کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

هفته نامه تحلیلی
کارگزاری تامین سرمایه نوین

هفته منتهی به ۱۸ مرداد - شماره ۱۱۱

تهیه و تنظیم: واحد تحلیل کارگزاری تامین سرمایه نوین

کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

خدمات شرکت کارگزاری تامین سرمایه نوین

- ارائه خدمات مربوط به بورس اوراق بهادار، بورس کالا و بورس انرژی
- تامین مالی شرکت‌های بورسی و غیربورسی در حوزه‌های سرمایه در گردش، طرح های توسعه‌ای و راه اندازی پروژه‌ها با استفاده از ابزارهای‌نوین‌تامین‌مالی
- مشاوره برای عرضه و پذیرش شرکت‌ها و انجام فرایند پذیرش شرکت‌ها در بازار سرمایه
- برگزاری دوره‌های آموزشی تخصصی و همایش‌های عمومی بازار سرمایه، تحت مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار
- انجام معاملات در بورس انرژی در سه بازار فیزیکی، مشتقه، آتی
- انجام معاملات در بورس کالا در گروه‌های فلزات، پتروشیمی،مشتقات نفتی و کشاورزی
- ارائه مشاوره تخصصی سرمایه‌گذاری به اشخاص حقیقی و حقوقی مناسب با اهداف و نیازهای آنها
- ارائه تجزیه و تحلیل اطلاعات مالی و بنیادین برای تحلیل‌گران و معامله‌گران

فهرست مطالب

شاخص کل ۷
ارزش معاملات سهام ۸
P/E بازار ۹
خالص ورود پول حقیقی ۱۰
صندوق سهامی ۱۱
بیشترین ورود پول حقیقی/حقوقی ۱۲
بیشترین تغییرات قیمت ۱۳
بیشترین سرانه خرید و فروش حقیقی ۱۴
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه ۱۵
نرخ بهره بدون ریسک ۱۸
اوراق خزانه ۱۹
صندوق‌های با درآمد ثابت ۲۰
نرخ بهره بین بانکی ۲۱
روند ارزش معاملات در بورس کالا ۲۲
بیشترین ارزش معاملات در بورس کالا ۲۳
قیمت های جهانی ۲۴
روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله ۲۵
شاخص فاصله تا ارزش ذاتی ۲۶
بیشترین ارزش معاملات در بازار اختیار معامله ۲۸

سرپرست واحد تحلیل: علیرضا پیامی
کارشناسان واحد تحلیل: زهره عباسی و محمدحسین نادعلی

کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

NeoBroker

نئوکارگزاری نوین

راهکار نیاز های نوین

My.Nibb.ir

ثبت نام آنی

تنها با چند کلیک ساده
به جمع ما بپیوندید.

افزودن حساب

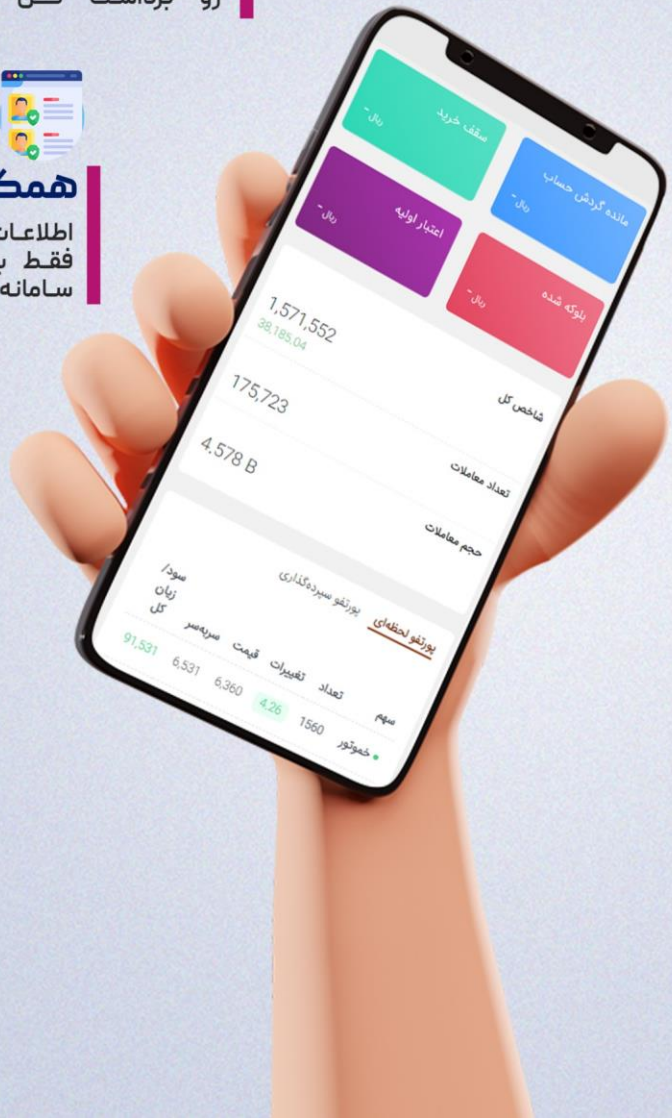
حساب های بانکی خود
را تنها در چند ثانیه به
پنل خود اضافه کنید

برداشت وجه آنی

درهر کجا و هر
لحظه مانده حسابت
رو برداشت کن

همگام سازی سجام

اطلاعات حساب خود را
فقط با یک کلیک از
سامانه سجام به روز کنید

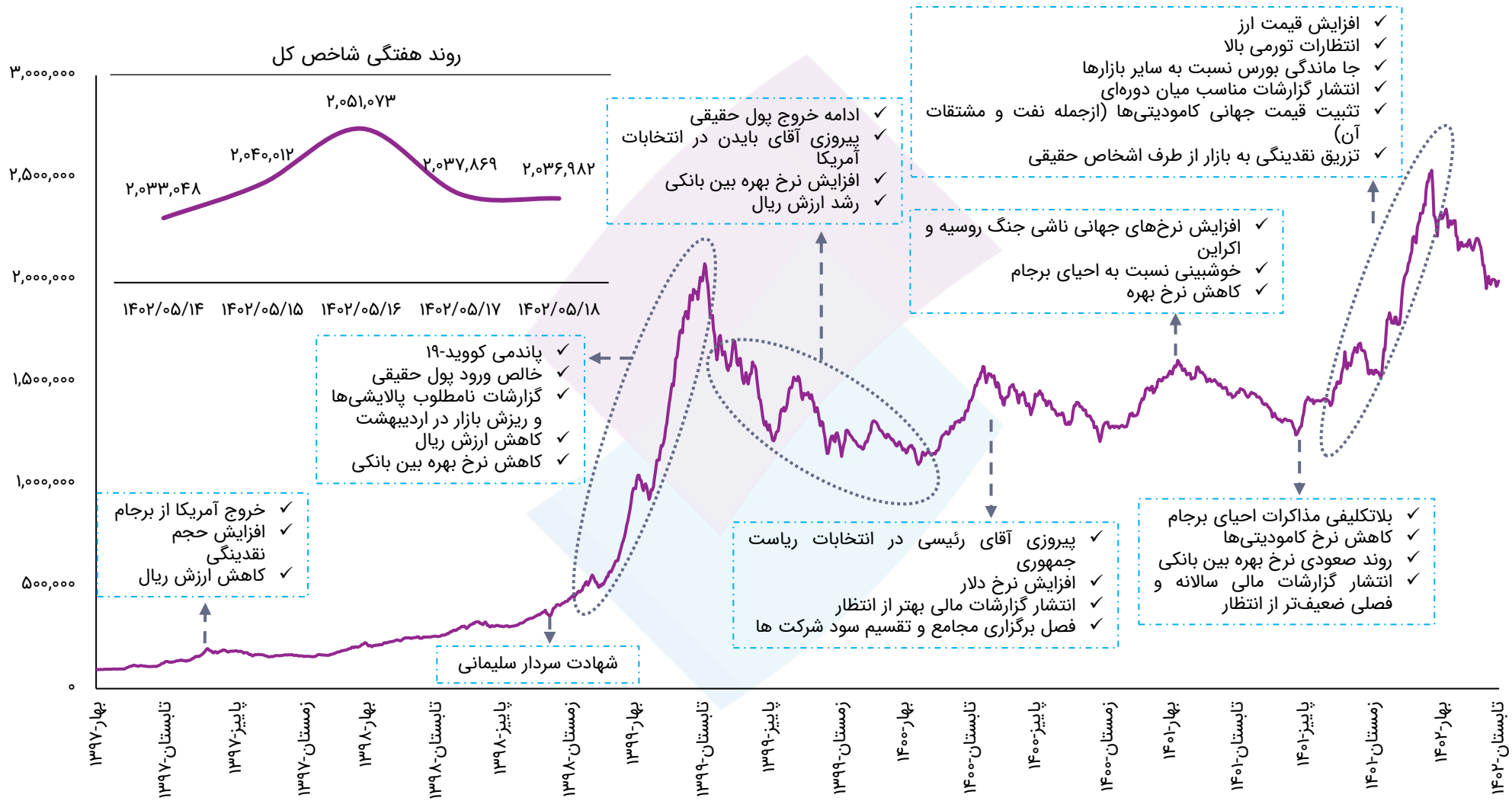


برداشت وجه آنی
فراتر از سرعت...
NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیاز های نوین
My.Nibb.ir
۰۲۱ ۸۶۷۹ ۱۰۰۰
nibb.ir
nibb.ir
nibbroker

