

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage



هفته نامه تحلیلی کارگزاری تأمین سرمایه نوین

هفته منتهی به ۱۹ مهر - شماره ۱۲۰

تهیه و تنظیم: واحد تحلیل کارگزاری تأمین سرمایه نوین



خدمات شرکت کارگزاری تأمین سرمایه نوین

- ♦ ارائه خدمات مربوط به بورس اوراق بهادار، بورس کالا و بورس انرژی
- ♦ تأمین مالی شرکت‌های بورسی و غیربورسی در حوزه‌های سرمایه در گردش، طرح‌های توسعه‌ای و راه‌اندازی پروژه‌ها با استفاده از ابزارهای نوین تأمین مالی
- ♦ 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

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



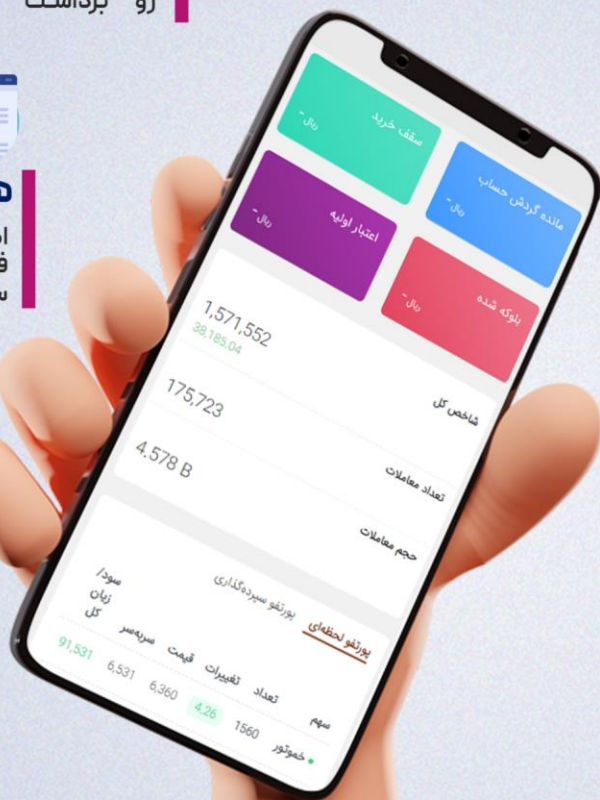
برداشت وجه آنی

در هر 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



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

NeoBroker

نئوکارگزاری نوین

راهکار نیازهای نوین

My.Nibb.ir

برداشت وجه آتی

فرا تر از سرعت ...

NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیازهای نوین

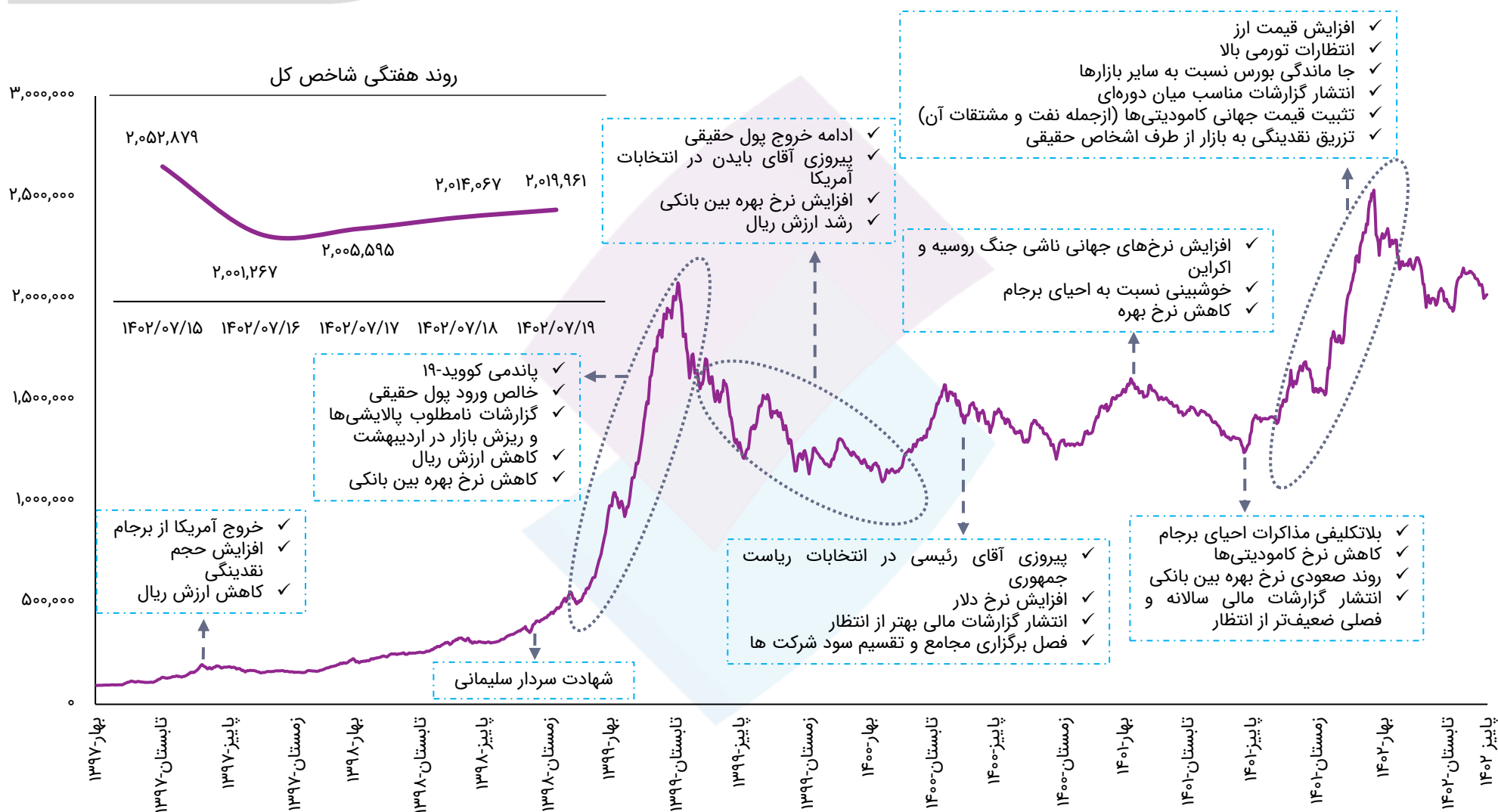
My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

