

2023 04 24

Vietnam Daily Review

VNインデックス小幅続落。

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-1.55ポイント安の1041.36で引けた。HNXインデックスは-0.16ポイント安の206.76で引けた。
- ・最も上昇した銘柄はTCB (+0.71%)、VCB (+0.47%)、CTG (+0.36%)、MBB (+0.23%)、NVL (+0.22%)だった。
- ・主に下落した銘柄はMSN (-1.11%)、GAS (-1.1%)、BID (-0.63%)、MWG (-0.33%)、VNM (-0.21%)だった。
- ・本日のVNインデックスの売買代金は前日比-18.73%減の7兆1,830ドンに達した。総売買代金が9兆1,430億ドンに達した。変動幅は8.82ポイントだった。上昇には171銘柄、変わらずには68銘柄、下落には205銘柄だった。
- ・外国人投資家の動向について、HSX市場及びHNXでの買越額はそれぞれ、2,594億7,000万ドン、7億2,000万ドンだった。最も買われたのはMSB (3,651億3,000万ドン)、HPG (1,202億9,000万ドン)、VPB (197億2,000万ドン) だった。

推奨戦略

VNインデックスは殆どの取引時間で1040~1050ポイントの範囲でもみ合った後、-1.55ポイント安の1041.36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13業界が下落した。そのうち、最も下落率は自動車・部品業界、小売り業界だった。一方、医療業界は大幅に上昇した。国家銀行は困難に直面している企業をサポートする為に、信用機関に債務返済期限を再構成させ、債務グループを維持することに関する第02/2023/TT-NHNN通達を交付した。このポジティブな情報のおかげで、不動産業界、銀行業界は小幅に上昇した。VNインデックスは次の数日にサポート線1040ポイントをテストする可能性がある。

先物取引契約：先物取引契約は証券市場と共に上昇した。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24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 1041.36

売買代金: 7183.37 億ドン **-1.55 (-0.15%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

HNX-INDEX 206.76

売買代金: 0 億ドン **-0.16 (-0.08%)**
外国人投資家の売買代金 (買い越し・売り越し) 億ドン

UPCOM-INDEX 77.90

#VALUE! **-0.09 (-0.12%)**
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	77.7	-0.3%
金価格	1,983	0.0%
対USD為替レート	23,490	0.0%
対EUR為替レート	25,777	-0.2%
対円為替レート	17,507	0.0%
銀行間金利 (1か月物)	5.05%	0.5%
国債金利 (5年間物)	3.03%	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
MSB	365.13	MSN	-31.04
HPG	120.29	SSI	-28.44
VPB	19.72	VNM	-24.74
VCB	14.89	STB	-22.54
SAB	8.87	VRE	-19.33

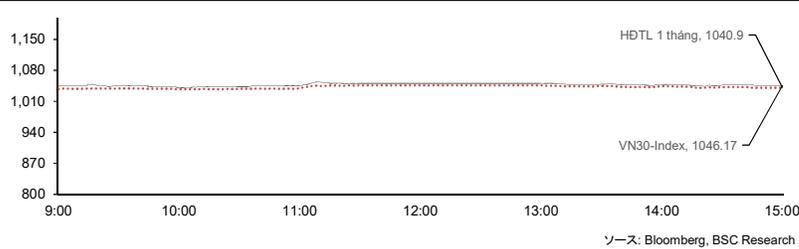
ソース：BSCリサーチ

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



契約名	契約値	増減(日)	差	%	売買高	満期日	日数
VN30F2312	1033.90	0.04%	-12.27	-50.0%	38	12/21/2023	243
VN30F2305	1040.90	0.09%	-5.27	26.5%	205169	5/18/2023	26
VN30F2306	1039.00	0.06%	-7.17	114.8%	771	6/15/2023	54
VN30F2309	1037.00	0.03%	-9.17	-42.5%	42	9/21/2023	152

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
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
0/1/1900	0.00	0.00	0.00
TCB	29.50	2.79	1.91

ソース: Bloomberg, BSC Research

VN30の下落幅上位の銘柄

銘柄	価格	±増・減(%)	Index pt
VIB	20.3	1.11	0.17
0/1/1900	0.0	3.31	0.00
0/1/1900	0.0	1.33	0.00
0/1/1900	0.0	0.26	0.00
MSN	73.3	0.90	-2.07

