9%	Link
DPM	肥料	34.8	0.1%	1.5	591	2.8	14,120	2.5	42,000	18.4%	Link
GAS	石油・ガス	99.8	-0.1%	0.8	8,305	1.2	6,793	14.7	122,300	3.0%	Link
PLX	石油・ガス	37.0	0.1%	0.8	2,044	0.9	2,625	14.1	42,000	18.1%	Link
BSR	石油・ガス	16.6	0.0%	1.6	2,238	4.2	2,292	7.2	18,400	41.1%	Link
PVS	石油・ガス	26.1	0.0%	1.3	542	4.5	1,340	19.5	31,100	20.4%	Link
PVT	石油・ガス	21.8	-0.5%	1.3	307	2.7	2,929	7.4	24,300	18.3%	Link
POW	イリティ	13.7	1.9%	1.2	1,390	10.1	993	13.7	13,000	6.3%	Link
REE	イリティ	69.8	1.5%	0.8	1,079	1.6	7,698	9.1	85,000	49.0%	Link
VNM	消費財	74.3	-0.1%	0.4	6,751	3.2	3,895	19.1	87,600	55.8%	Link
MSN	省資材	79.5	2.1%	1.2	4,921	5.5	2,605	30.5	96,000	30.6%	Link
MWG	小売	40.8	0.1%	1.3	2,593	7.1	3,456	11.8	55,200	49.0%	Link
PNJ	小売	77.9	-0.9%	0.7	1,111	2.1	7,475	10.4	95,000	49.0%	Link
FRT	小売	65.0	-0.8%	1.4	335	2.0	2,965	21.9	77,100	29.0%	Link
VHC	水産	56.5	-0.5%	1.2	450	0.9	12,800	4.4	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	53.0	0.0%	0.7	694	0.9	7,059	7.5	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	80.3	0.0%	0.8	3,830	2.0	5,901	13.6	91,900	49.0%	Link

BSC30 ポートフォリオには、ホーチミン証券取引所 (HOSE)、ハノイ証券取引所 (HNX)及びUpcom市場での最大の時価総額及び最大売買代金を持つ30社が含まれている。BSC30の中に企業は銀行、証券、消費財、小売、テクノロジー、製造、物流、電力、不動産などの多くの重要な経済セクターを代表しています。BSC30ポートフォリオは安定的な運営活動、堅調な財務、効果的な管理、強い競争性という基準に基づく、BSCの専門家により評価され、選択されております。BSC30ポートフォリオは毎四半期アップデートされる。投資家はBSC30 ポートフォリオを参考し、投資することを検討すべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	0.0%	-1.3%	0.0%	-0.1%
1 tuần	-1.7%	-1.6%	-1.1%	-0.8%
1 tháng	0.4%	-3.0%	1.6%	2.9%
3 tháng	1.2%	-3.9%	2.5%	3.9%

BSC30とBSC50の効率



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
MSN	79.50	2.05	0.57	1.60MLN
NVL	15.05	5.99	0.42	51.45MLN
SHB	12.20	3.83	0.35	41.55MLN
TCB	30.70	0.99	0.26	4.51MLN
KDH	29.85	4.74	0.24	3.63MLN

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
SAB	171.00	-2.29	-0.64	336000.00
VPB	20.65	-1.67	-0.59	8.67MLN
VIC	53.10	-0.93	-0.48	3.65MLN
VJC	99.70	-2.54	-0.35	232300.00
SSI	22.00	-2.65	-0.23	17.02MLN

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
HDC	34.75	6.92	0.06	3.17MLN
GIL	23.30	6.88	0.03	1.80MLN
NLG	32.00	6.84	0.20	5.19MLN
HHP	10.10	6.77	0.01	1.49MLN
D2D	26.90	6.75	0.01	365000.00

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
SAB	171.00	-2.29	-0.64	336000
VPB	20.65	-1.67	-0.59	8.67MLN
VIC	53.10	-0.93	-0.48	3.65MLN
VJC	99.70	-2.54	-0.35	232300
SSI	22.00	-2.65	-0.23	17.02MLN

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
SHN	8.10	8.00	0.12	100
IDJ	12.80	3.23	0.09	4.58MLN
NVB	15.00	0.67	0.08	31411
IDC	39.30	0.51	0.08	2.46MLN
PGS	26.70	4.71	0.06	2243

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
DDG	30.80	-9.94	-0.28	8312
HUT	16.70	-1.76	-0.16	4.66MLN
SHS	10.50	-0.94	-0.13	35.84MLN
THD	39.00	-0.51	-0.12	7800
PTI	31.00	-6.06	-0.08	1082

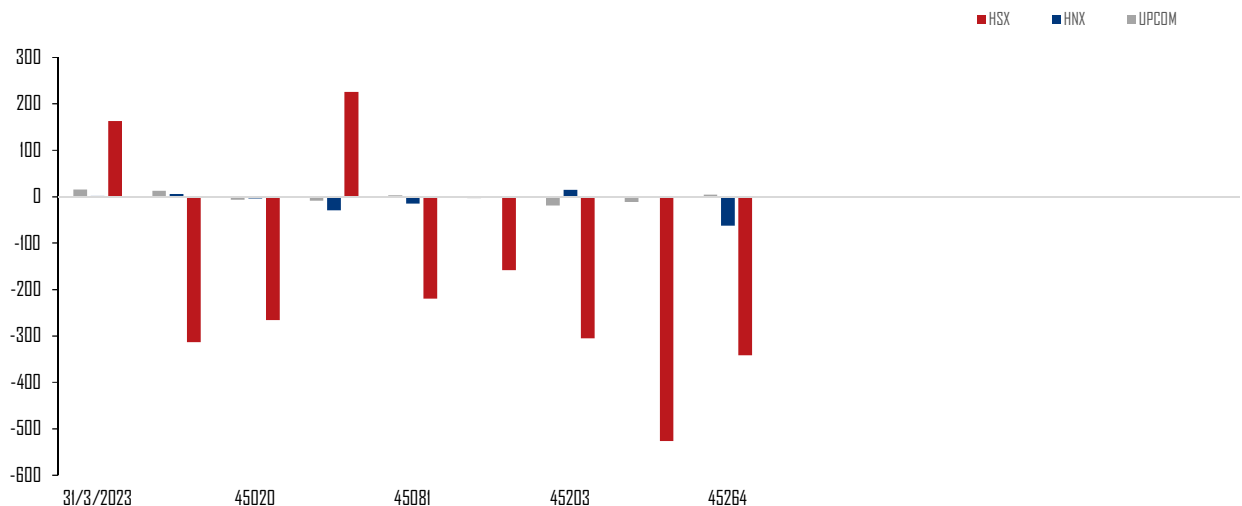
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	日に貢献したポイント	売買高
HAT	27.50	10.00	0.00	1600
PVL	2.20	10.00	0.02	1.11MLN
SGC	68.20	10.00	0.02	100
AMC	22.60	9.71	0.01	100
CTT	13.80	9.52	0.00	158

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
NHC	29.70	-10.00	-0.01	100
DDG	30.80	-9.94	-0.28	8312
VSM	20.00	-9.91	0.00	200
PCE	24.80	-9.82	-0.01	2102
HCT	13.80	-9.80	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