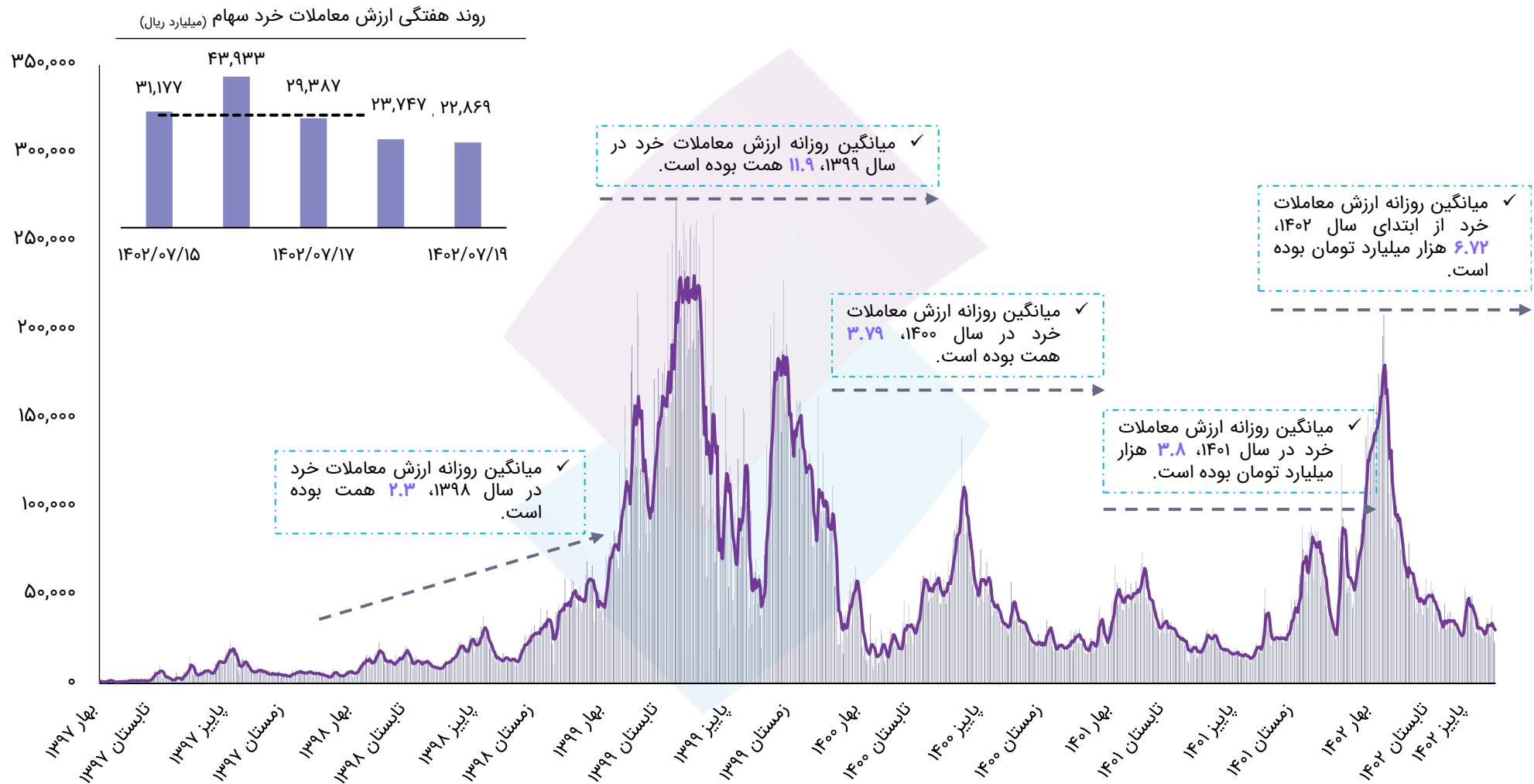


وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

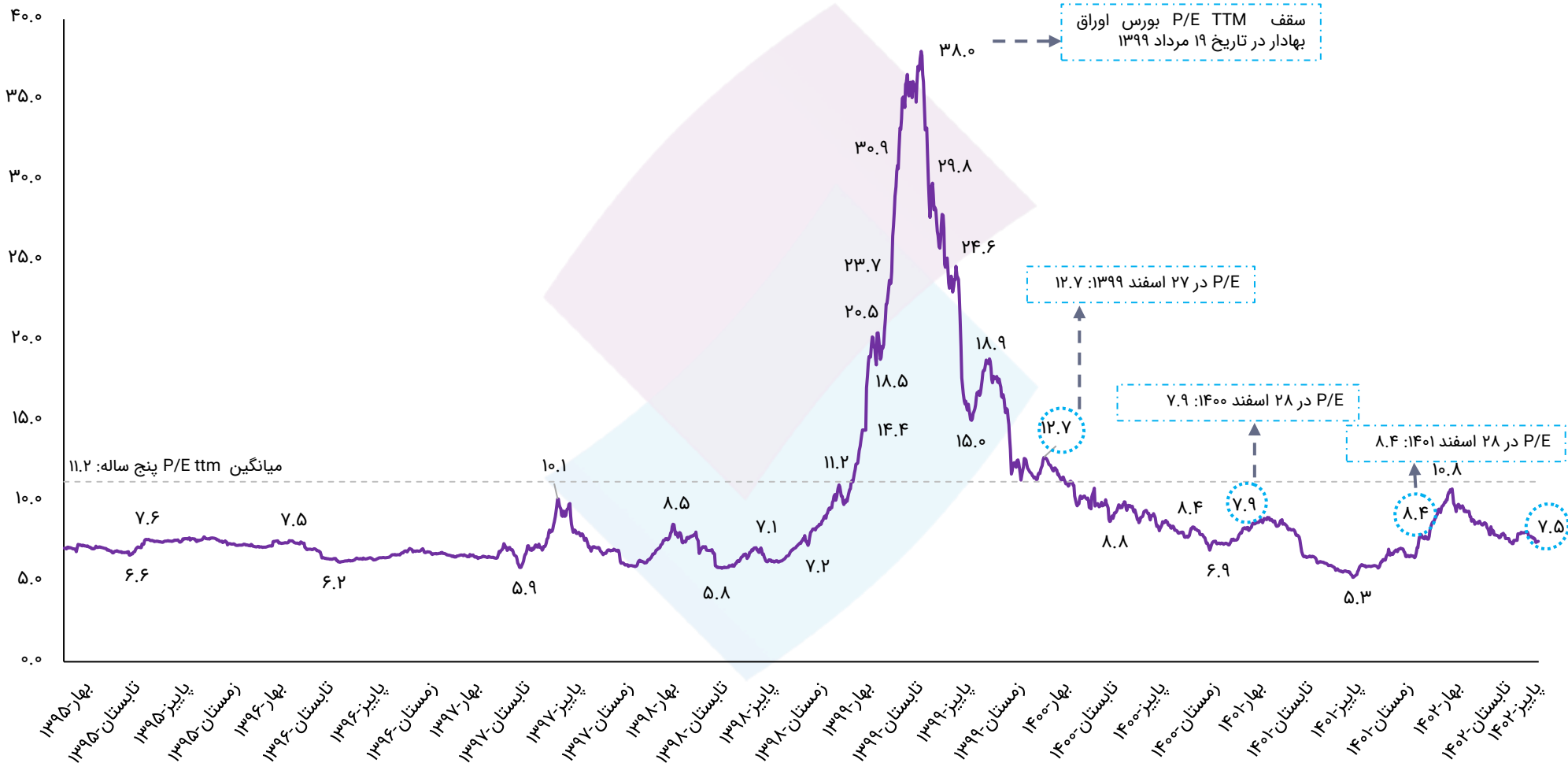
کاهش ۲.۴ درصدی شاخص کل در هفته جاری



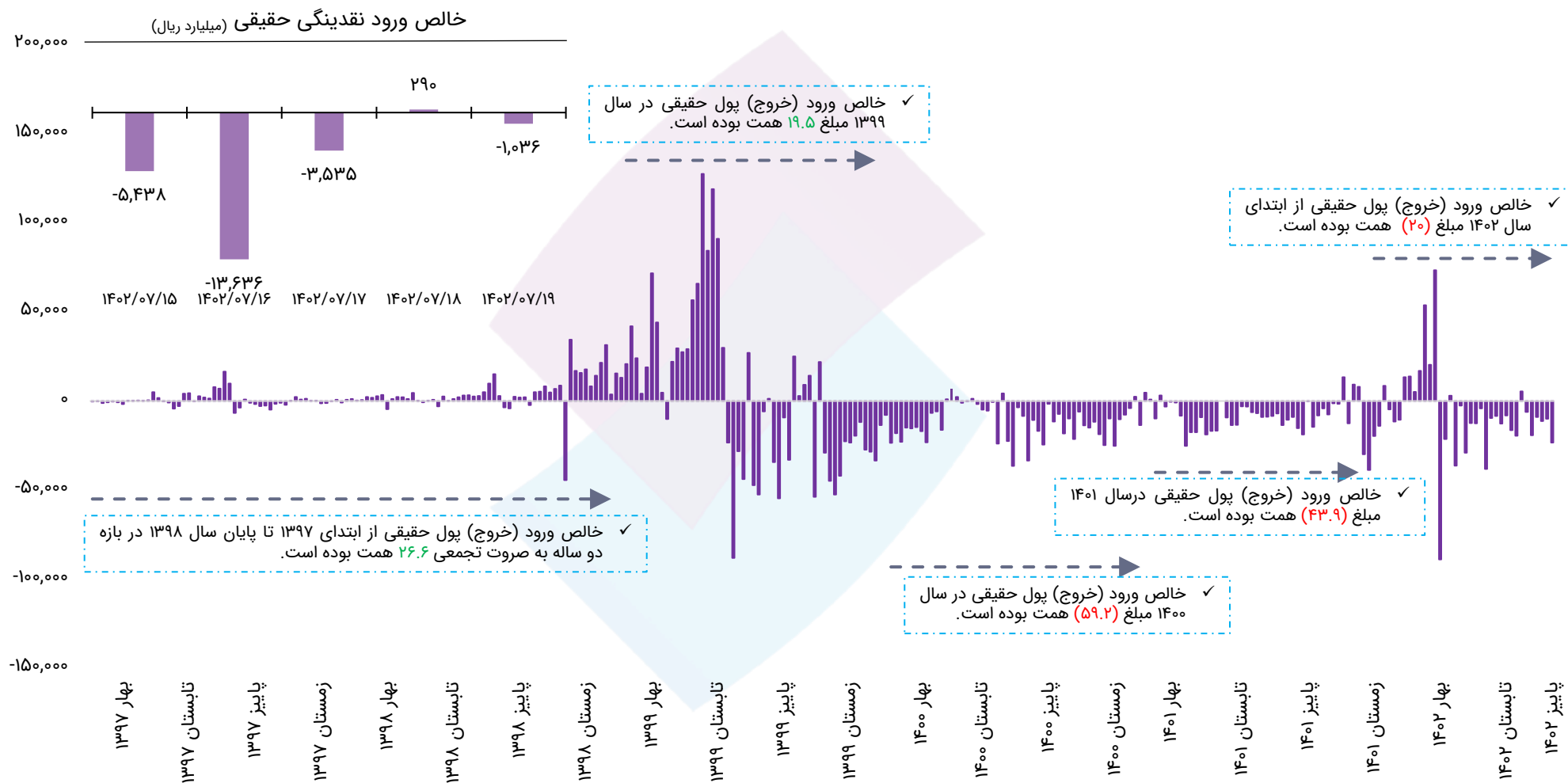
۳،۰۲۲ میلیارد تومان میانگین روزانه ارزش معاملات خرد در هفته جاری: کاهش ۹ درصدی ارزش معاملات نسبت به هفته گذشته



