

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 ۲۹ فروردین - شماره ۱۴۶

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
۱۶	نرخ بهره بدون ریسک
۱۷	اوراق خزانه
۱۸	صندوق‌های با درآمد ثابت
۱۹	نرخ بهره بین بانکی
۲۰	معاملات مرکز مبادله طلا و ارز
۲۲	قیمت‌های جهانی
۲۳	روند ارزش معاملات در بورس کالا
۲۴	بیشترین ارزش معاملات در بورس کالا
۲۵	روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله
۲۶	شاخص فاصله تا ارزش ذاتی
۲۸	بیشترین ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



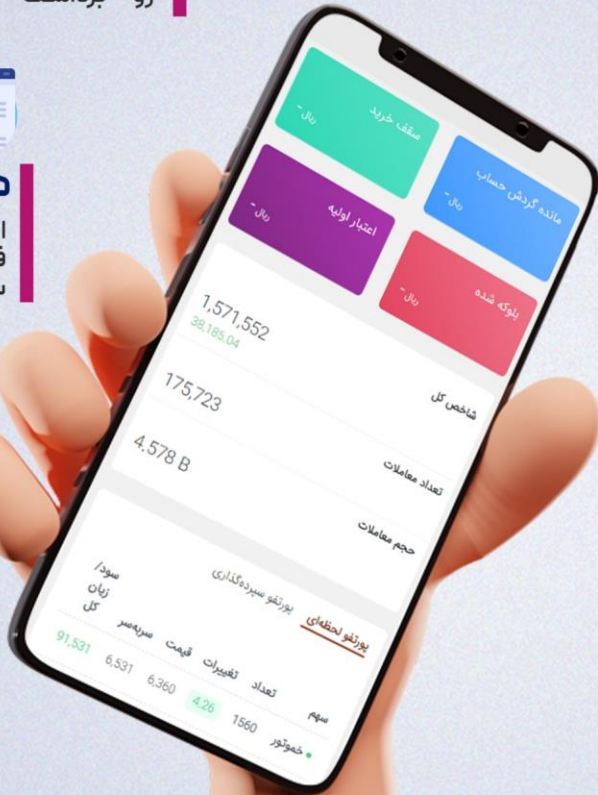
برداشت وجه آئی

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



ثبت نام آئی

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 نیاز های نوین

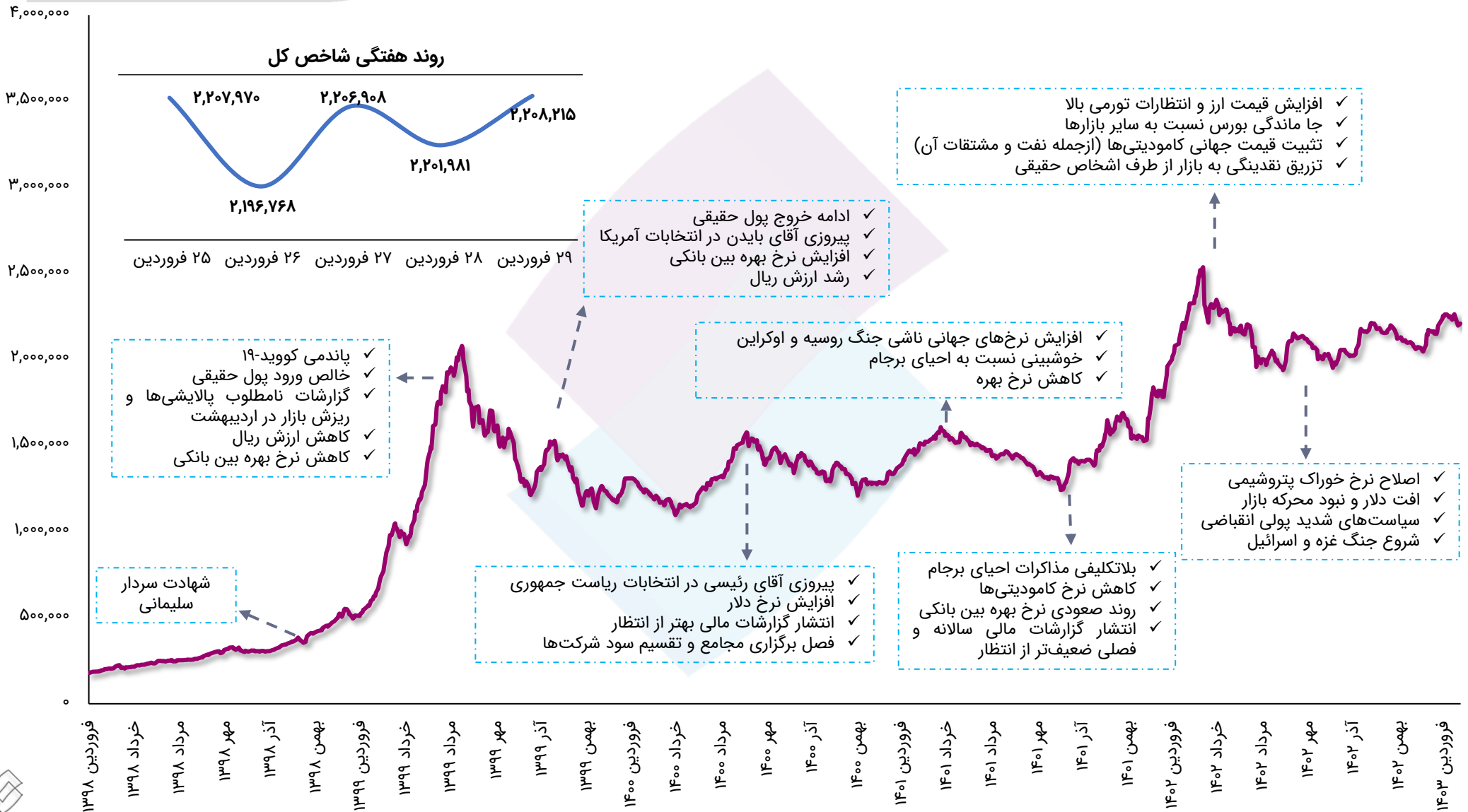
My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