ソース: Bloomberg, BSC Research

評価:

- ・VN30インデックスは - 0.01ポイント安の1046.17で引けた。変動幅は12.54ポイントだった。MSN、MWG、VNM、GASとFPT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もみ合った後、前日終値付近で引けた。売買代金はMA20の下にある。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、VN30F2312とVN30F2309の以外、他の先物取引契約が増加した。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
CTCB2214	6/6/2023	43	2:1	116,500	43.54%	950	18.75%	2,470	1,644	29,160	27,000	29,500
CVHM2218	6/6/2023	43	16:1	382,700	38.67%	220	10.00%	1,650	87	55,140	54,000	50,500
CVRE2216	8/31/2023	129	2.66:1	403,600	43.44%	420	5.00%	1,650	747	33,240	31,000	28,150
CVPB2214	9/5/2023	134	15.7:1	103,100	38.74%	1,100	3.77%	1,100	218	21,480	17,000	19,500
CVPB2212	8/31/2023	129	15.2:1	275,800	38.74%	310	3.33%	1,700	30	25,523	24,644	19,500
CVRE2301	7/17/2023	84	8:1	130,100	43.44%	1,050	1.94%	1,900	226	35,260	29,700	28,150
CVHM2216	8/31/2023	129	16:1	983,000	38.67%	200	0.00%	1,900	92	63,280	62,000	50,500
CFPT2212	6/6/2023	43	10:1	177,300	24.28%	1,010	0.00%	1,870	962	81,200	70,000	79,100
CVPB2302	8/16/2023	114	5.89:1	61,500	38.74%	2,010	-0.99%	2,400	388	23,140	18,600	19,500
CSTB2225	11/1/2023	191	5:1	43,800	49.18%	3,630	-1.09%	2,900	1,343	27,180	20,500	25,550
CACB2208	9/5/2023	134	4:1	166,100	35.42%	1,180	-1.67%	1,400	957	26,660	21,500	24,200
CSTB2224	9/5/2023	134	1:1	126,400	49.18%	3,470	-2.25%	2,700	6,569	26,380	20,000	25,550
CSTB2303	11/9/2023	199	4:1	332,800	49.18%	2,830	-2.41%	4,500	1,456	27,620	22,000	25,550
CHPG2306	11/9/2023	199	8:1	818,500	48.63%	990	-2.94%	1,380	435	23,510	20,000	20,650
CMWG2302	11/9/2023	199	10:1	1,146,800	44.90%	300	-3.23%	1,350	197	53,060	50,000	38,400
CHPG2225	6/6/2023	43	2:1	295,400	48.63%	1,280	-4.48%	1,550	1,951	21,290	17,000	20,650
CVHM2220	11/1/2023	191	8:1	178,100	38.67%	1,080	-10.00%	3,000	425	62,000	58,000	50,500
CMWG2215	11/1/2023	191	6:1	1,433,400	44.90%	500	-10.71%	1,300	500	51,500	45,000	38,400
CMWG2214	9/5/2023	134	10:1	778,600	44.90%	330	-13.16%	1,100	176	50,700	46,500	38,400
CMSN2215	9/5/2023	134	10:1	611,100	39.94%	260	-21.21%	2,600	92	108,400	102,000	73,300

ノート: * 理論的な価格は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4月24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、CSTB2303は+13.28%と最も上昇した。売買代金は前日比+98.64%増加した。CSTB2303の売買代金は最大となり、全市場の13.28%を占めた。
- ・カワードワラント銘柄はCMSN2214、CVNM2211、CVRE2219とCSTB2224の時価が理論価格と相当している。CSTB2224、CSTB2225、CHPG2302、và CVPB2214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