کاهش ۰.۲ واحدی P/E TTM بازار تا عدد ۷.۵

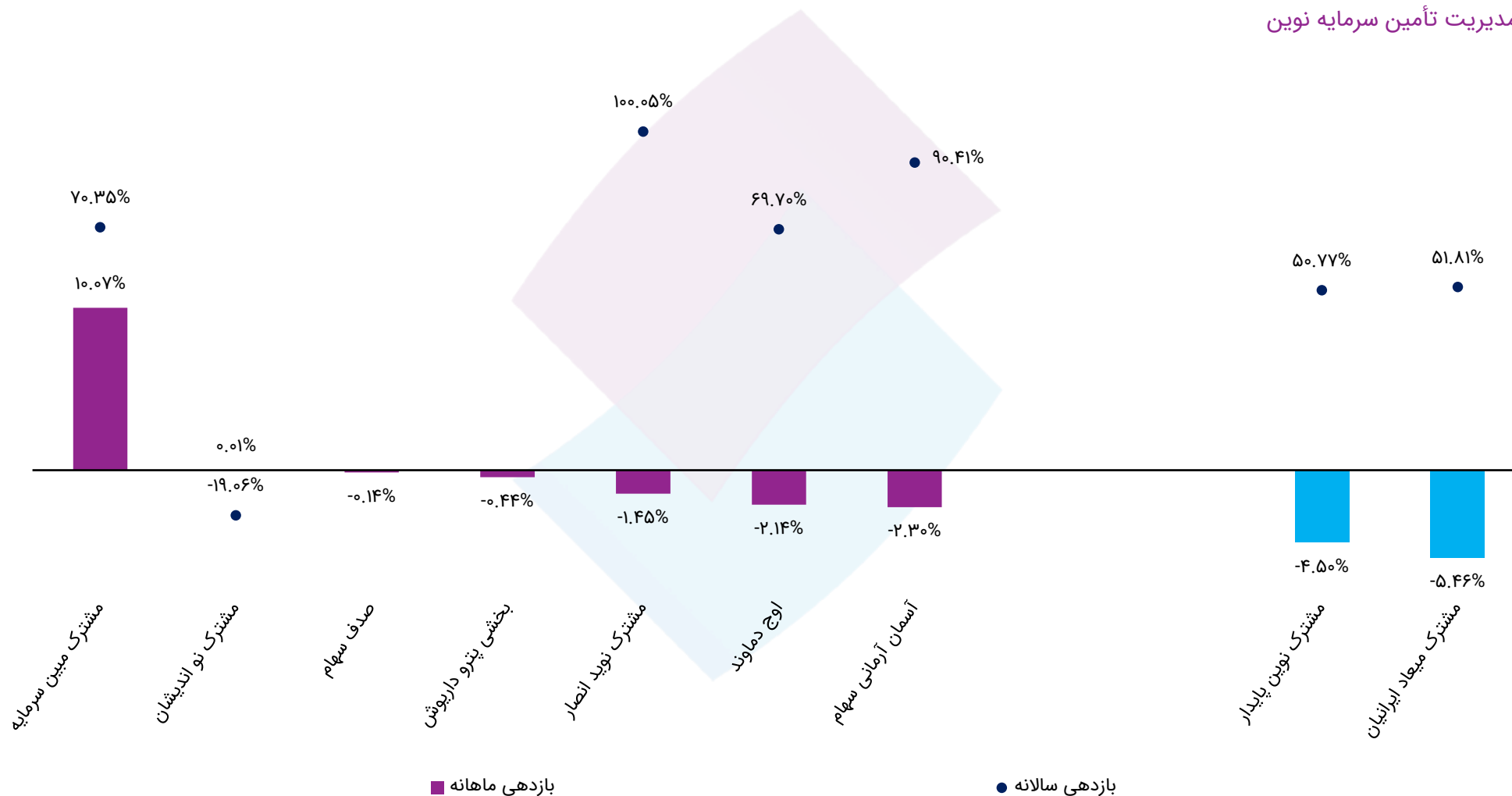


۲,۳۳۵ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۹۹۵ میلیارد تومانی هفته گذشته



صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

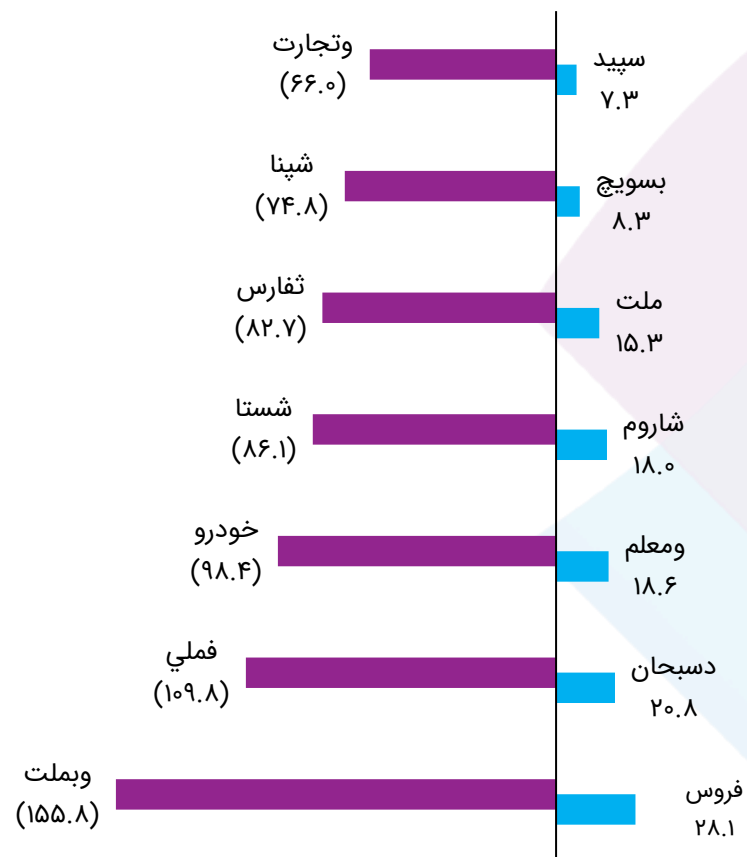


بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

نماد

صنعت

میلیارد تومان

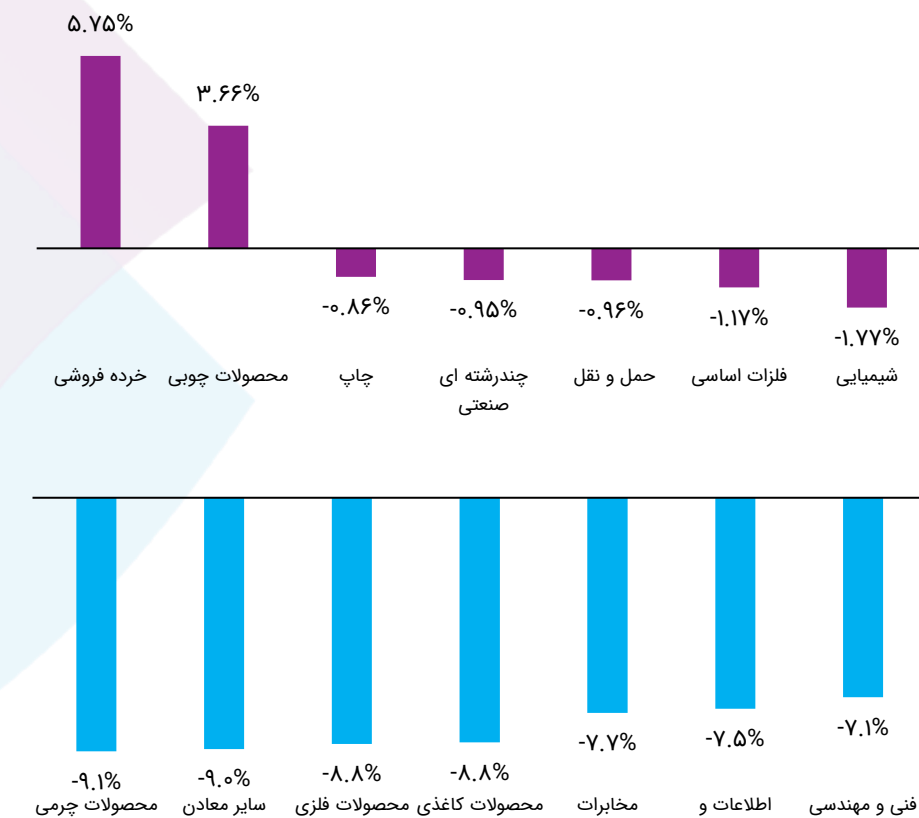
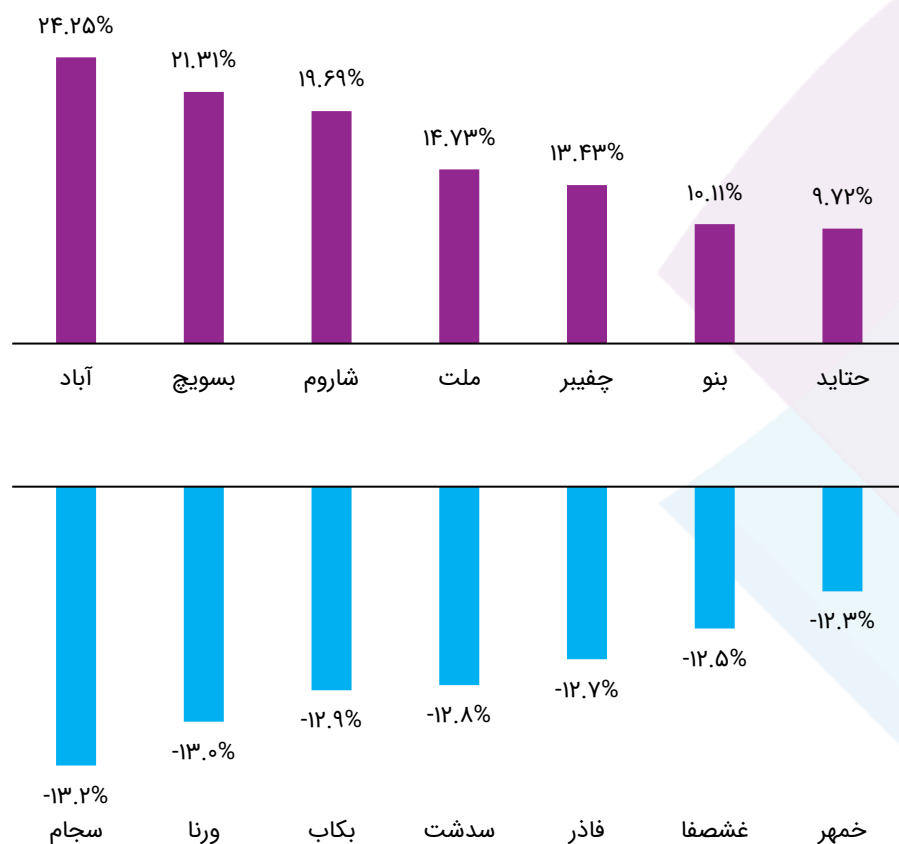