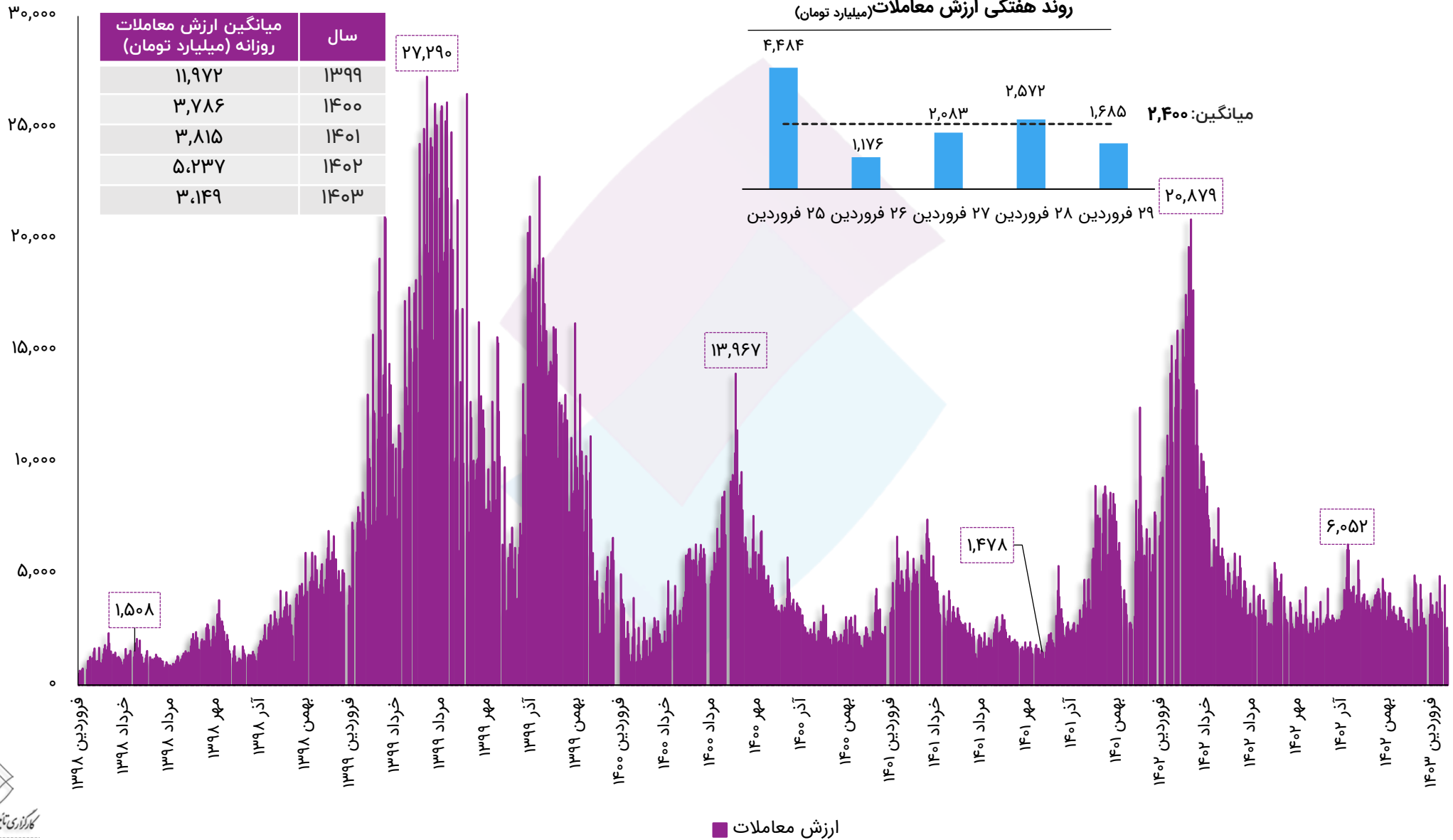


وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

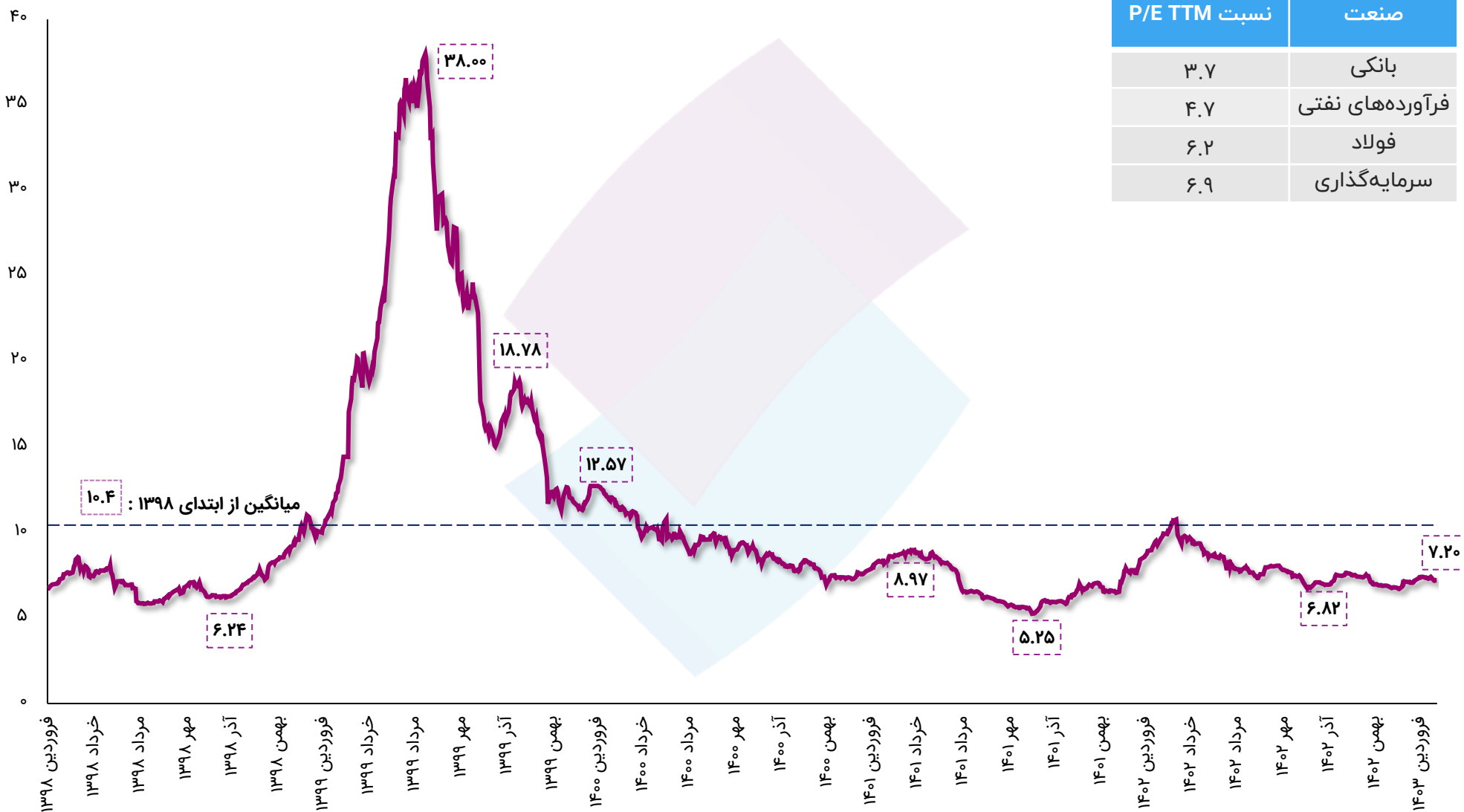