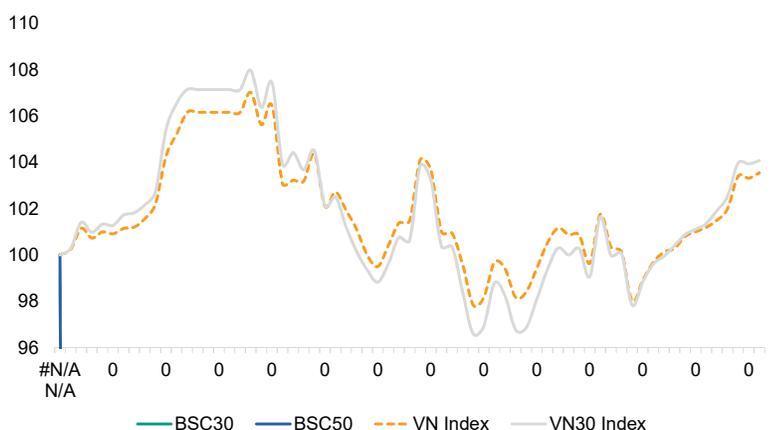
銘柄	業界	終値(1千 VND)	変動率%	Beta	時価総額(100万USD)	売買代金(100万USD)	EPS fw (VND)	P/E fw	目標価格(VND/株)	外国人保有率	レポートのリンク
VCB	銀行	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	7,311	#N/A	105,000	23.6%	Link
BID	銀行	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	4,208	#N/A	54,578	17.3%	Link
CTG	銀行	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	-			28.1%	Link
VPB	銀行	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	-			17.6%	Link
ACB	銀行	#N/A	小幅続落。	#N/A	#N/A	#N/A	4,640	#N/A	26,000	30.0%	Link
MBB	銀行	#N/A	#N/A	1.1	#N/A	#N/A	4,603	#N/A	24,600	23.2%	Link
STB	銀行	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	4,880	#N/A	31,200	29.2%	Link
SSI	証券	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	N/A			42.8%	Link
GVR	工業団地区不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	1,217	#N/A	19,100	0.5%	Link
HPG	建設用材料	#N/A	#N/A	1.0	#N/A	#N/A	1,916	#N/A	25,000	23.4%	Link
HSG	建設用材料	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	1,896	#N/A	18,500	10.6%	Link
VHM	有働さん	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	5,227	#N/A	68,300	23.9%	Link
VRE	不動産	#N/A	#N/A	0.4	#N/A	#N/A	1,576	#N/A	31,800	32.5%	Link
NLG	不動産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	2,557	#N/A	38,700	44.9%	Link
DPM	肥料	#N/A	#N/A	1.5	#N/A	#N/A	14,120	#N/A	42,000	18.4%	Link
GAS	石油・ガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	6,793	#N/A	122,300	3.0%	Link
PLX	石油・ガス	#N/A	#N/A	0.8	#N/A	#N/A	2,625	#N/A	42,000	18.1%	Link
BSR	石油・ガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	2,292	#N/A	18,400	41.1%	Link
PVS	石油・ガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	1,340	#N/A	31,100	20.4%	Link
PVT	石油・ガス	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	2,929	#N/A	24,300	18.3%	Link
POW	イリティ	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	993	#N/A	13,000	6.3%	Link
REE	イリティ	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	7,698	#N/A	85,000	49.0%	Link
VNM	消費財	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	3,895	#N/A	87,600	55.8%	Link
MSN	省資材	#N/A	#N/A	1.2	#N/A	#N/A	2,605	#N/A	96,000	30.6%	Link
MWG	小売	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	3,456	#N/A	55,200	49.0%	Link
PNJ	小売	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	7,475	#N/A	95,000	49.0%	Link
FRT	小売	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	2,965	#N/A	77,100	29.0%	Link
VHC	水産	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	12,800	#N/A	67,500	30.5%	Link
GMD	ロジスティック	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	7,059	#N/A	57,000	48.8%	Link
FPT	IT	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	#N/A	5,901	#N/A	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の中には企業は銀行、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るべきだ。

指数の効率

	BSC30	BSC50	VN Index	VN30 Index
1 ngày	#DIV/0!	#DIV/0!	0.1%	0.0%
1 tuần	#DIV/0!	#DIV/0!	-1.4%	-1.6%
1 tháng	#DIV/0!	#DIV/0!	0.9%	1.6%
3 tháng	#DIV/0!	#DIV/0!	-0.4%	1.0%

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
TCB	29.50	2.79	0.71	3.48MLN
VCB	87.90	0.46	0.47	505800.00
CTG	28.90	1.05	0.36	2.65MLN
MBB	18.25	1.11	0.23	5.30MLN
NVL	14.05	3.31	0.22	22.01MLN