میلیارد تومان



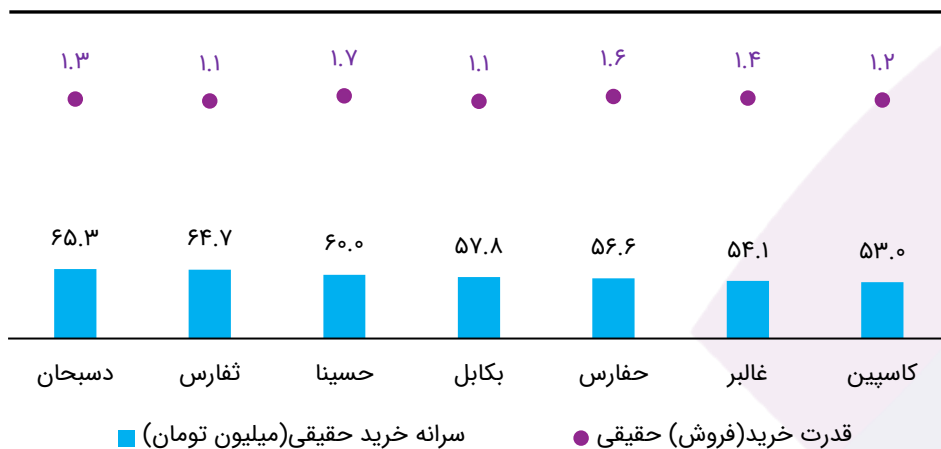
نماد

صنعت

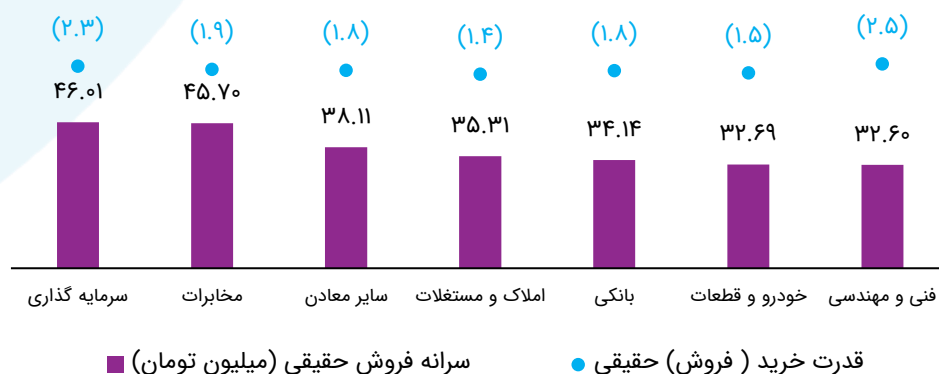
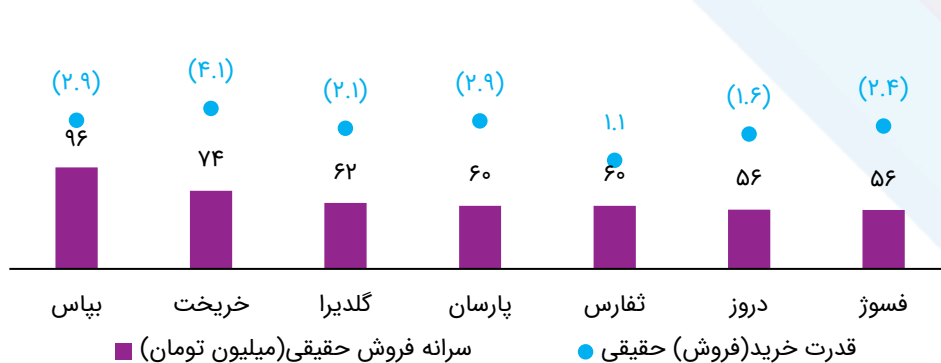
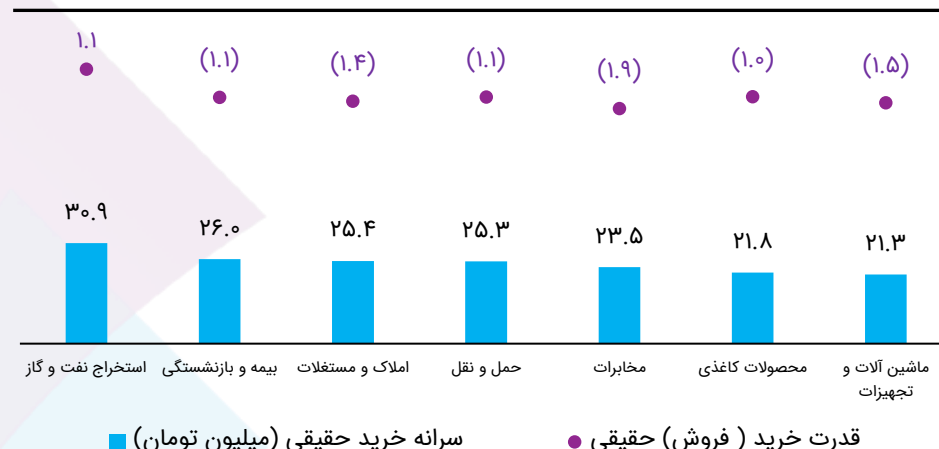


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



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 مجمع عمومی فوق العاده درخصوص افزایش سرمایه:					
ولساپا	۱,۴۵۴	۱,۹۶۳	۳۵%	سودانباشته	بهبود نسبتهای مالی، اعتباری و اصلاح ساختار مالی جلوگیری از خروج نقدینگی از طریق تامین منابع مالی ناشی از افزایش سرمایه
آباد	۲۴	۱,۱۸۶	۴۸۴۳%	تجدیدارزیابی	بهبود ساختار مالی
آیین	۱۸۰	۲۷۰	۵۰%	آورده نقدی	بهبود وضعیت باغ جهت افزایش تولید و بهره وری محصول پسته
فاما	۳۵۰	۵۵۰	۵۷%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی
تپسی	۲۴۶	۶۵۰	۱۶۴%	آورده نقدی	تامین سرمایه در گردش جهت تعمیق بازار شهرهای فعلی و توسعه زیرساخت و شبکه مشتریان نرم افزار تپسی
غزر	۱,۸۰۰	۲,۴۵۰	۳۶%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج نقدینگی، بهبود نسبت های مالی و در عین حال بهره مندی از مزایای مالیاتی
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه:					
شگستر	۲,۵۰۰	۴,۰۹۸	۶۴%	آورده نقدی با سلب حق تقدم	اجرای طرح های بیواتانول کرمانشاه و باشت در چارچوب "دستورالعمل نحوه صدور مجوز عرضه عمومی شرکت پروژه (سهامی عام)"
وپویا	۷۰۰	۹۵۰	۳۶%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی

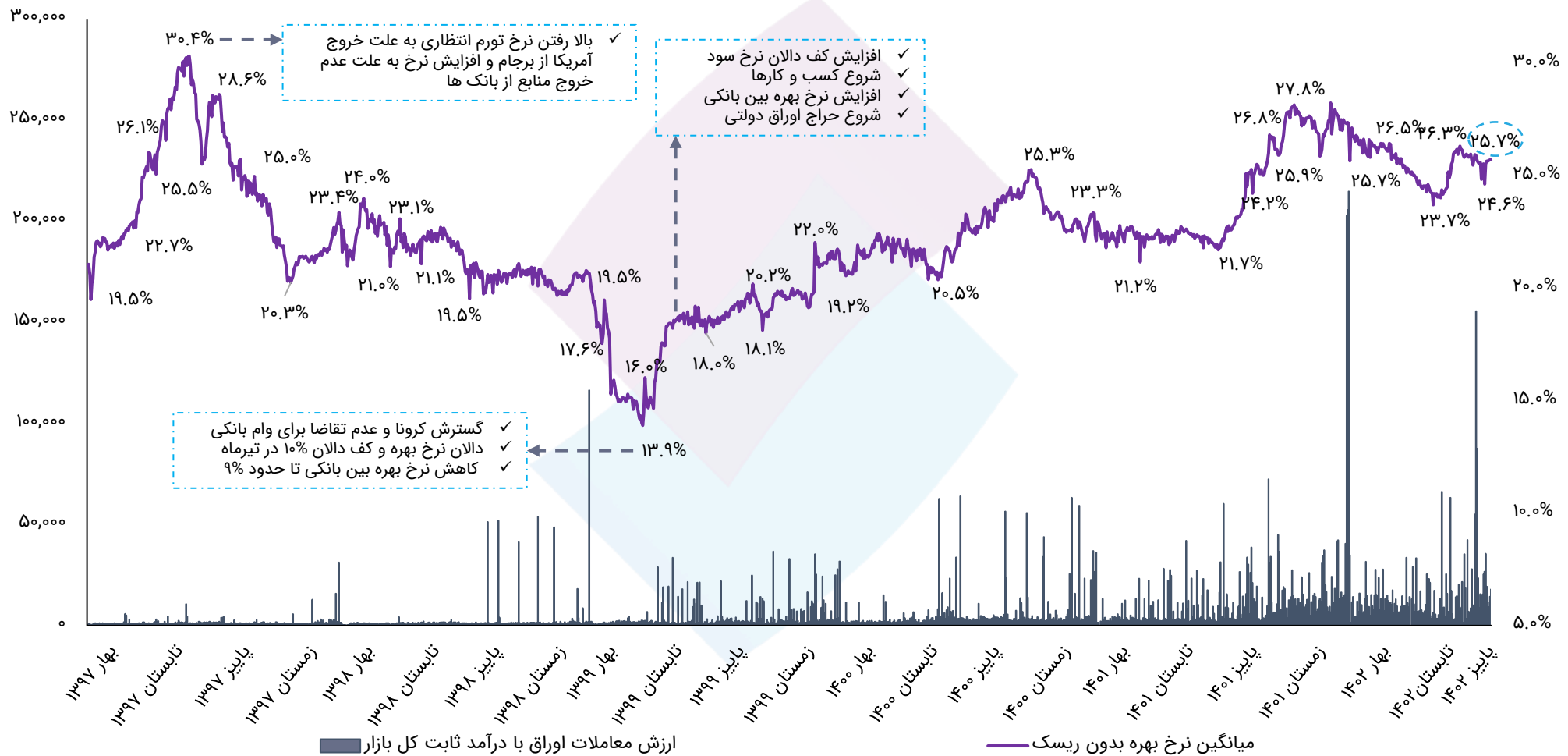
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی سرمایه جدید (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
صدور مجوز افزایش سرمایه:					
قرن	۴۰۰	۶۰۰	۵۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج نقدینگی و حفظ سرمایه در گردش
قشهد	۶۹	۱۰۴	۵۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی، بهبود وضعیت سرمایه در گردش و استفاده از معافیت مالیاتی
فنورد	۱۵۸	۳۱۷	۱۰۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی
شپلی	۳۵۷	۲,۷۹۵	۶۸۳%	تجدیدارزیابی	اصلاح ساختار مالی در راستای حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالاهای ایرانی و خروج از شمولیت ماده ۱۴۱
افق	۱,۲۵۰	۲,۰۰۰	۶۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی و تامین سرمایه در گردش مورد نیاز
فروس	۴۰۰	۸۰۰	۱۰۰%	سودانباشته	اجرای طرح توسعه افزایش ظرفیت اسمی تولید فروسیلیس
خلیل	۱۴۷	۱,۹۹۵	۱۲۵۸%	تجدیدارزیابی	اصلاح ساختار مالی
ویسا	۱۱۴	۳۴۲	۲۰۰%	آورده نقدی(۶۰%) سودانباشته(۴۰%)	توسعه سرمایه گذاری ها، جبران مخارج سرمایه گذاری های انجام شده و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر
گوهران	۶۵۰	۱,۰۰۰	۵۴%	آورده نقدی(۸۶%) سودانباشته(۱۴%)	جبران مخارج سرمایه گذاری های انجام شده، انجام سرمایه گذاری جدید و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر
افرا	۶۳	۱۱۰	۷۶%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی
فلوله	۶۷۰	۸۳۰	۲۴%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی و استفاده از مزایای تخفیف مالیاتی
امید	۱,۵۲۰	۲,۱۷۸	۴۳%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی، بهینه نمودن ساختار سرمایه و توسعه و افزایش حجم عملیات شرکت
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه:					
وسرمد	۶۷۶	۱,۰۰۰	۴۸%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی، توسعه فعالیتهای بیمه ای و رعایت قانونی بیمه مرکزی
فراپورس	۸۴۰	۱,۰۵۰	۲۵%	سودانباشته(۷۶%) سایراندوخته(۲۴%)	اجرای مصوبه در خصوص "تعیین حداقل سرمایه مطلوب بورس ها" و تقویت ساختار مالی
کیمیاتک	۴۰۰	۶۰۰	۵۰%	سودانباشته	تامین سرمایه در گردش
فصبا	۵۵۰	۵,۰۰۰	۸۰۹%	آورده نقدی با سلب حق تقدم	اجرای طرح احداث واحد احیای مستقیم با ظرفیت سالیانه ۱/۷۶ میلیون تن بریکت گرم

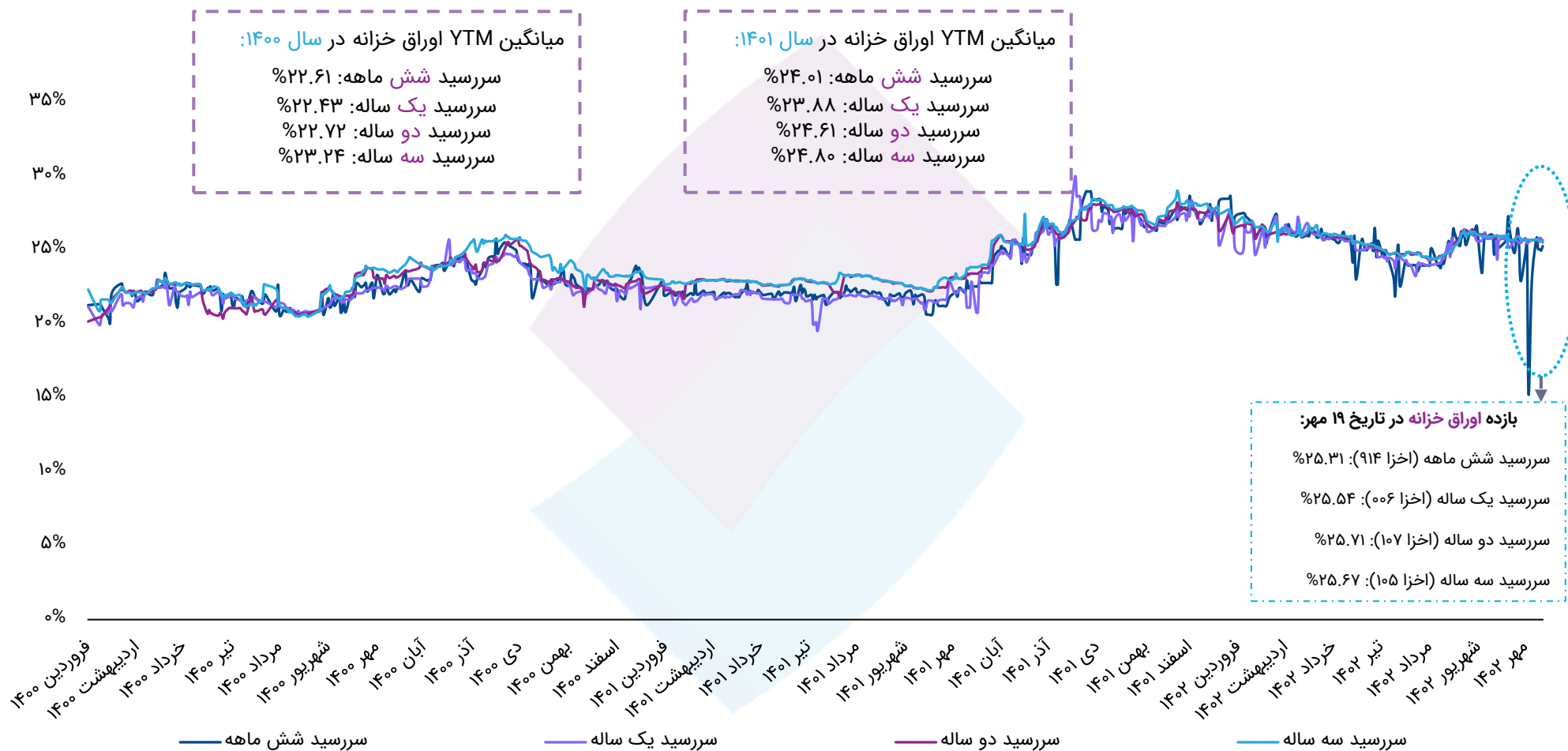
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه	سایر توضیحات
آگهی ثبت افزایش سرمایه:						
رافزا	۳۵	۱۰۰	۱۸۶%	آورده نقدی	به منظور اصلاح ساختار مالی و جبران مخارج سرمایه ای انجام شده	مهلت استفاده از حق تقدم سهام از تاریخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۳ تا ۱۴۰۲/۰۹/۱۲ است.
اعلامیه پذیره نویسی عمومی:						
ولبهمن	۳۲۰	۵۲۰	۶۳%	آورده نقدی	افزایش نقدینگی و حد اعتباری شرکت جهت خرید خودرو و واگذاری در قالب قرارداد اجاره بشرط تملیک و گسترش عملیات لیزینگ	مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۷ تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۸/۰۱ است.
آگهی ثبت افزایش سرمایه:						
وهور	۶,۶۱۸	۷,۶۱۸	۱۵%	آورده نقدی	سرمایه گذاری در شرکت فرعی مولد نیروگاهی گوهر سیرجان	
حآسا	۸۰	۱۸۰	۱۲۵%	آورده نقدی (۵۶%) سود انباشته (۴۴%)	توسعه ناوگان ریلی	
اعتلا	۲۰۵	۳۰۵	۴۹%	آورده نقدی	حفظ نقدینگی شرکت و عدم خروج نقدینگی مذکور و همچنین ارتقاء بیشتر سودآوری	