کاهش ۲.۴ درصدی شاخص کل در هفته جاری



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران

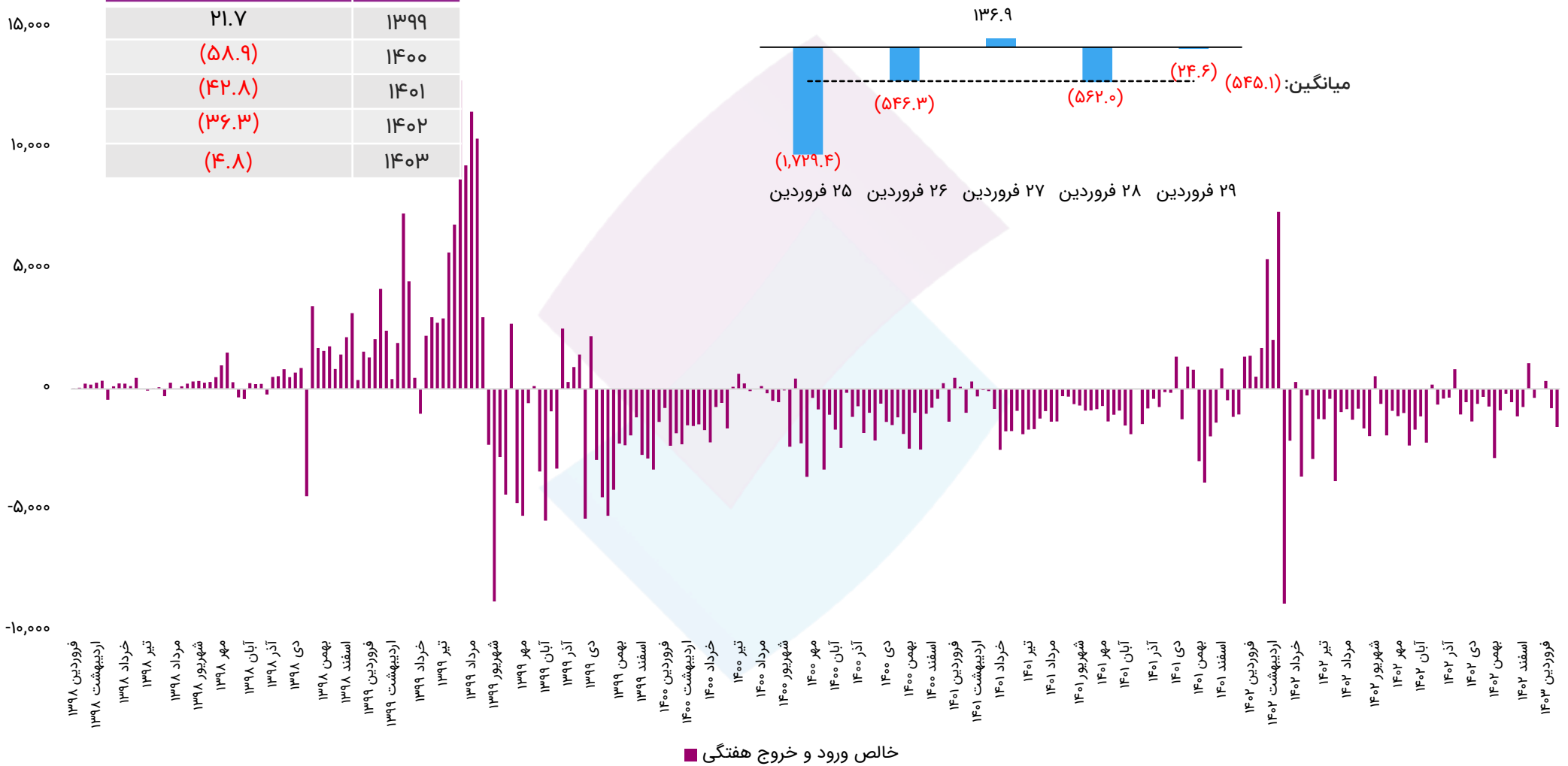


نسبت P/E TTM	صنعت
۳.۷	بانکی
۴.۷	فرآورده‌های نفتی
۶.۲	فولاد
۶.۹	سرمایه‌گذاری

۲،۷۲۵ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱،۵۷۲ میلیارد تومانی هفته گذشته