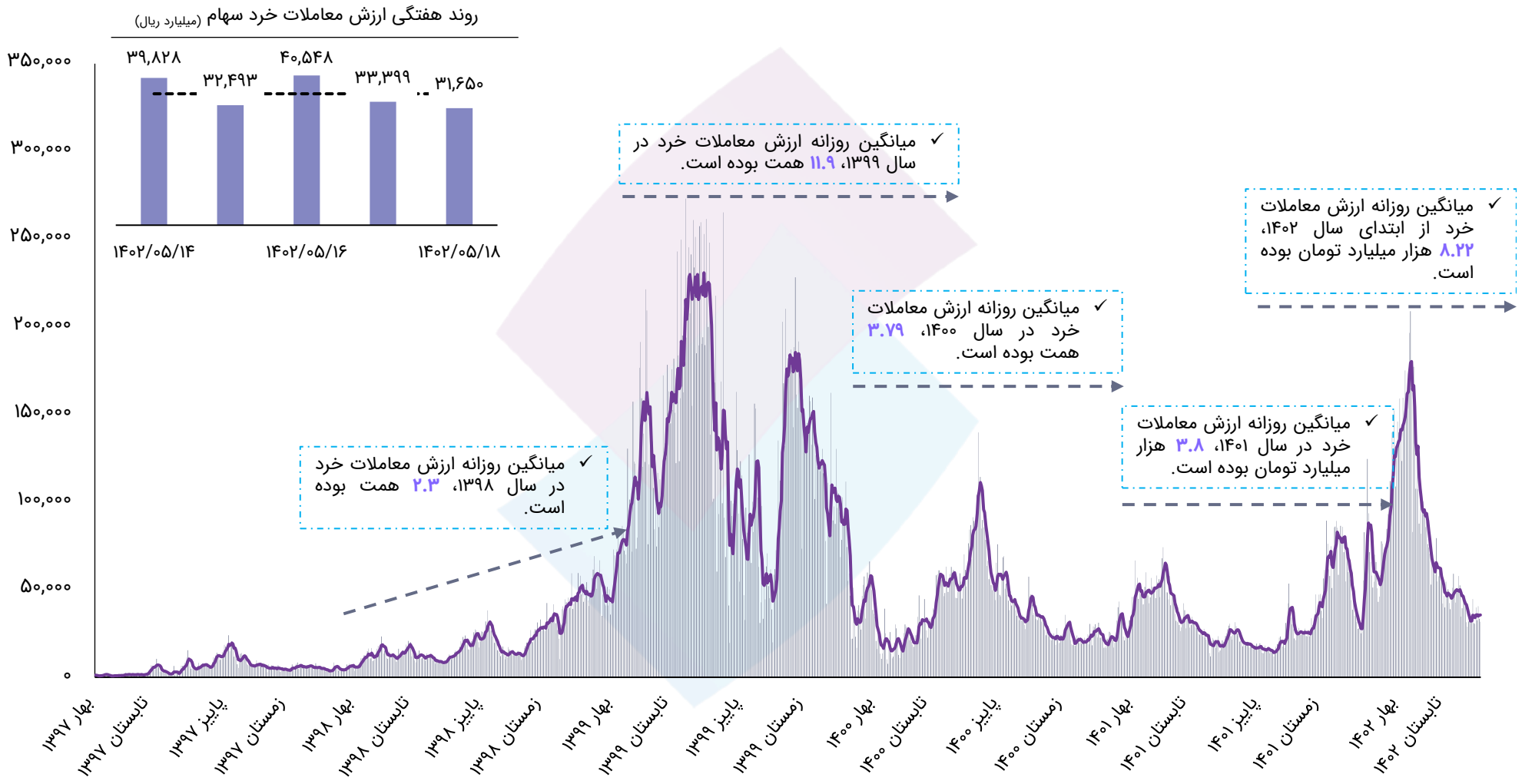
کارگزاری تأمین سرمایه نوین

وضعیت بازار سرمایه درهفته‌ای که گذشت.

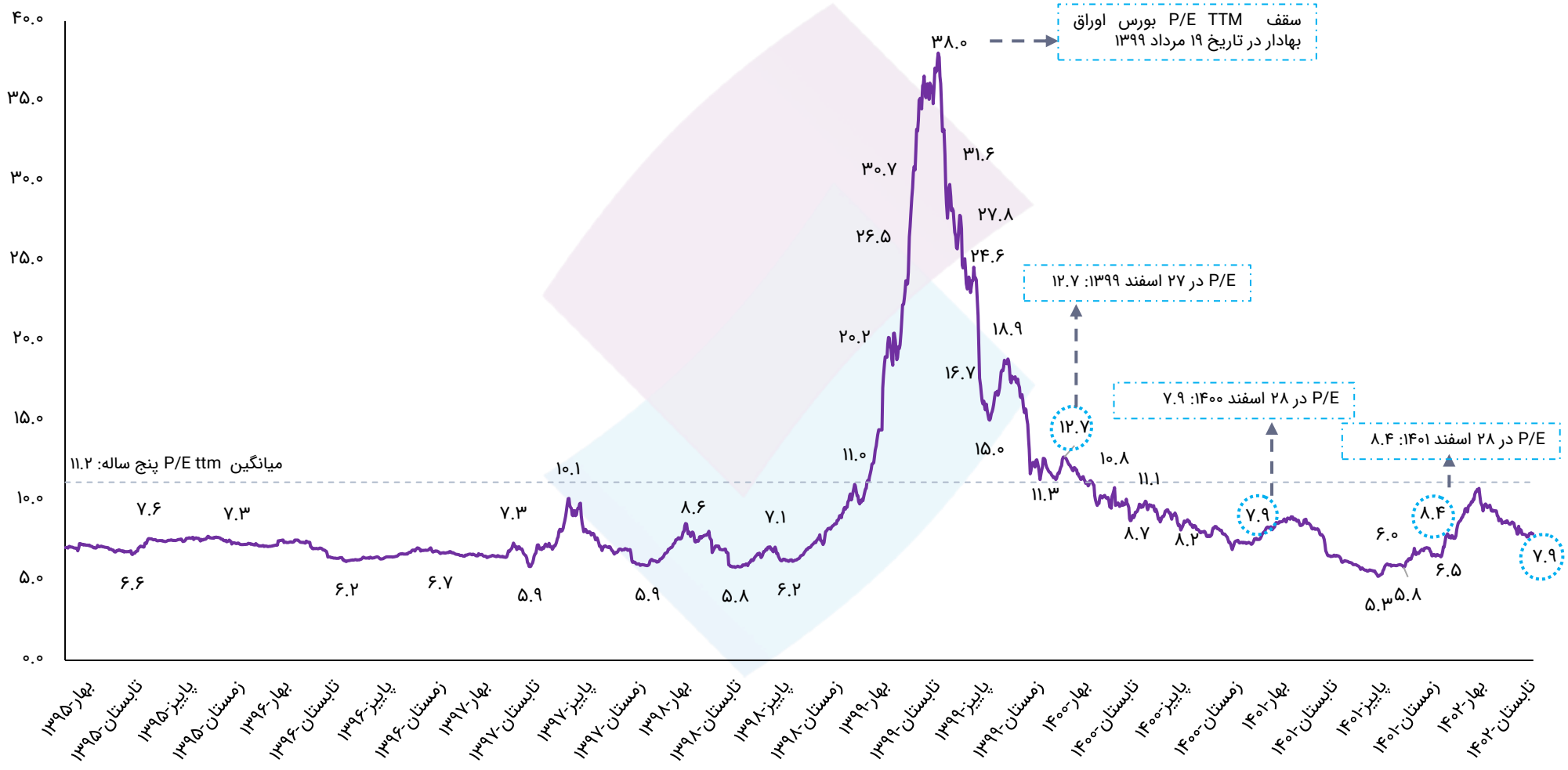
رشد ۲.۲ درصدی شاخص کل در هفته جاری



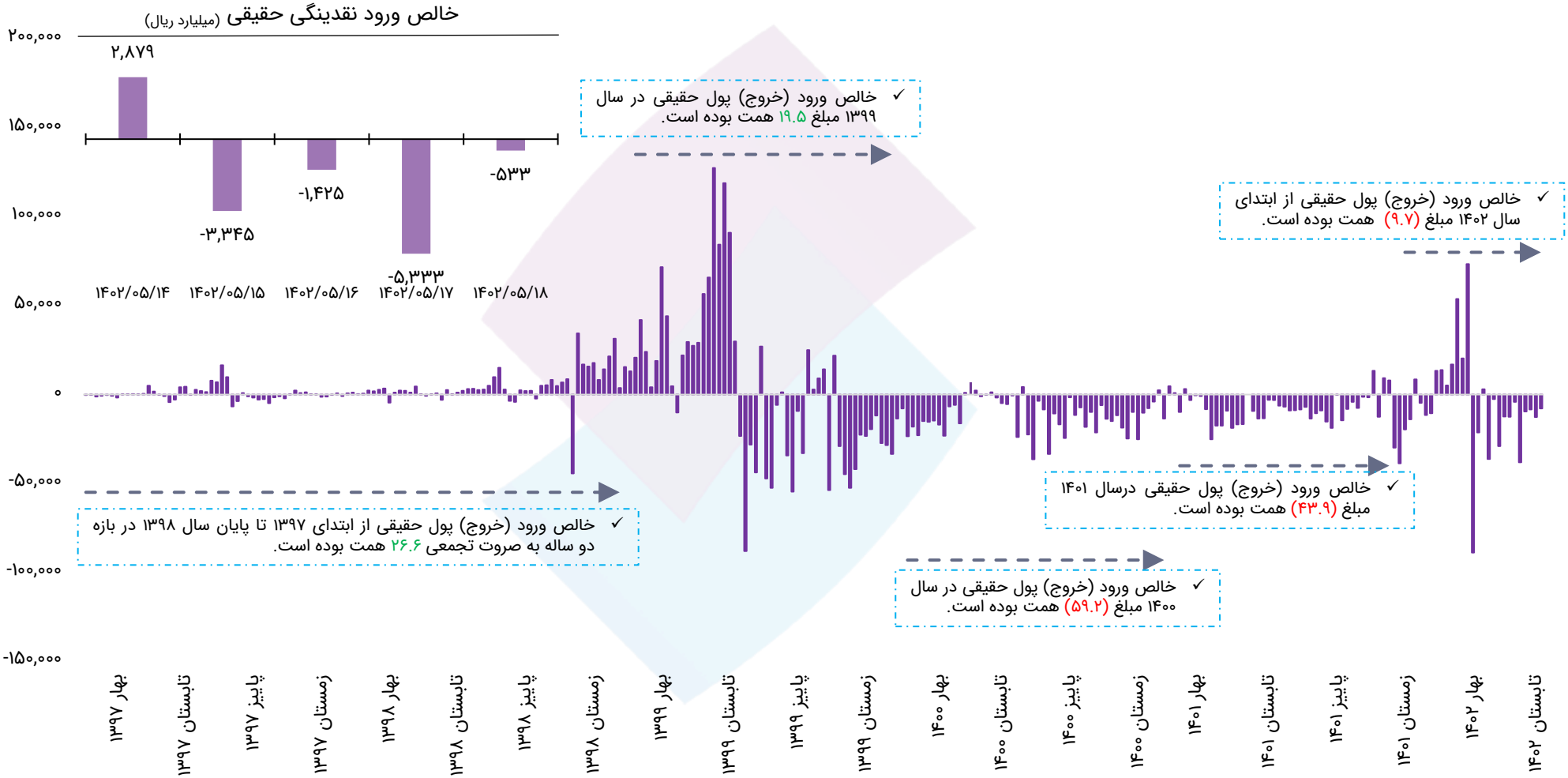
۳،۵۵۸ میلیارد تومان میانگین روزانه ارزش معاملات خرد در هفته جاری؛ افزایش ۳ درصدی ارزش معاملات نسبت به هفته گذشته