افزایش ۰.۲ واحدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۲۵.۷ درصد

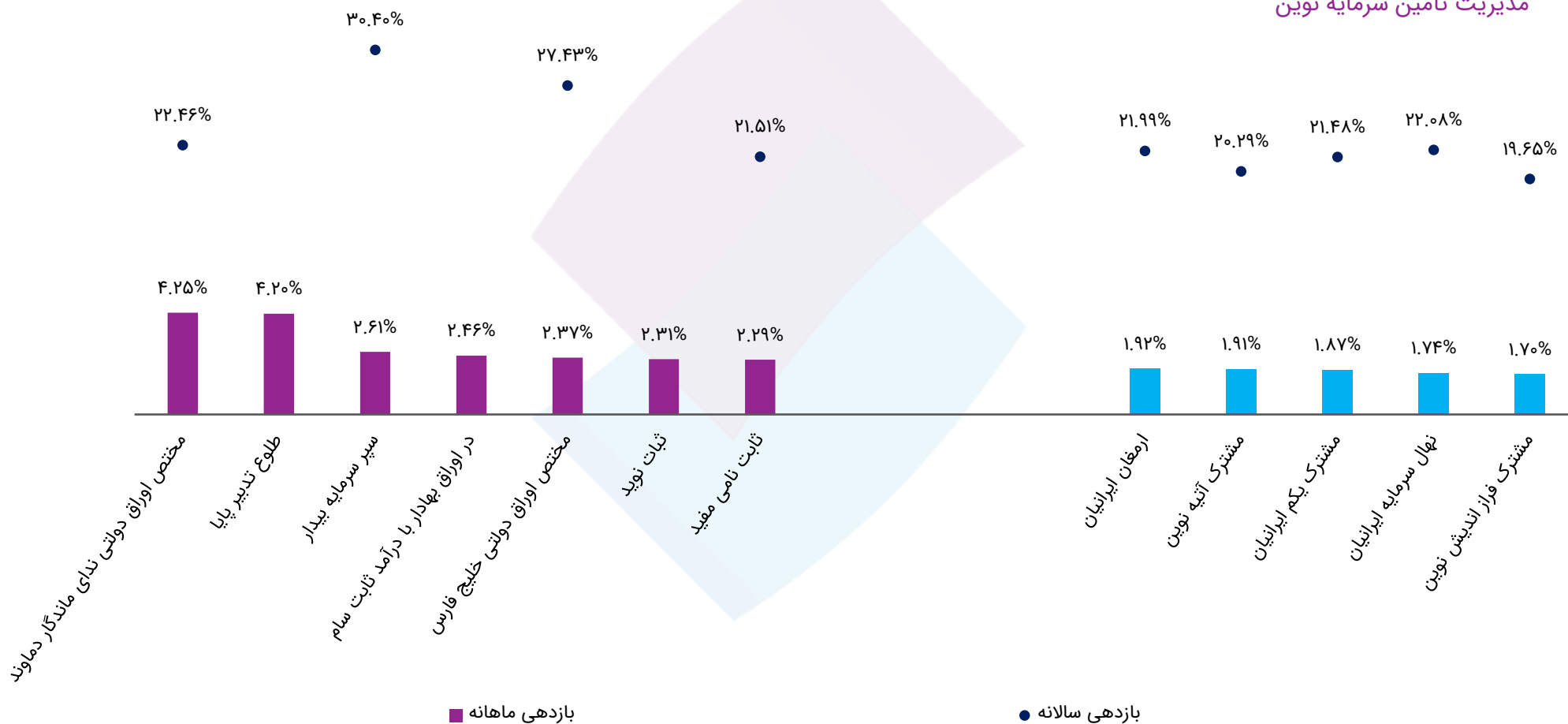


بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

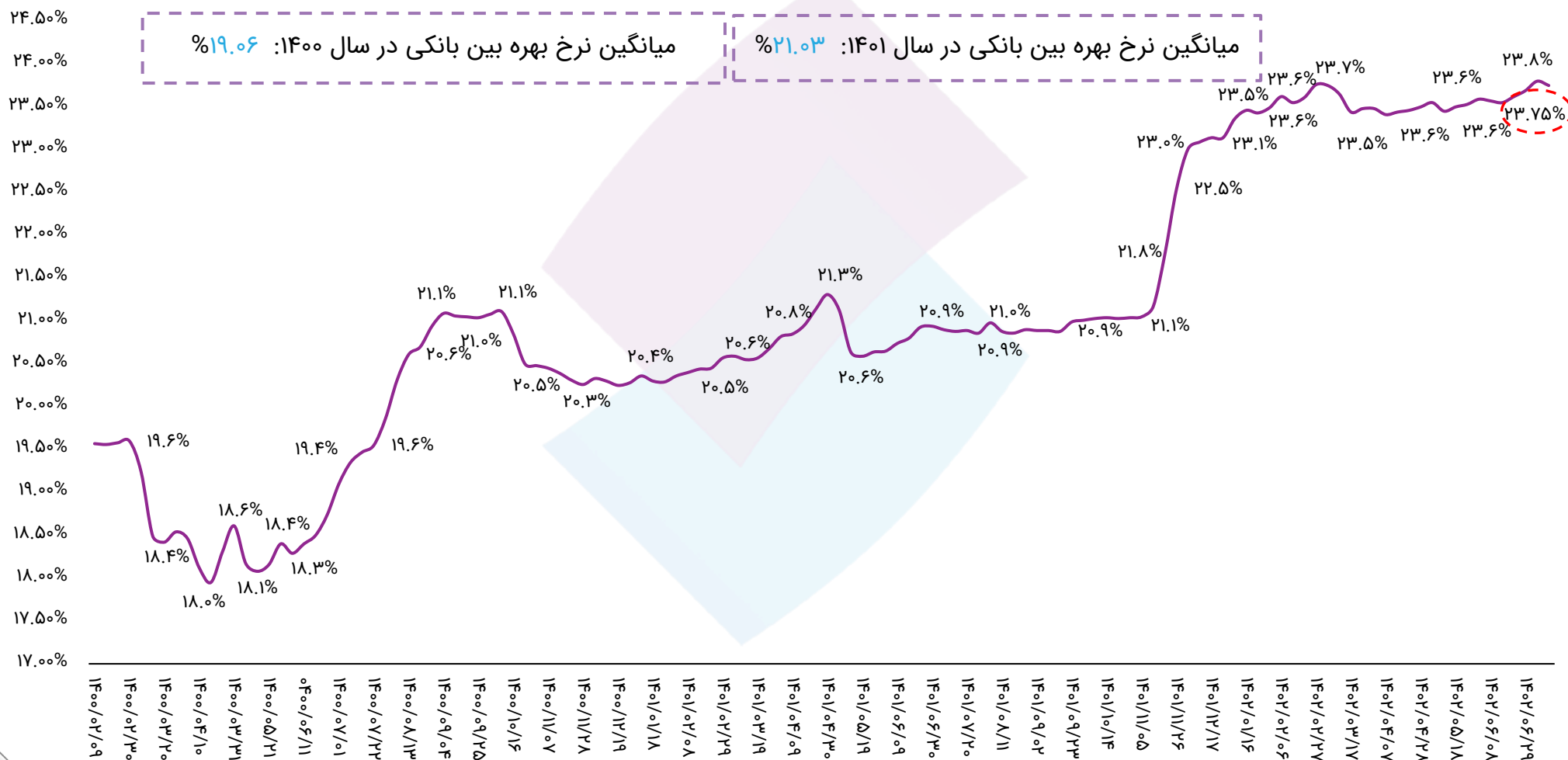


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

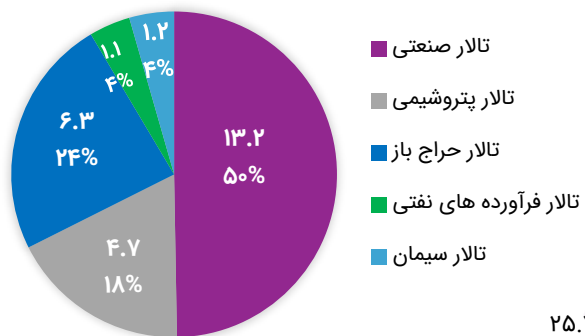


کاهش ۰.۵۰ درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۷۵ و اجرای دهمین حراج اوراق مالی اسلامی به ارزش ۱.۸۲ همت