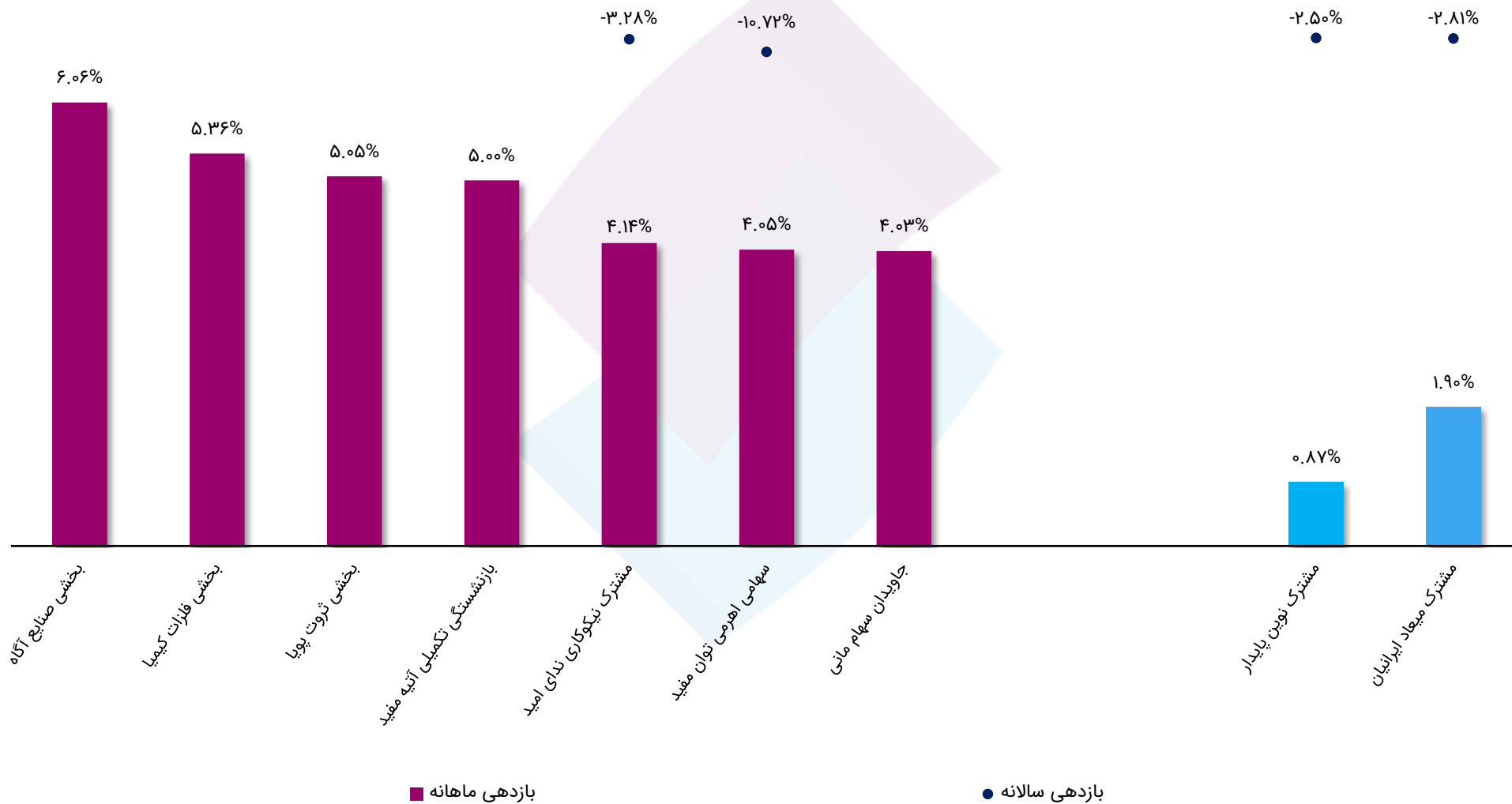
سال	خالص ورود حقیقی (همت)
۱۳۹۹	۲۱.۷
۱۴۰۰	(۵۸.۹)
۱۴۰۱	(۴۲.۸)
۱۴۰۲	(۳۶.۳)
۱۴۰۳	(۴.۸)

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)



صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

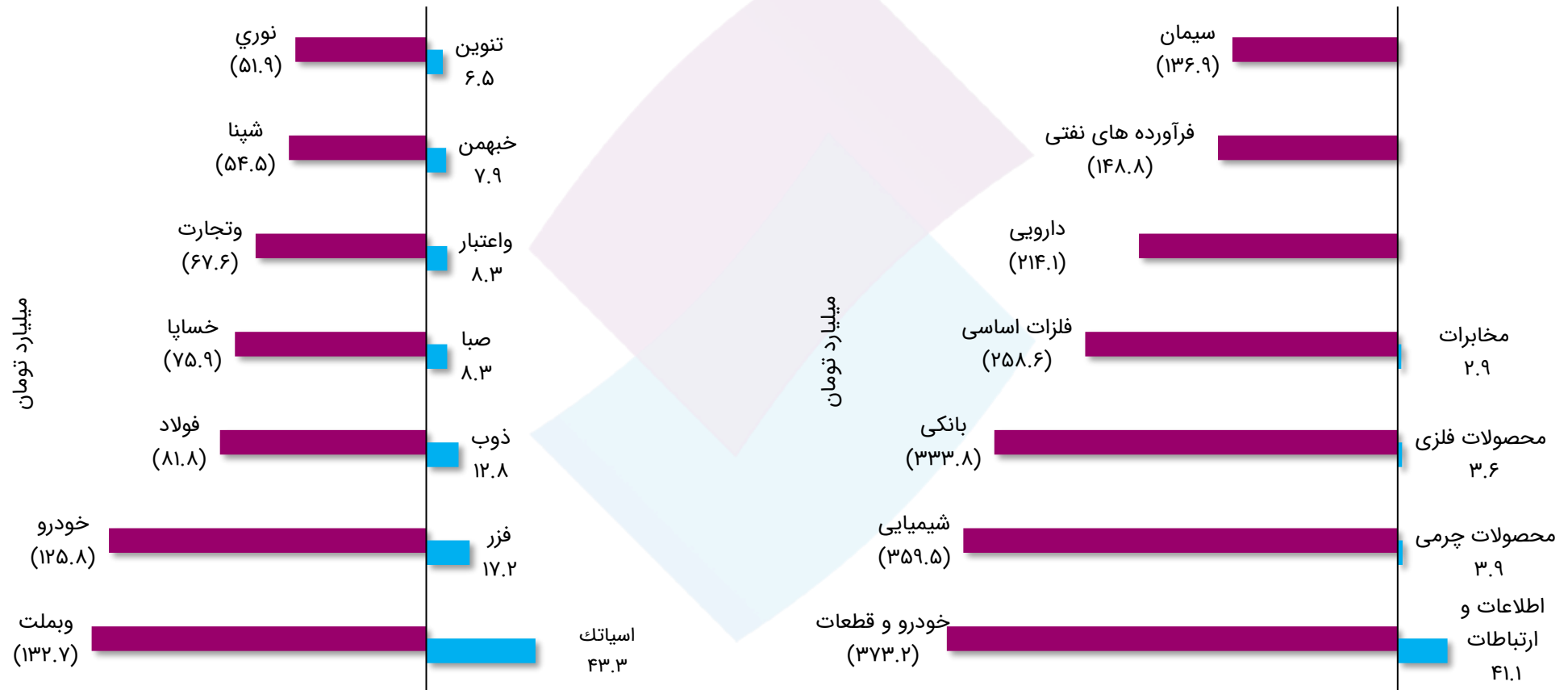
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