کاهش ۰.۱ واحدی P/E TTM بازار تا سطح ۷.۹ واحدی

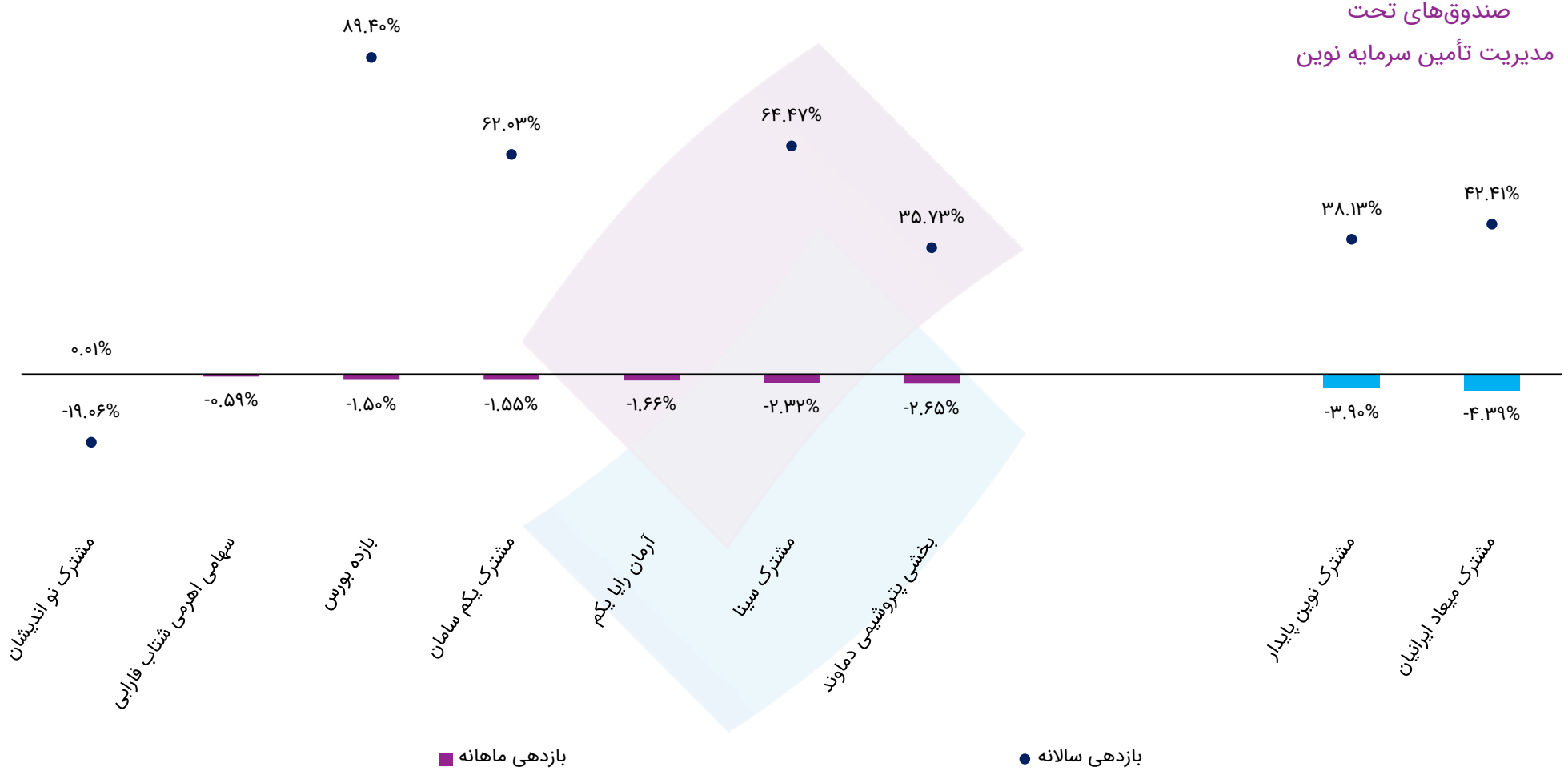


۷۷۶ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱،۲۶۸ میلیارد تومانی هفته گذشته



صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

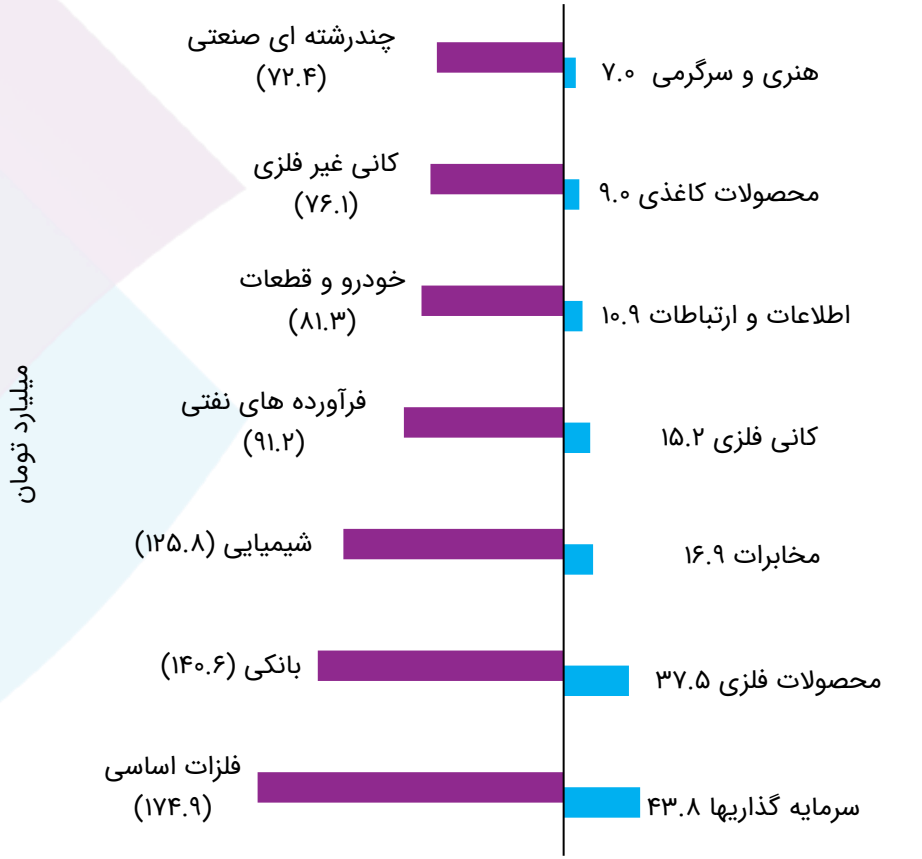
صندوق‌های تحت
مدیریت تأمین سرمایه نوین



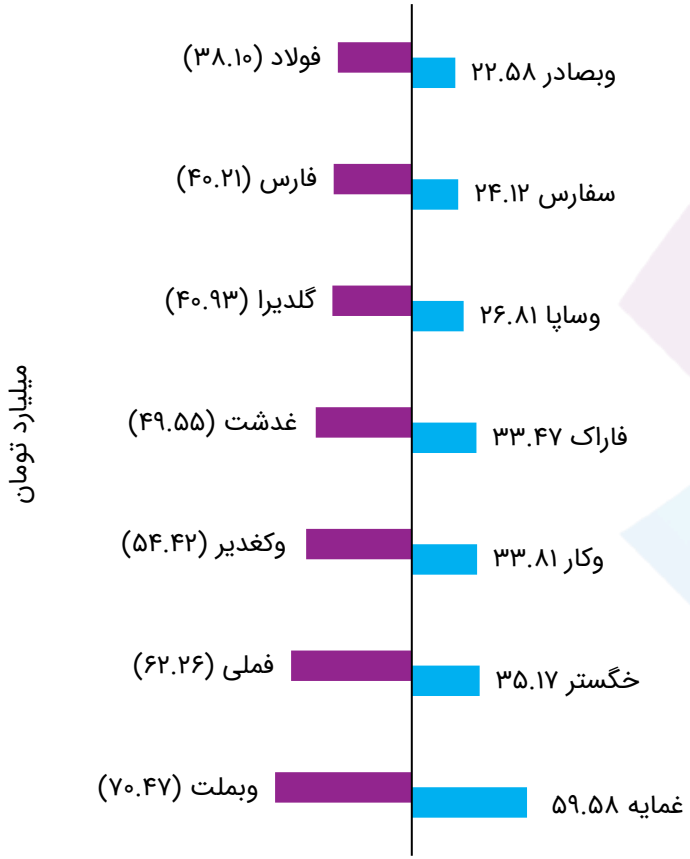
Fipiran.com
بازدهی به صورت ساده لحاظ شده است.
برای صندوق‌های با دوره فعالیت کمتر از یک سال، بازده سالانه در نظر گرفته نشده است.