روند ارزش معاملات بورس کالا

سهم هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



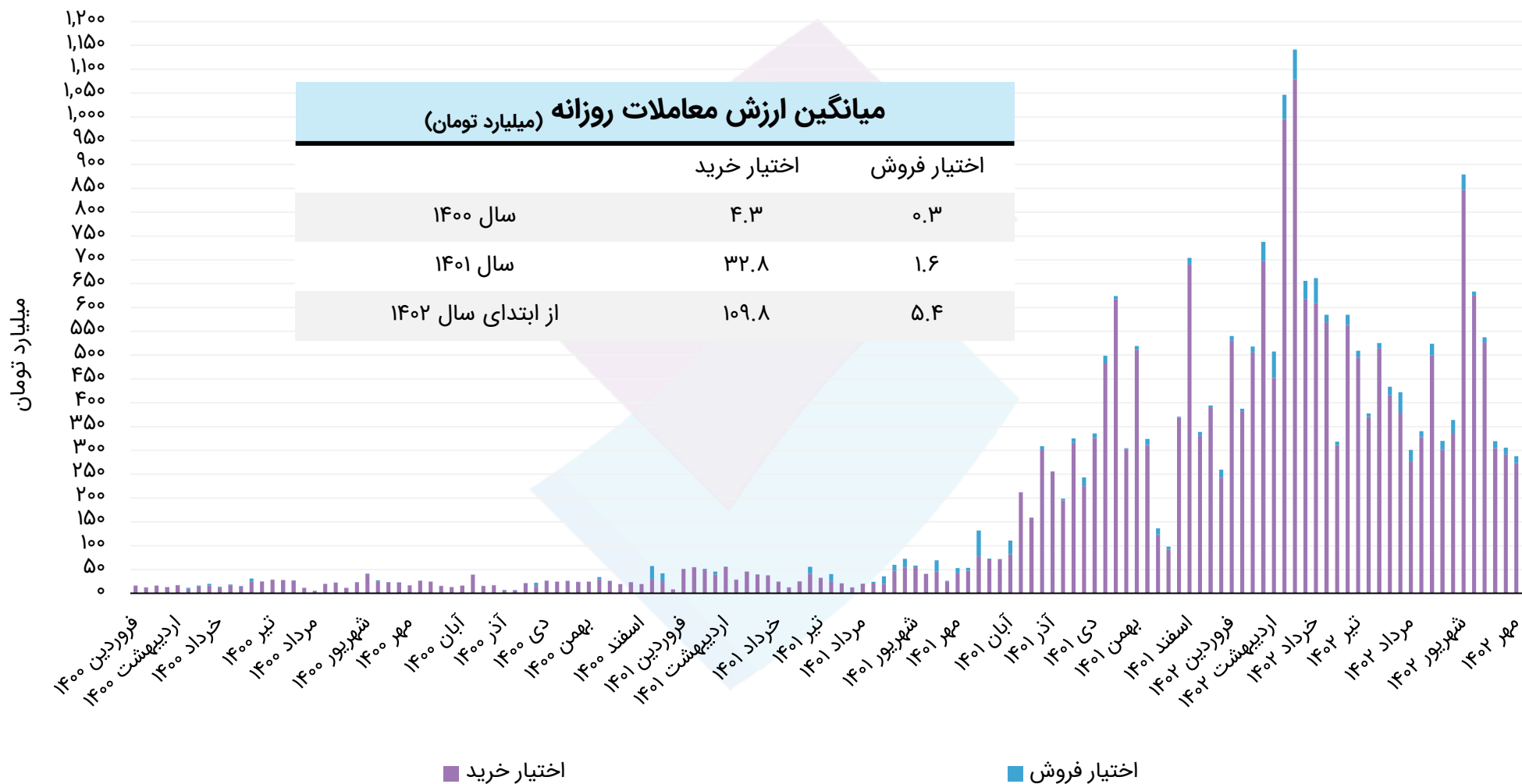
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (هزار ریال بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
شمش بلوم	۱۹۴,۳۰۵	۲۲۲,۵۱۰	فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد سیرجان ایرانیان، مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد، آهن و فولاد ارفع، شرکت فولاد زرند ایرانیان، جهان فولاد سیرجان، مجتمع فولاد خراسان، فولاد بوتیای ایرانیان، گسترش خدمات آتیه اندیشان سپهر شرق، ذوب آهن البرز غرب
وکیوم باتوم	۱۳۴,۸۹۴	۱۷۳,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند
آهن اسفنجی	۱۲۸,۴۰۰	۱۴۶,۰۰۰	سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، صبا فولاد خلیج فارس، فولاد غدیر نی ریز، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، پارس فولاد سبزواری، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر، احیاء استیل فولاد بافت، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، فولاد خوزستان
گندله سنگ آهن	۴۶,۷۰۴	۳۷۷,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، صنعتی و معدنی اپال پارسین سنگان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، سنگ آهن گل زمین
میلگرد	۲۲۱,۳۴۰	۷۰,۸۴۰	صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، مجتمع فولاد خراسان، جهان فولاد سیرجان، تولیدی فولاد سپید فراب کویر، فولاد شاهرود، ذوب آهن اصفهان، فولاد آلیاژی ایران، فولاد کاوه اروند، صبا فولاد زاگرس، گروه ملی صنعتی فولاد ایران
مس کاتد	۳,۶۵۲,۲۸۲	۴,۰۴۰	ملی صنایع مس ایران، گسترش و نوسازی معادن خاور میانه
تختال	۱۹۵,۱۰۰	۶۳,۵۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب
سیمان	۹,۵۹۳	۱,۲۲۹,۵۹۵	سیمان تهران، سیمان آبیک، سیمان ساوه، سیمان صوفیان، سیمان هرمزگان، سیمان خوزستان، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان ارومیه، سیمان آرتا اردبیل، سیمان سپاهان، سیمان مازندران، سیمان عمران انارک، سیمان کرمان، سیمان ممتازان کرمان، سیمان هگمتان، سیمان بجنورد، سیمان فارس نو، سیمان فراز فیروزکوه، سیمان شرق، سیمان نیاز قم، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان غرب، سیمان شاهرود
لوب کات	۲۰۶,۱۵۹	۴۶,۵۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت اصفهان
کنسانتره سنگ آهن	۳۶,۰۵۰	۱۷۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، سنگ آهن گل زمین، توسعه معدنی و صنعتی صابانور
مس مفتول	۳,۷۳۱,۳۶۸	۱,۶۶۵	ملی صنایع مس ایران، صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، گیل راد شمال
پلی اتیلن ترفتالات	۵۰۶,۱۸۶	۱۲,۰۱۲	پتروشیمی تندگویان
ورق سرد	۳۲۳,۷۹۶	۱۶,۷۵۰	فولاد غرب آسیا، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس
پلی پروپیلن نساجی	۵۱۸,۱۰۰	۹,۹۳۰	پتروشیمی مارون، پتروشیمی شازند، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم، پتروشیمی رجال، نوید زرشمی، پتروشیمی پلی نار
شمش آلومینیوم	۱,۰۹۷,۹۲۰	۴,۵۵۰	آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی

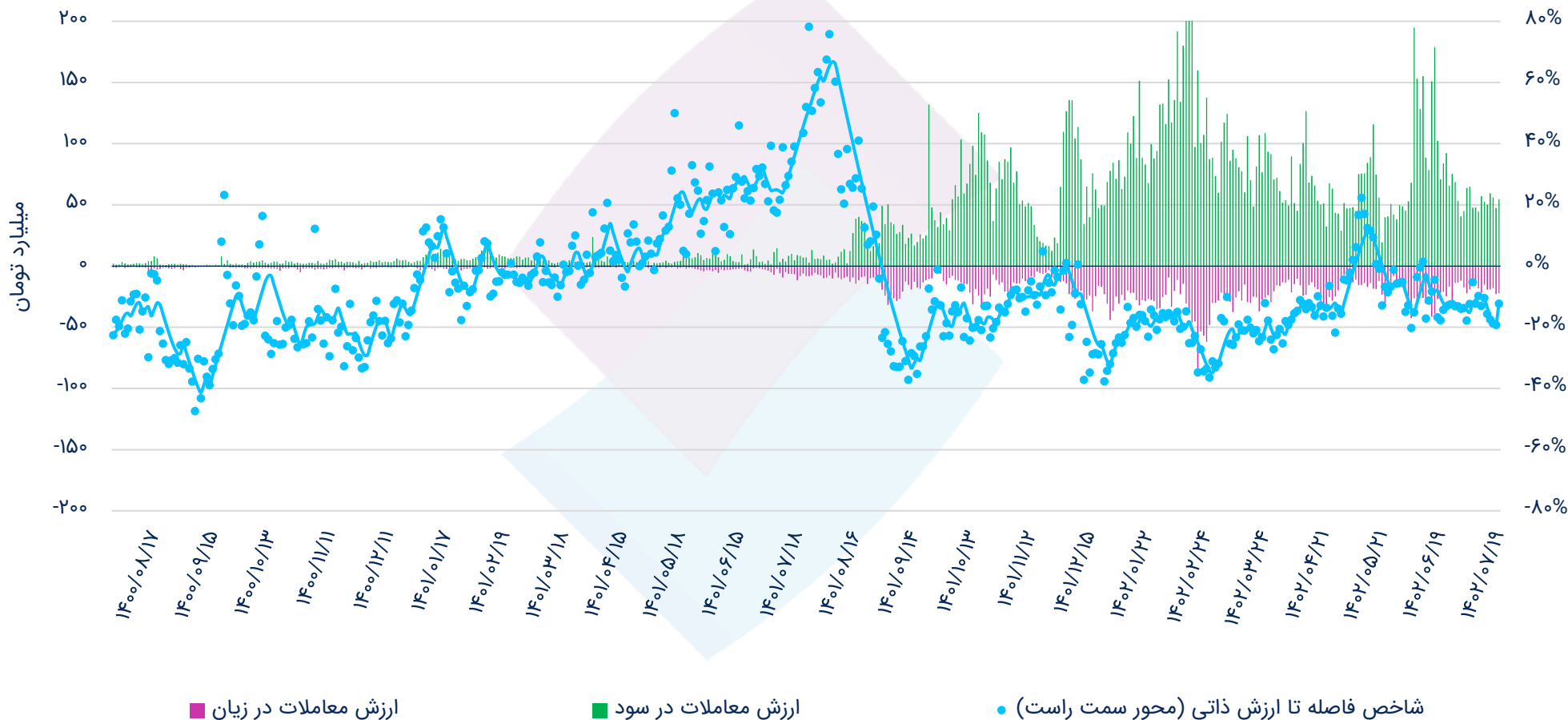
افزایش ۱۵.۵۴ درصدی قیمت گاز طبیعی در پی ایجاد تنش‌ها در خاورمیانه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۱۲.۱۱%	۱,۶۶۷	-۲.۸۲%	۱,۹۲۳	۲.۵۹%	۱,۸۲۱	۱,۸۶۸	طلا (دلار/انس)
۹۳.۸۵%	۱۴۹,۰۵۰	۳.۳۷%	۲۷۹,۵۱۰	۶.۶۱%	۲۷۱,۰۱۰	۲۸۸,۹۳۰	سکه (هزار ریال)
۰.۰۰%	۰	-۰.۱۹%	۴۱۲,۸۳۹	-۰.۰۲%	۴۱۲,۱۵۱	۴۱۲,۰۷۳	دلار اسکنا (ریال)
۰.۰۰%	۰	-۰.۱۹%	۳۷۵,۳۰۸	-۰.۰۲%	۳۷۴,۶۸۳	۳۷۴,۶۱۲	دلار حواله (ریال)
-۶.۶۴%	۹۳.۸	-۳.۳۶%	۹۰.۶۱	۱.۷۲%	۸۶.۰۹	۸۷.۵۷	نفت برنت (دلار/بشکه)
۴۲.۴۲%	۱۹,۰۵۱	۷.۸۳%	۲۵,۱۶۳	-۲.۳۹%	۲۷,۷۹۹	۲۷,۱۳۴	بیت کوین (دلار)
۴.۲۵%	۷,۵۸۵	-۵.۱۰%	۸,۳۳۲	-۰.۰۴%	۷,۹۱۰	۷,۹۰۷	مس LME (دلار/تن)
-۱۷.۸۴%	۲,۹۶۵	-۰.۰۴%	۲,۴۳۷	-۲.۵۶%	۲,۵۰۰	۲,۴۳۶	روی LME (دلار/تن)
-۱۰.۵۲%	۵۲۳	۰.۴۳%	۴۶۶	۳.۵۴%	۴۵۲	۴۶۸	بیلت CIS (دلار/تن)
۰.۴۲%	۴۷۵	۰.۰۰%	۴۷۷	۰.۱۷%	۴۷۶.۲	۴۷۷	بیلت ایران (دلار/تن)
-۱۵.۶۶%	۳۳۲	۱.۰۸%	۲۷۷	۰.۰۰%	۲۸۰	۲۸۰	متانول CFR (\$/mt)
-۳۵.۸۶%	۶۳۸	۱.۰۰%	۴۰۵	۱.۰۷%	۴۰۵	۴۰۹	سبب اوره (mt/\$)
-۴۴.۸۴%	۶.۲	۳۶.۸۰%	۲.۵	۱۵.۵۴%	۲.۹۶	۳.۴۲	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



شاخص فاصله تا ارزش ذاتی^(۱) - اختیار خرید

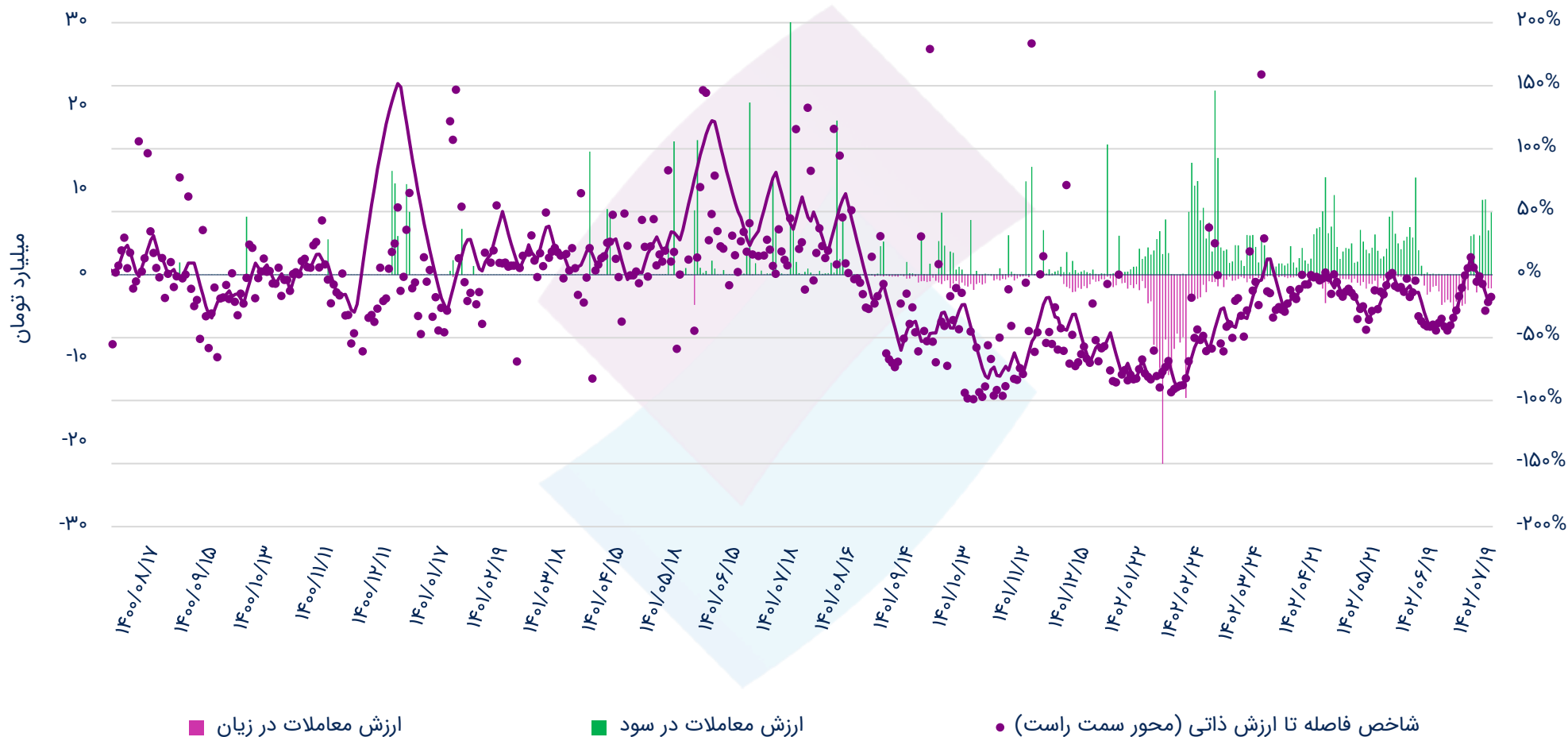


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی^(۱) - 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)
ضخود ۸۰۱۸	۱۴	۲,۶۰۰	۱۲۲.۸
ضسپا ۱۰۰۲	۹۱	۲,۶۰۰	۴۴.۳
ضهرم ۱۲۱۹	۱۵۴	۱۳,۰۰۰	۳۳.۵
طخود ۸۰۱۹	۱۴	۲,۸۰۰	۲۸.۸
ضخود ۸۰۱۹	۱۴	۲,۸۰۰	۱۲.۲



ثبت نام آنلاین آئی

دوست دار طبیعت باشیم

NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیازهای نوین

→ My.Nibb.ir



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



سلب مسئولیت

این گزارش صرفاً جهت اطلاع از شرایط بازارها تهیه شده است، محتوای آن نباید به تنهایی جهت اتخاذ 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 در این گزارش به هیچ عنوان توصیه‌ای به خرید و فروش یا نگهداری سهام ندارد و مسئولیت استفاده از اطلاعات آن با خوانندگان این گزارش است.



خیابان ولیعصر، خیابان همایون شهنواز، پلاک ۱۱۰

☎ ۰۲۱ - ۲۲۰ ۳۰ ۳۴۹

🌐 www.nibb.ir

📷 [nibb.ir](https://www.instagram.com/nibb.ir)

☎ ۰۲۱ - ۸۶۷۹ ۱۰۰۰

✉ info@nibb.ir

🌐 [nibb](https://www.linkedin.com/company/nibb)

📍 [nibbroker](https://www.google.com/maps/place/nibbroker)