VNインデックス小幅続落。

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
MSN	73.30	-4.06	-1.11	1.59MLN
GAS	93.10	-2.41	-1.10	563800.00
BID	43.70	-1.13	-0.63	462900.00
MWG	38.40	-2.29	-0.33	3.21MLN
VNM	70.50	-0.56	-0.21	1.13MLN

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
LSS	10.75	6.97	0.01	1.75MLN
TV2	25.35	6.96	0.03	926700.00
NAF	12.30	6.96	0.01	338100.00
CTD	58.80	6.91	0.08	920000.00
BCG	8.21	6.90	0.07	12.18MLN

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
MSN	73.30	-4.06	-1.11	1.59MLN
GAS	93.10	-2.41	-1.10	563800
BID	43.70	-1.13	-0.63	462900
MWG	38.40	-2.29	-0.33	3.21MLN
VNM	70.50	-0.56	-0.21	1.13MLN

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
KSF	40.80	2.00	0.20	23400
IDJ	12.40	3.33	0.09	3.43MLN
SCG	65.70	1.39	0.09	122600
DHT	44.20	6.51	0.08	116900
THD	39.30	0.26	0.06	5200

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
BAB	13.60	-2.86	-0.48	16900
DDG	13.50	-10.00	-0.13	33900
NVB	13.80	-0.72	-0.08	72700
IDC	38.20	-0.52	-0.08	801300
NTP	34.00	-2.58	-0.06	53100

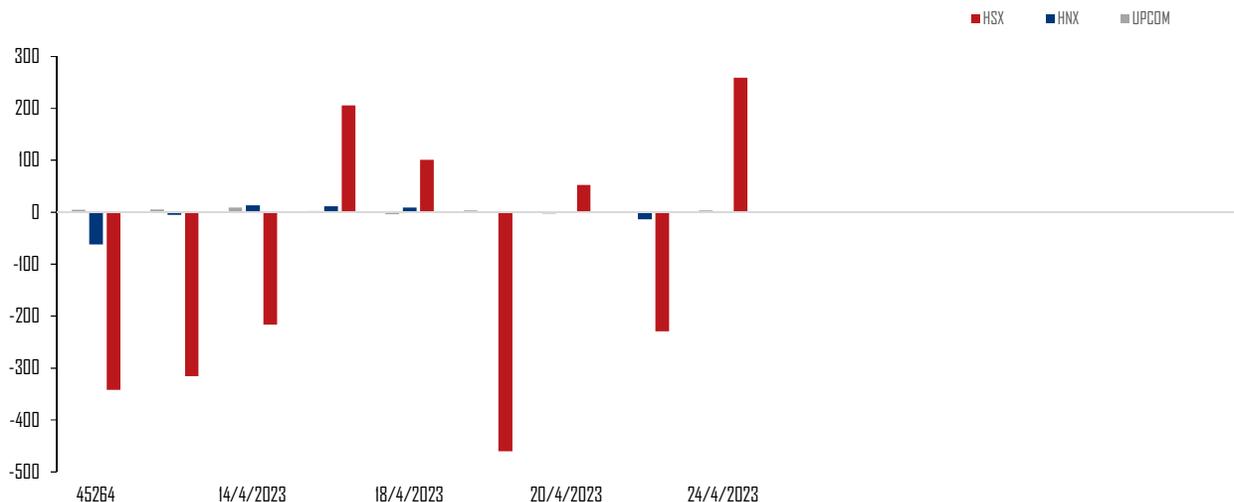
HNXの上昇率上位5銘柄

銘柄	株価	変動率	対に貢献したポイント	売買高
VLA	57.60	9.92	0.01	300
BTW	26.70	9.88	0.01	100
HTC	20.50	9.63	0.02	1400
KTS	24.70	8.81	0.01	24000
PSI	7.00	7.69	0.02	297100

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
CLM	63.00	-10.00	-0.05	26000
DDG	13.50	-10.00	-0.13	33900
CAN	33.30	-9.76	-0.01	3200
SGD	21.30	-9.75	-0.01	100
BST	17.60	-9.74	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