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

صنعت

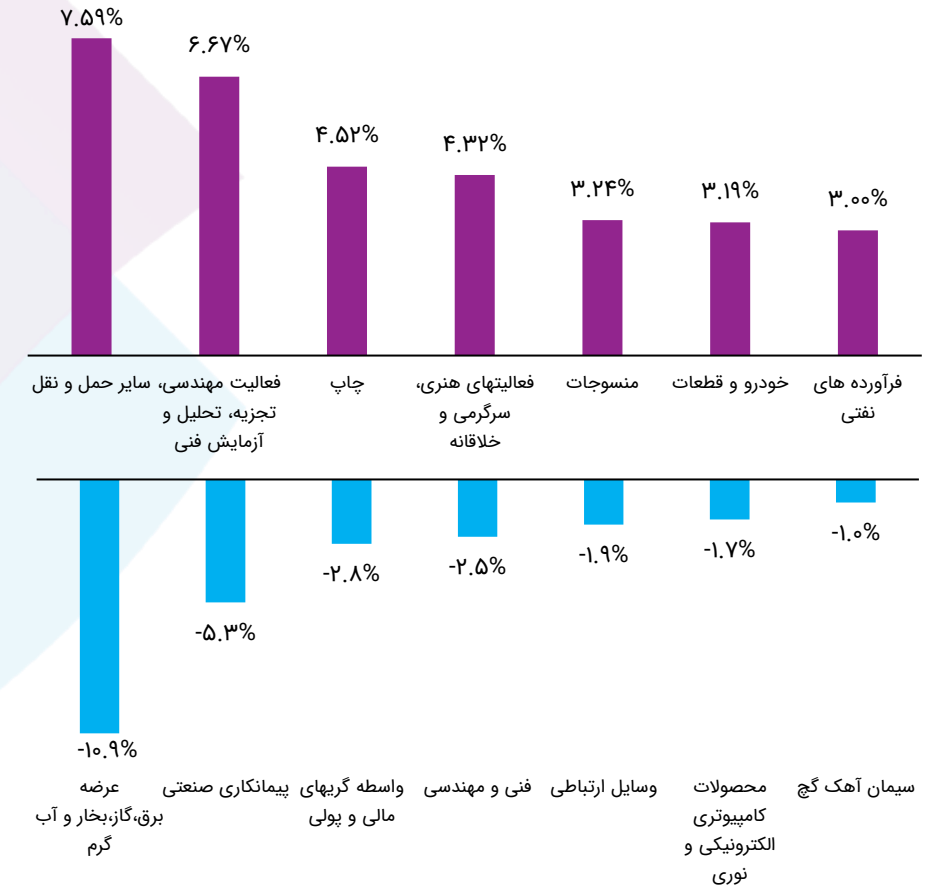


نماد

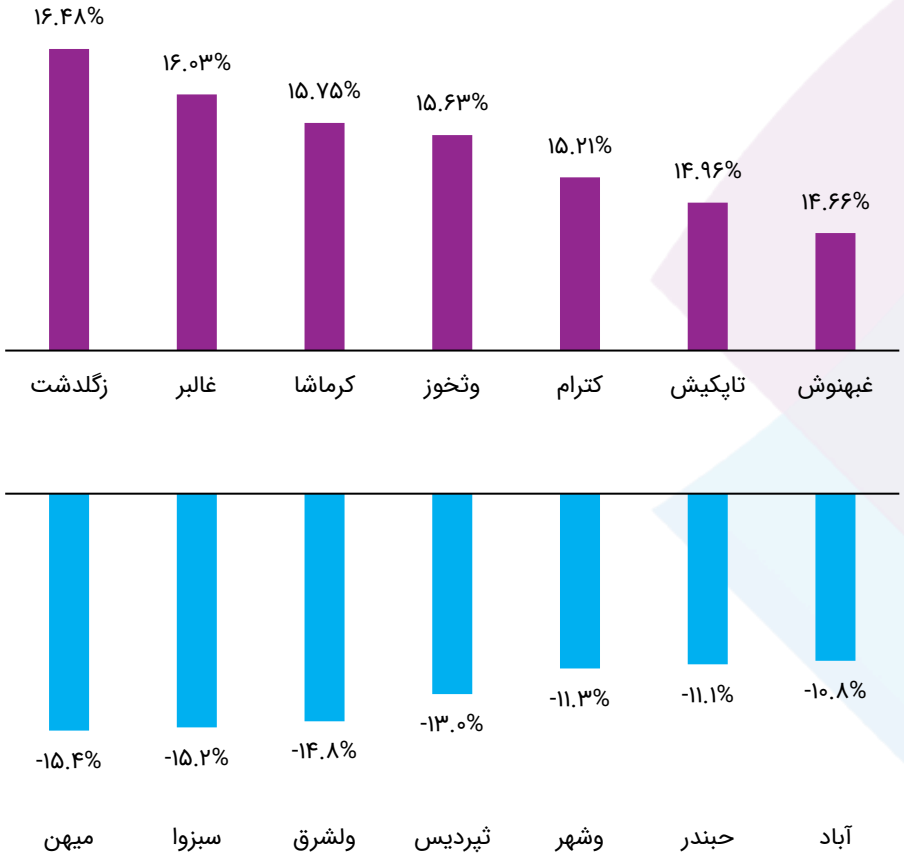


بیشترین و کمترین بازدهی طی هفته جاری

صنعت

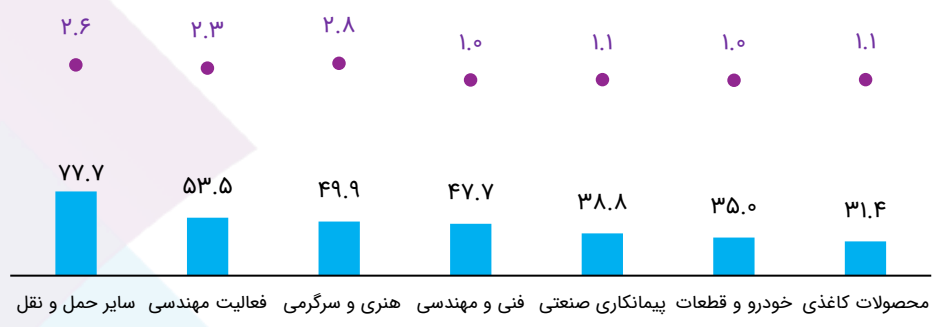


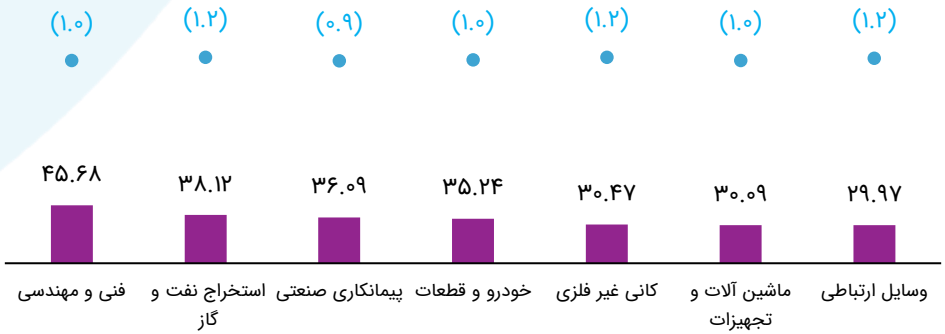
نماد



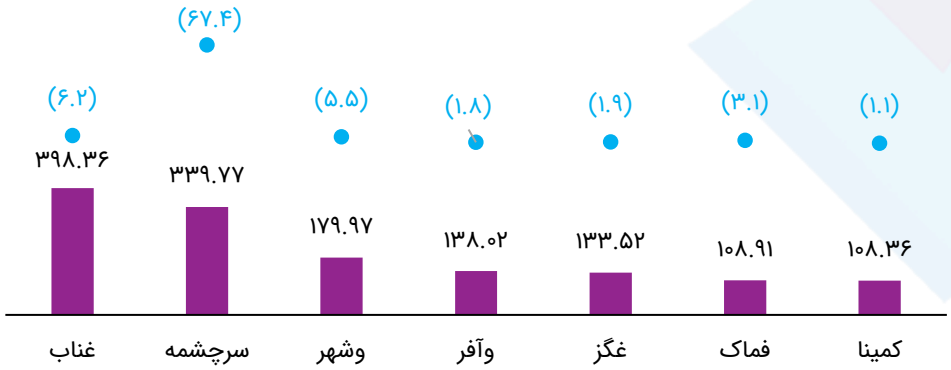
بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

صنعت





نماد



گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
پیشنهاد هیئت مدیره به مجموع عمومي فوق العاده درخصوص افزایش سرمایه:					
غمهرا	۱۹۰	۳۲۰	۶۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
سپید	۳۰۰	۹۰۰	۲۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
تکشا	۲۰	۸۰	۳۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
فرابورس	۸۴۰	۱,۰۵۰	۲۵%	سود انباشته	رعایت الزامات مصوبه چهارصد و نهمین صورتجلسه هیات مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار
سمگا	۱,۵۰۰	۲,۵۰۰	۶۷%	مطالبات و آورده نقدی-سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
وکار	۴,۶۰۰	۵,۰۰۰	۹%	سود انباشته	فعالیت هاي مجاز بانکي در چارچوب ضوابط بانک مرکزي جمهوري اسلامي

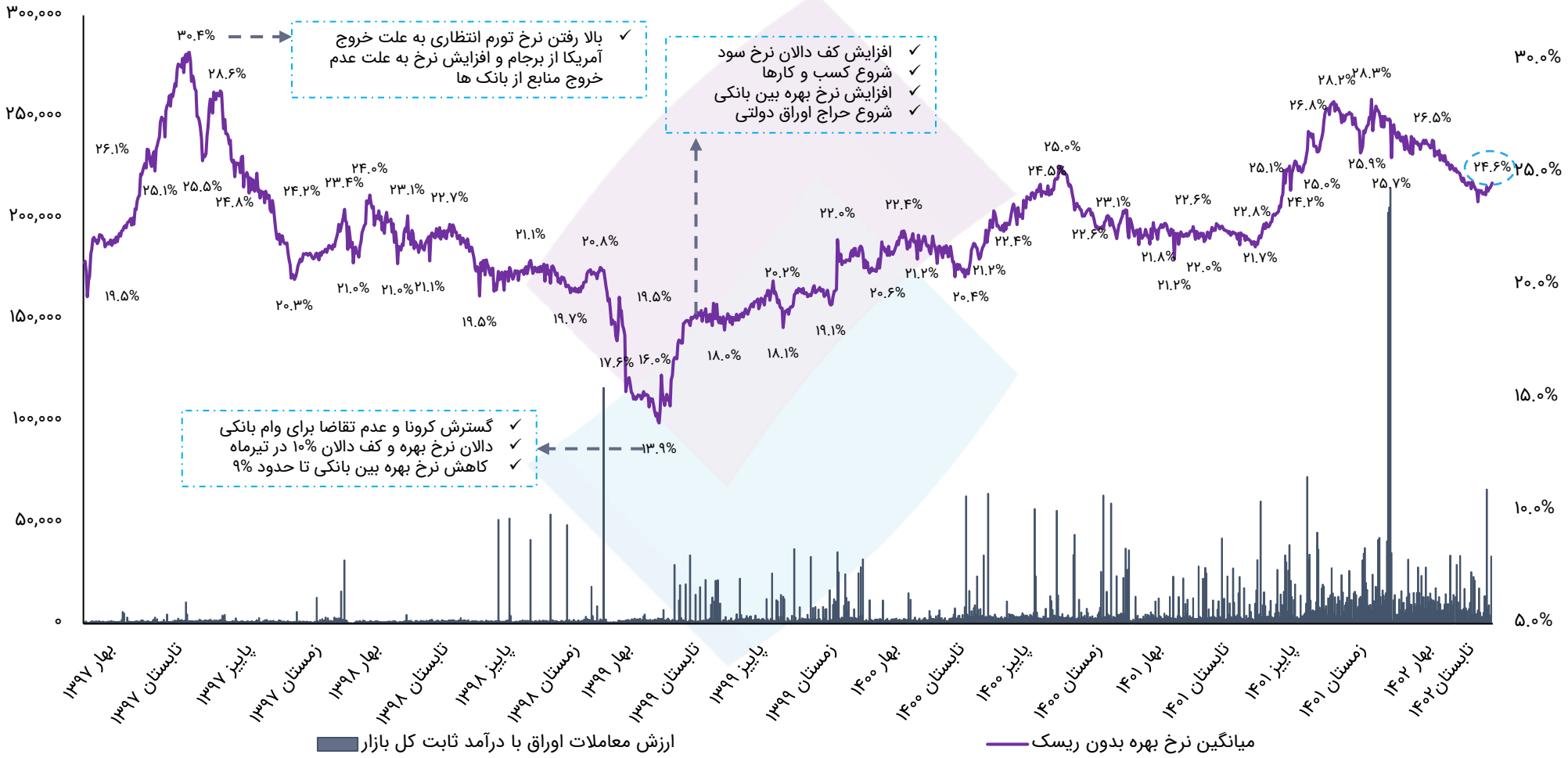
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
صدور مجوز افزایش سرمایه:					
دسبحان	۳۶۳	۵۳۳	۴۷%	سود انباشته	خريد و جايگزيني ماشين‌آلات و تجهيزات توليدي
واحیا	۸۰۰	۱,۶۰۰	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالي
ومشان	۲	۲۶	۱۲۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالي
نیرو	۱۴	۳۰	۱۲۰%	آورده نقدی با سلب حق تقدم	جبران مخارج سرمايه‌گذاري‌هاي صورت گرفته و تحصيل سرمايه گذاري هاي جديد
کساپا	۶۳	۲۶۳	۳۱۸%	مطالبات و آورده نقدی	اجراي طرح توسعه و تامين سرمايه در گردش
ولتجار	۱۸۰	۲۲۳	۲۴%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالي و توسعه عمليات واسپاري
کمرجان	۶۷	۱۱۰	۶۳%	آورده نقدی(۷۷%)-سود انباشته(۲۳%)	اصلاح ساختار مالي و جلوگيري از خروج وجه نقد
تصمیمات مجمع عمومی فوق‌العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه:					
دیران	۸۸	۱۳۳	۵۱%	مطالبات و آورده نقدی	بازسازي و نوسازي خطوط توليد و تامين سرمايه در گردش
وپارس	۱۵,۶۳۴	۲۴,۰۰۰	۵۴%	مطالبات و آورده نقدی	اصلاح ساختار مالي و بهبود نسبت كفايت سرمايه
وسپه	۲,۳۴۰	۳,۰۴۰	۳۰%	آورده نقدی(۸۶%)-سود انباشته(۱۴%)	جبران مخارج بابت سرمايه گذاري هاي انجام شده و مشاركت در افزايش سرمايه شركت‌هاي سرمايه‌پذير
بموتو	۱,۴۲۹	۲,۰۱۵	۴۱%	مطالبات و آورده نقدی(۶۸%)-سود انباشته(۲۹%)-تجدید ارزیابی(۲۹%)	اصلاح ساختار مالي
سپرده	۱,۰۵۰	۱,۳۶۵	۳۰%	سود انباشته(۸۳%)-تجدید ارزیابی(۱۷%)	اصلاح ساختار مالي
پردیس	۳۰۰	۴۵۰	۵۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالي
شیران	۱,۹۲۸	۵,۴۴۳	۱۸۲%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالي
ستران	۱۷۵	۱,۷۰۰	۸۷۱%	سود انباشته(۹۳%)-تجدید ارزیابی(۷%)	اصلاح ساختار مالي و جبران مخارج انجام شده

گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه	سایر توضیحات
اعلامیه پذیره نویسی عمومی:						
نمرینو	۱۳	۴۰	۲۱۵%	مطالبات و آورده نقدی(۴۵%)- سود انباشته(۵۵%)	اصلاح ساختار مالي	مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۲/۰۵/۱۶ تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۵/۳۰ است.
آگهی ثبت افزایش سرمایه:						
وفتخار	۱۳۰	۲۰۰	۵۴%	مطالبات و آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی	وفتخار
بکاب	۱۴	۴۹	۲۵۰%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالي	بکاب
معیار	۵	۳۰	۵۰۰%	مطالبات و آورده نقدی	اصلاح ساختار مالي	معیار

رشد ۰.۴ واحدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۲۴.۶ درصد



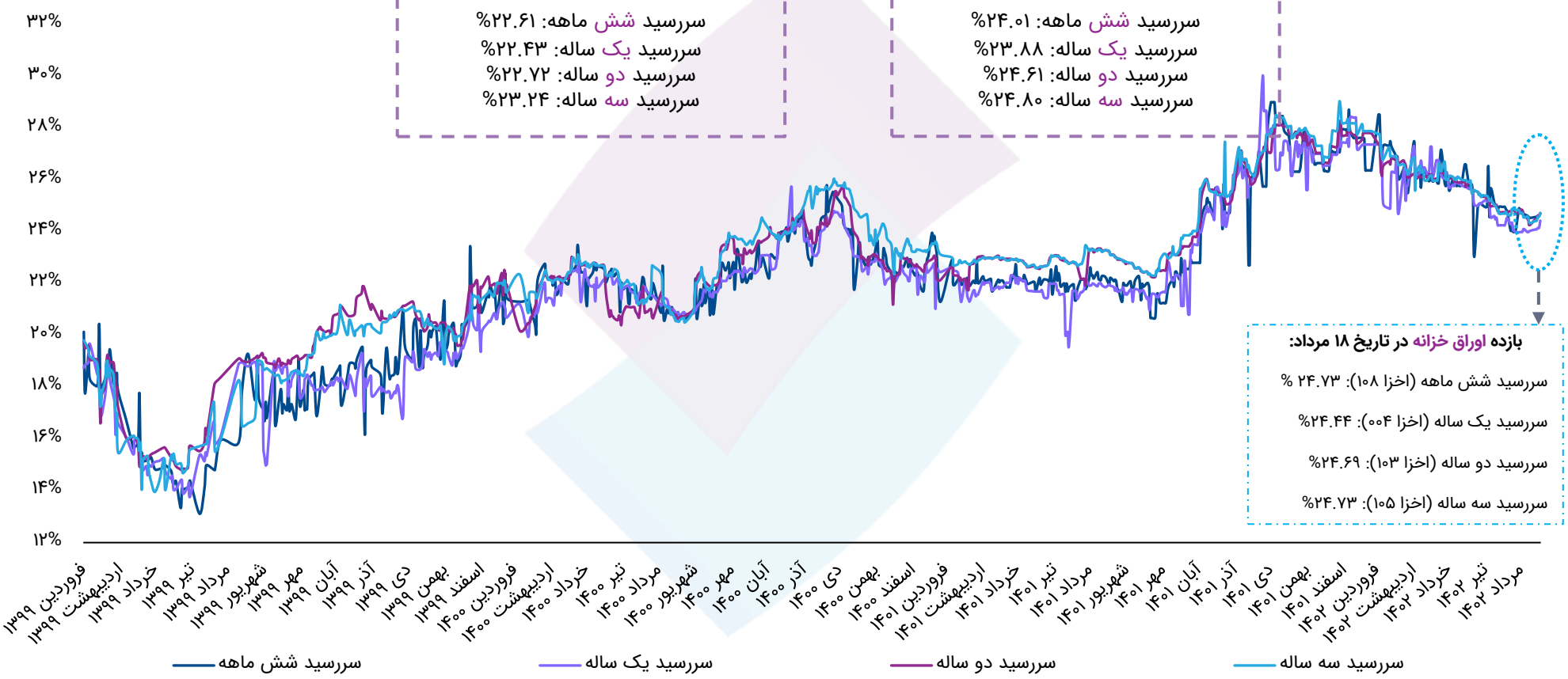
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

میانگین YTM اوراق خزانه در سال ۱۴۰۰:

سررسید شش ماهه: ۲۲.۶۱%
سررسید یک ساله: ۲۲.۴۳%
سررسید دو ساله: ۲۲.۷۲%
سررسید سه ساله: ۲۳.۲۴%

میانگین YTM اوراق خزانه در سال ۱۴۰۱:

سررسید شش ماهه: ۲۴.۰۱%
سررسید یک ساله: ۲۳.۸۸%
سررسید دو ساله: ۲۴.۶۱%
سررسید سه ساله: ۲۴.۸۰%

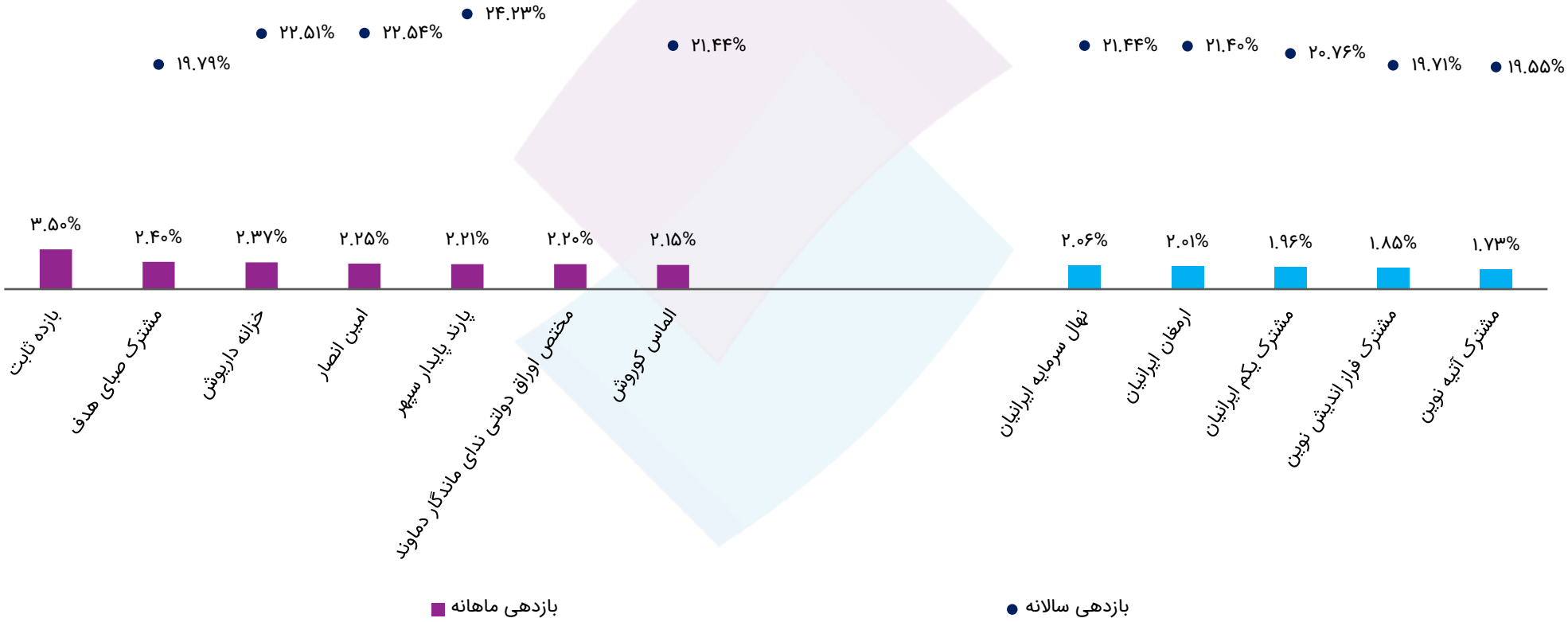


بازده اوراق خزانه در تاریخ ۱۸ مرداد:

سررسید شش ماهه (اخزا ۱۰۸): ۲۴.۷۳ %
سررسید یک ساله (اخزا ۰۰۴): ۲۴.۴۴%
سررسید دو ساله (اخزا ۱۰۳): ۲۴.۶۹%
سررسید سه ساله (اخزا ۱۰۵): ۲۴.۷۳%

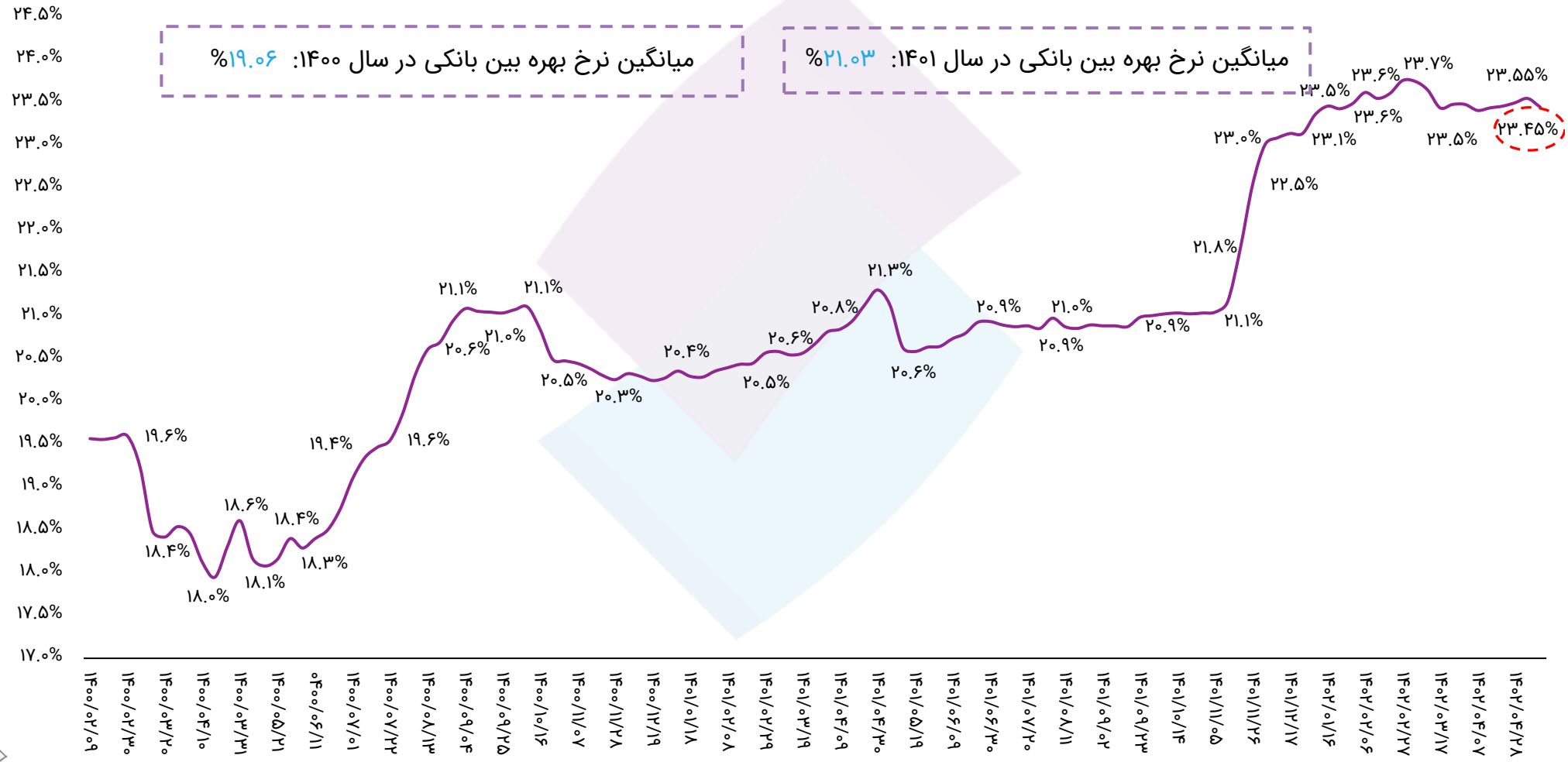
صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت
مدیریت تأمین سرمایه نوین



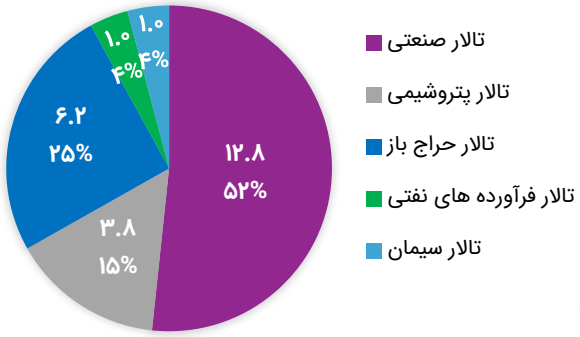
Fipiran.com
بازدهی به صورت ساده لحاظ شده است.
برای صندوق‌های با دوره فعالیت کمتر از یک سال، بازده سالانه در نظر گرفته نشده است.

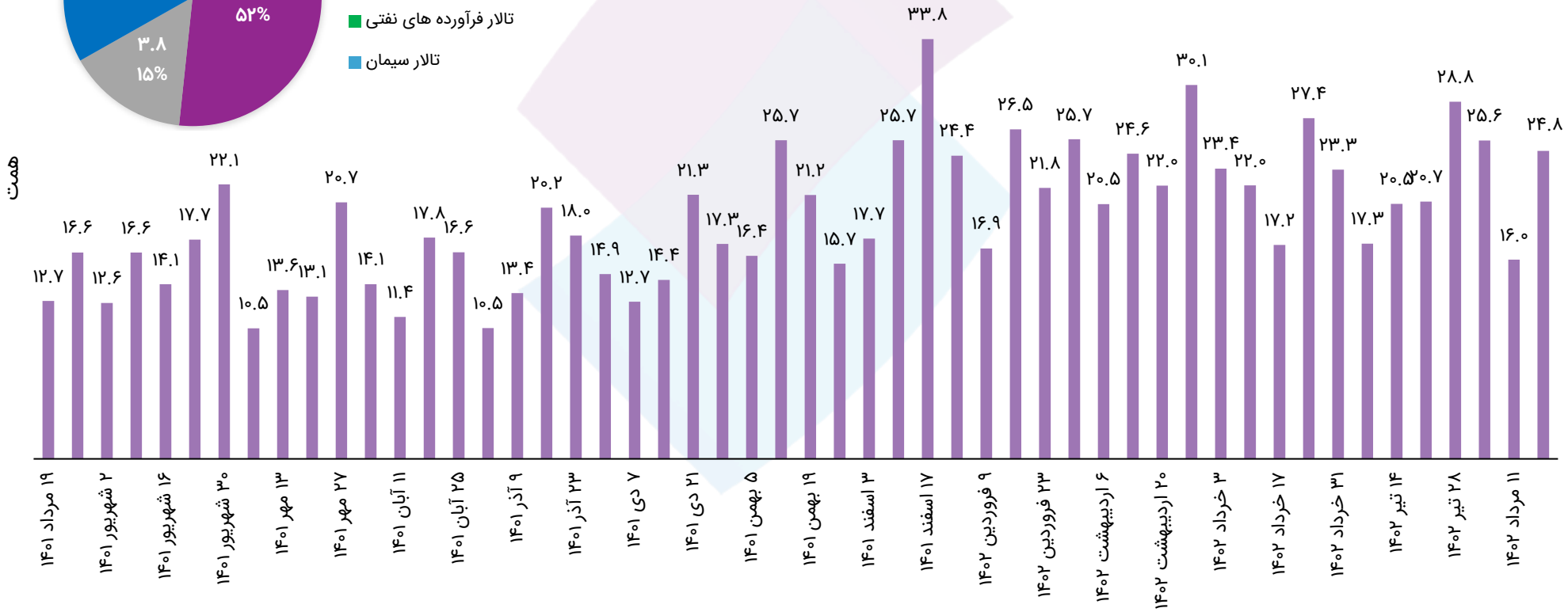
کاهش ۰.۱ نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۴۵ و برگزاری اولین حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به ارزش ۱۳.۰۴ همت



روند ارزش معاملات بورس کالا

سهم هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)





کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (هزار ریال بر تن)	حجم معاملات(تن)	عرضه کننده
شمش بلوم	۱۹۸,۷۶۶	۱۶۳,۶۶۰	فولاد خوزستان، شرکت معدنی وصنعتی چادرملو، مجتمع فولاد خراسان، فولاد کاوه جنوب کیش، مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد، فولاد سیرجان ایرانیان، فولاد بوتیای ایرانیان، شرکت فولاد زرند ایرانیان، آهن و فولاد ارفع، مجتمع فولاد البرز ناب آرش، جهان فولاد سیرجان، تولید فولاد تارا شمش یزد، ذوب و نورد زرفام
وکیوم باتوم	۱۴۰,۹۴۹	۱۸۶,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت شیراز
آهن اسفنجی	۱۱۷,۹۹۰	۲۰۴,۸۰۰	فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، صنعت فولاد شادگان، صبا فولاد خلیج فارس، پارس فولاد سبزوار، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، مجتمع فولاد اردکان
میلگرد	۲۱۹,۸۷۹	۷۱,۵۸۲	مجتمع فولاد خراسان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد شاهرود، فولاد کاوه اروند، فولاد آذربایجان، فولاد آناهیتا گیلان، نورد فولاد صنعتی و ساختمانی یزد، مجتمع فولاد ظفر بناب، تولیدی فولاد سپید فراب کویر، صنعت تجارت پردیس آذربایجان
مس کاتد	۳,۶۰۱,۰۰۰	۴,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
گندله سنگ آهن	۴۴,۹۰۳	۲۸۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، سنگ آهن گهر زمین، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان، سنگ آهن مرکزی ایران
سیمان	۹,۰۸۱	۱,۱۲۴,۹۷۳	سیمان تهران، سیمان آبیک، سیمان ساوه، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان مازندران، سیمان صوفیان، سیمان بجنورد، سیمان ارومیه، سیمان شمال، سیمان سپاهان، سیمان شرق، سیمان هگمتان، مجتمع سیمان غرب آسیا، سیمان آرتا اردبیل، سیمان هرمزگان، سیمان عمران انارک، سیمان خزر، سیمان ممتازان کرمان
ورق گالوانیزه	۴۰۹,۰۷۶	۲۲,۷۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد تاراز چهارمحال، فولاد دشتستان
کنسانتره سنگ آهن	۳۵,۶۴۴	۲۲۰,۰۰۰	شرکت معدنی وصنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر
تیرآهن	۲۳۴,۵۲۰	۳۱,۳۴۰	ذوب آهن اصفهان، مجتمع فولاد ظفر بناب، مجتمع ذوب آهن اطلس تجارت سهند، پروفیل صنعت ماهان
لوب کات	۱۴۲,۸۲۸	۴۸,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس مفتول	۳,۷۰۱,۲۸۷	۱,۶۸۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، گیل راد شمال، آریا کابل فدک
شمش آلومینیوم	۱,۰۴۳,۲۵۱	۵,۲۵۰	مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم ایران(ایرالکو)، آلومینیوم المهدی، آلومینای ایران
پلی پروپیلن نساجی	۴۱۸,۹۹۱	۱۲,۷۷۲	پتروشیمی مارون، پتروشیمی رجال، دی آریا پلیمر، پتروشیمی شازند، پلی پروپیلن جم، پتروشیمی پلی نار، نوید زرشیمی
خاک روی	۱۴۷,۷۲۹	۳۶,۰۰۰	مجتمع سرب و روی انگوران

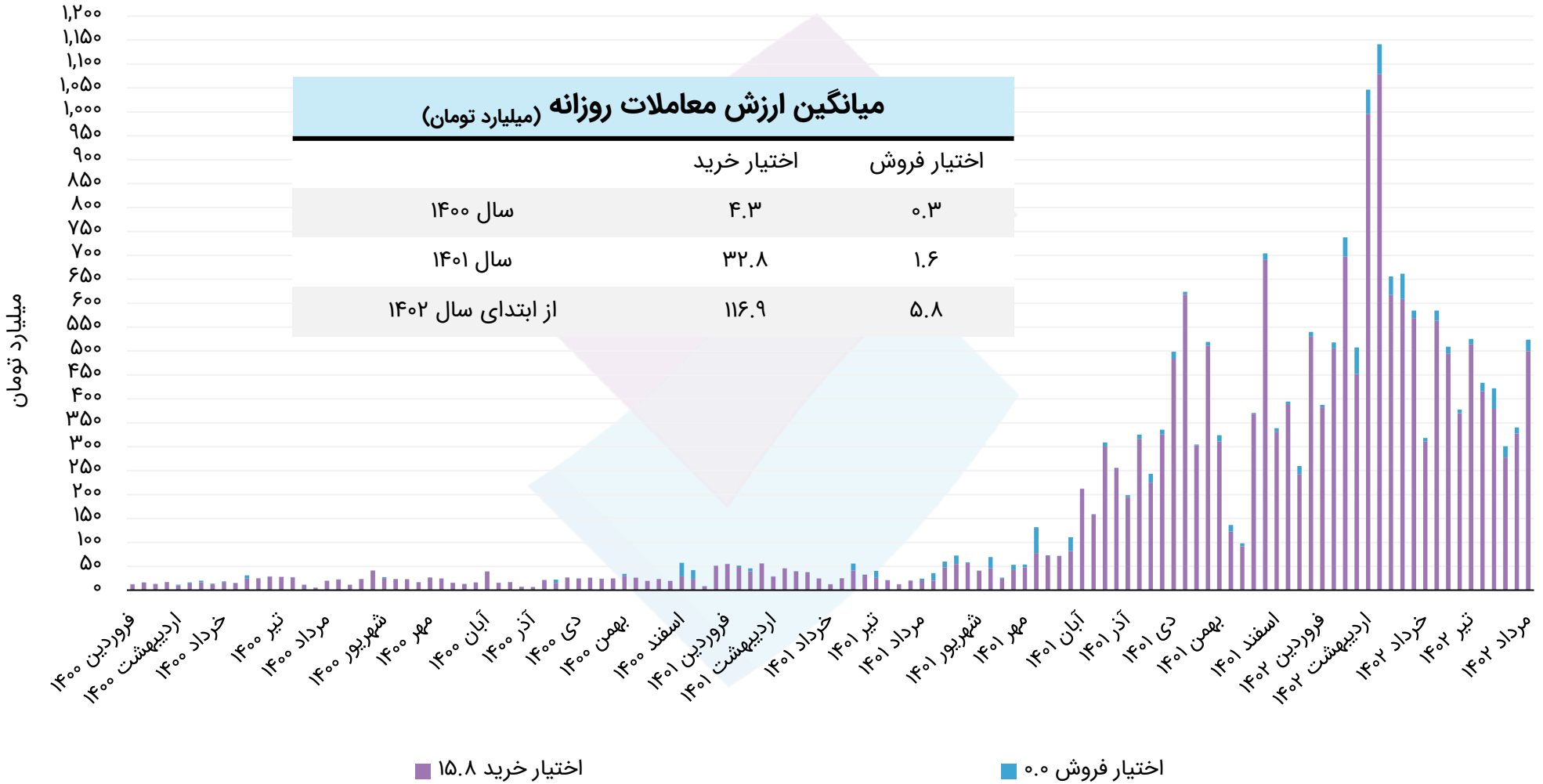
کاهش ۱۱.۱۱ درصدی قیمت بیلتCIS به دلیل موجودی بالاتر از از تقاضا بازار و داده های اقتصادی منفی چین

شرح	آخرین قیمت	هفته گذشته		ماه گذشته		سال گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۱,۹۲۵	۱,۹۳۵	-۰.۵۴%	۱,۹۲۹	-۰.۲۰%	۱,۷۹۵	۷.۲۱%
سکه (هزار ریال)	۲۸۶,۵۱۰	۲۹۴,۹۳۰	-۲.۸۵%	۲۸۲,۳۵۰	۱.۴۷%	۱۴۸,۲۰۰	۹۳.۳۳%
دلار اسکناس (ریال)	۴۱۳,۵۶۳	۴۱۳,۰۲۴	۰.۱۳%	۴۱۲,۵۸۰	۰.۲۴%	۰	۰.۰۰%
دلار حواله (ریال)	۳۷۵,۹۶۶	۳۷۵,۴۷۶	۰.۱۳%	۳۷۵,۰۷۳	۰.۲۴%	۰	۰.۰۰%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۸۶.۹۳	۸۳.۳۸	۴.۲۶%	۷۷.۷۹	۱۱.۷۵%	۹۶.۵۳	-۹.۹۵%
بیت کوین (دلار)	۲۹,۸۱۸	۲۹,۱۵۲	۲.۲۸%	۳۰,۴۱۴	-۱.۹۶%	۲۳,۱۶۴	۲۸.۷۲%
مس LME(دلار/تن)	۸,۲۷۵	۸,۵۴۲	-۳.۱۳%	۸,۲۸۵	-۰.۱۲%	۷,۹۷۱	۳.۸۱%
روی LME(دلار/تن)	۲,۴۴۷	۲,۵۲۶	-۳.۱۳%	۲,۳۴۱	۴.۵۳%	۳,۵۷۵	-۳۱.۵۵%
بیلت CIS(دلار/تن)	۴۴۰	۴۹۵	-۱۱.۱۱%	۵۰۸	-۱۳.۳۹%	۵۲۰	-۱۵.۳۸%
بیلت ایران (دلار/تن)	۴۶۵	۴۹۳	-۵.۶۸%	۴۹۳	-۵.۶۸%	۴۶۵	۰.۰۰%
متانول CFR ($/mt)	۲۶۷	۲۶۳	۱.۵۲%	۲۴۹	۷.۲۳%	۳۱۱	-۱۴.۱۵%
سبد اوره ($/mt)	۴۲۵	۳۹۷	۷.۰۸%	۳۱۰	۳۷.۰۲%	۶۰۷	-۲۹.۹۶%
گاز طبیعی Henry Hub ($/MBtu)	۲.۸۱	۲.۴۸	۱۳.۳۱%	۲.۵۵	۱۰.۲۰%	۷.۸۷	-۶۴.۲۹%

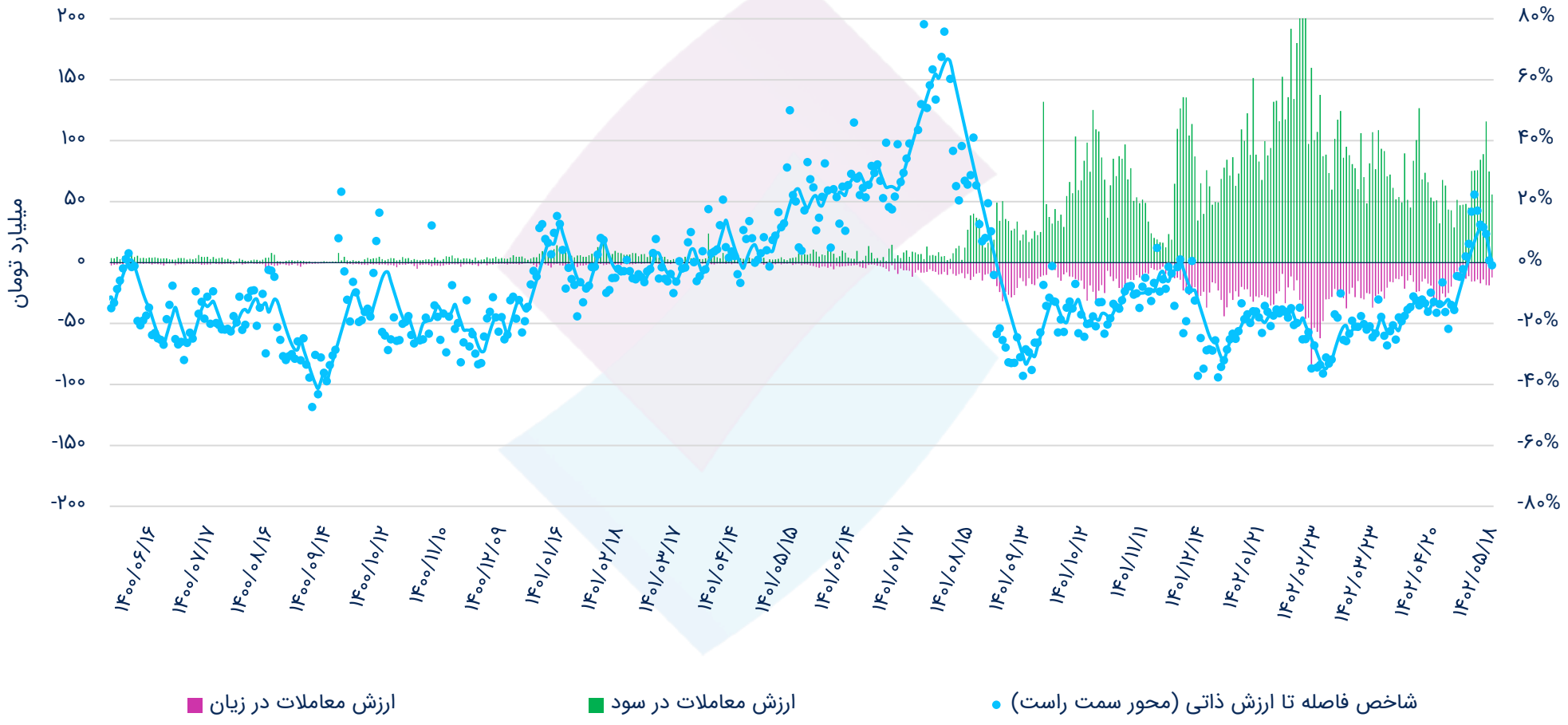
روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله

میانگین ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)

	اختیار خرید	اختیار فروش
سال ۱۴۰۰	۴.۳	۰.۳
سال ۱۴۰۱	۳۲.۸	۱.۶
از ابتدای سال ۱۴۰۲	۱۱۶.۹	۵.۸

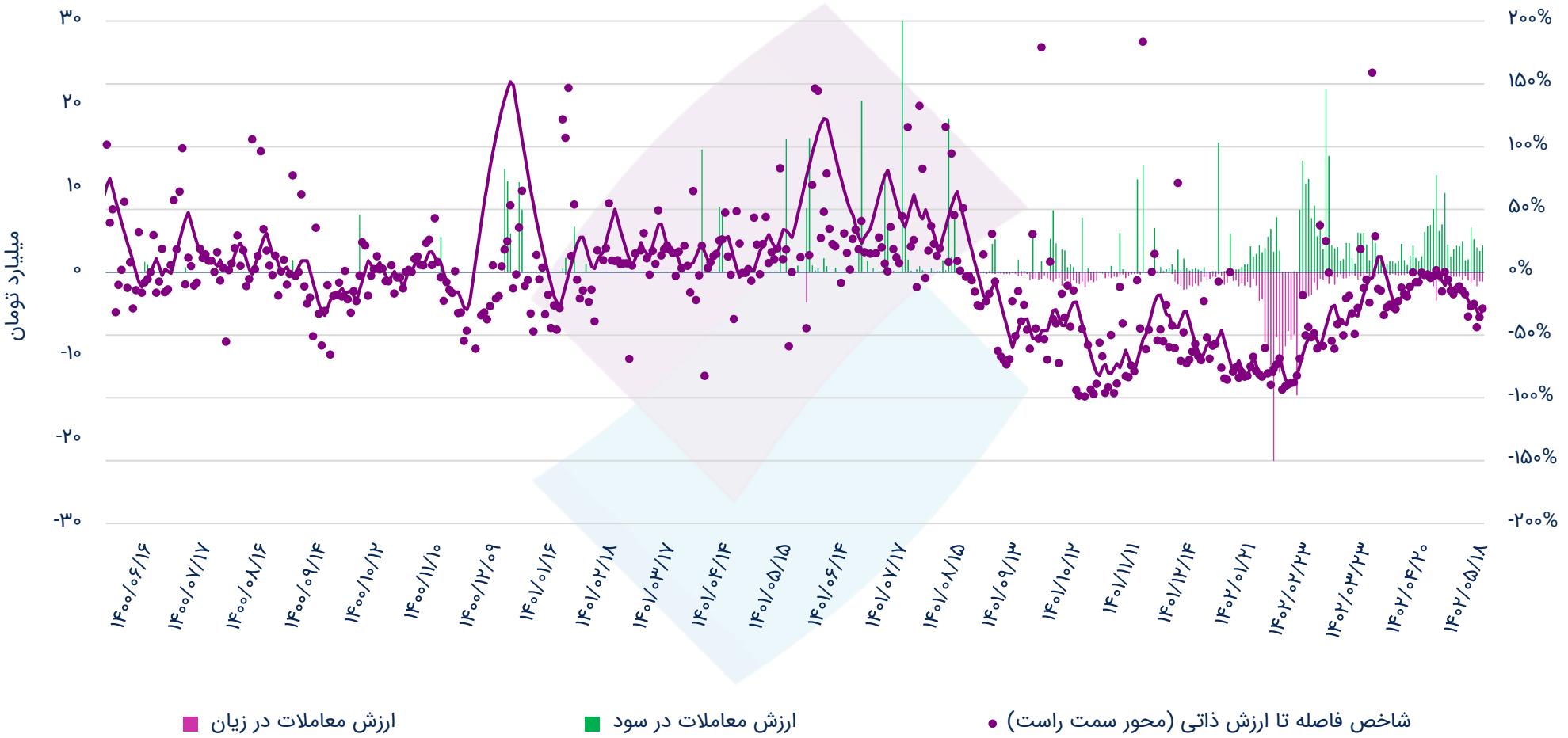


شاخص فاصله تا ارزش ذاتی[1] - اختیار خرید



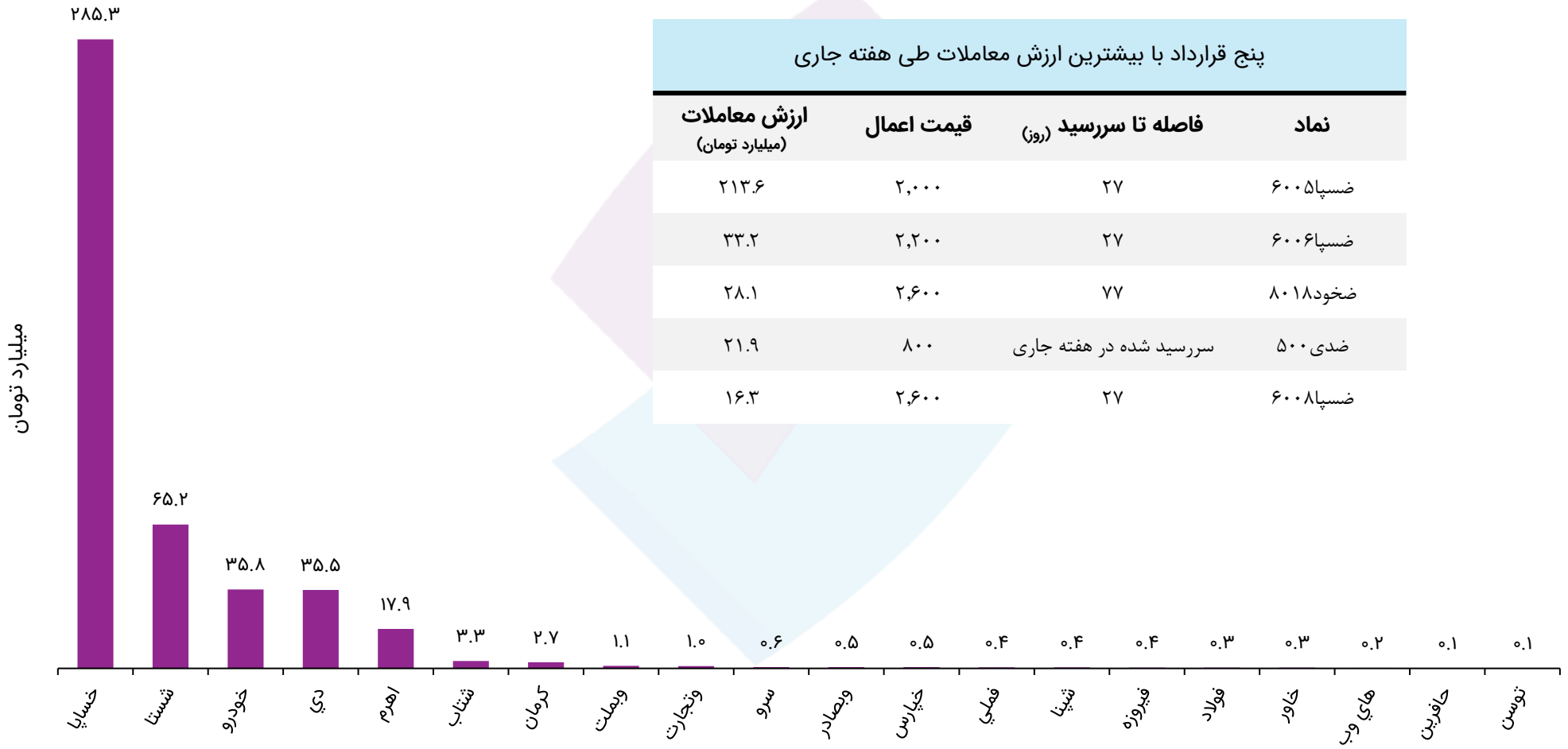
(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است.)
(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی[1] - اختیار فروش



(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است.)
(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

ارزش معاملات به تفکیک دارایی پایه در هفته جاری



پنج قرارداد با بیشترین ارزش معاملات طی هفته جاری

نماد	فاصله تا سررسید (روز)	قیمت اعمال	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
ضسپا۶۰۰۵	۲۷	۲,۰۰۰	۲۱۳.۶
ضسپا۶۰۰۶	۲۷	۲,۲۰۰	۳۳.۲
ضخود۸۰۱۸	۷۷	۲,۶۰۰	۲۸.۱
ضدی۵۰۰	سررسید شده در هفته جاری	۸۰۰	۲۱.۹
ضسپا۶۰۰۸	۲۷	۲,۶۰۰	۱۶.۳

ثبت نام آنلاین آنی
دوست دار طبیعت باشیم
NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیاز های نوین
My.Nibb.ir
سلف خرید
مانده گردش حساب
اعتبار اولیه
بلوکه شده
شاخص کل
1,717,099
60,505.85
تعداد معاملات
134,797
حجم معاملات
3.731 B
شرایط ویژه اعتباری برای هشتریان
۰۲۱ ۸۶۷۹ ۱۰۰۰
nibb.ir
nibb.ir
nibbroker

کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

شرایط ویژه اعتباری برای مشتریان

- برگشت کارمزد و اعطای اعتبار رایگان برای مشتریان پرگردش
- تا ۲ درصد تخفیف اعتبار در نرخ هزینه مالی با هربار گردش اعتبار
- اعطای اعتبار رایگان با حداقل ۱۴ بار گردش اعتبار در ماه

کارگزاری تامین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

سلب مسئولیت

این گزارش صرفاً جهت اطلاع از شرایط بازارها تهیه شده است، محتوای آن نباید به تنهایی جهت اخذ تصمیمات مالی، سرمایه‌گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.

تحلیل ارائه شده بر مبنای اطلاعات فعلی تهیه شده است. نظرات ارائه شده دراین گزارش به هیچ عنوان توصیه‌ای به خرید و فروش با نگهداری سهام ندارد و مسئولیت استفاده از اطلاعات آن با خوانندگان این گزارش است.

کلیه حقوق مادی و معنوی این محتوی مربوط به شرکت کارگزاری تامین سرمایه نوین است و استفاده از آن تنها با ذکر منبع مجاز است.

بلوارنلسون ماندلا، بلوارگل‌آذین، شماره۲۳

۰۲۱ - ۸۶۷ ۹۱ ۰۰۰ ۰۲۱ - ۲۲۰ ۳۰ ۳۴۹

info@nibb.ir www.nibb.ir

nibbroker nibb nibb.ir