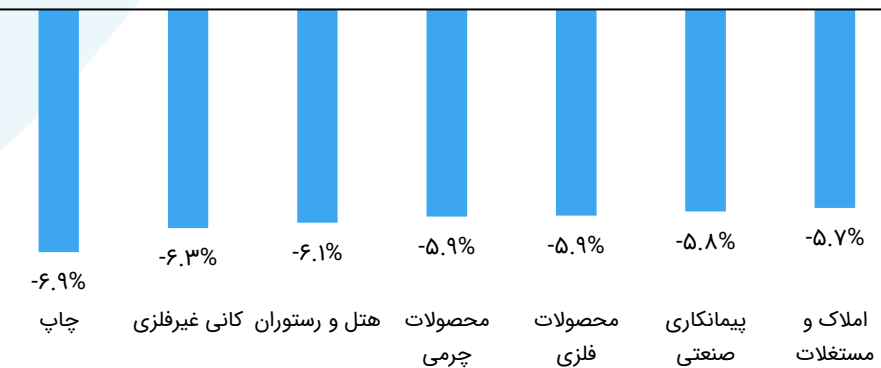
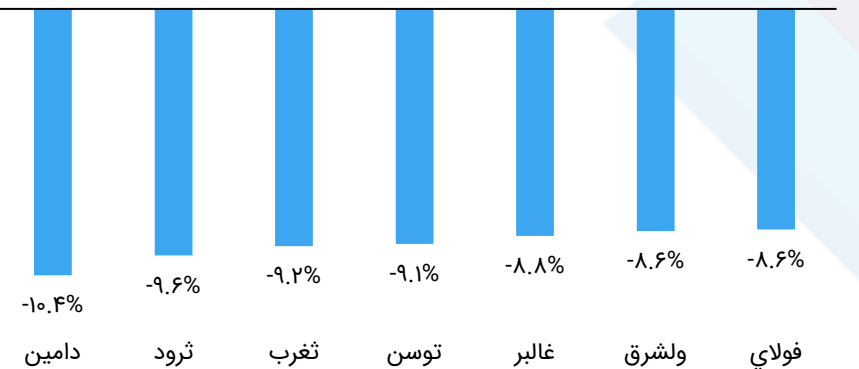
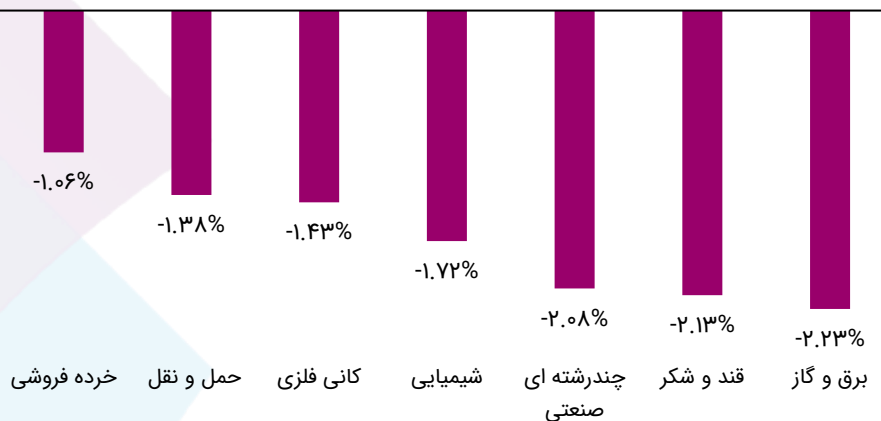
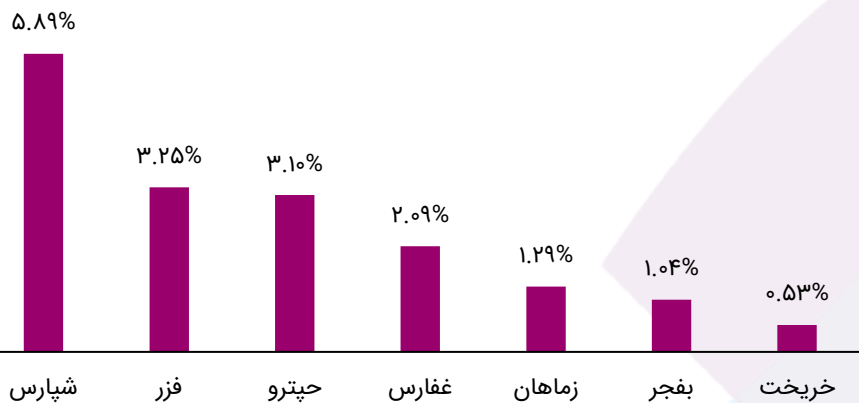
نماد

صنعت



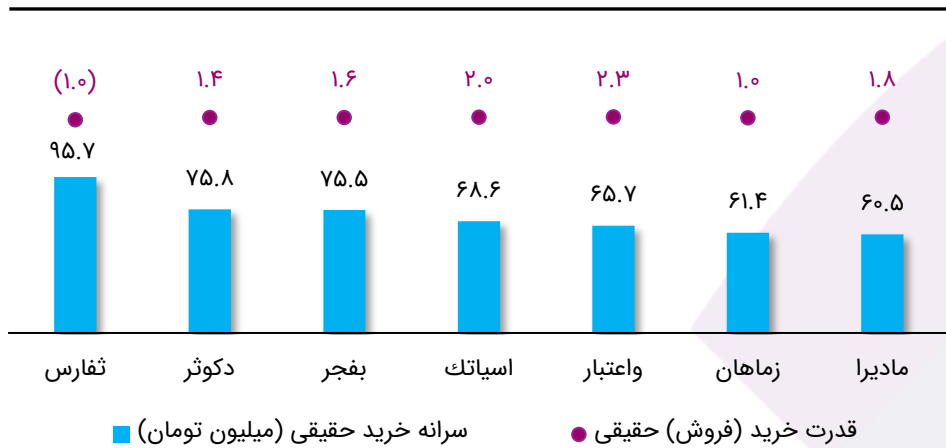
نماد

صنعت

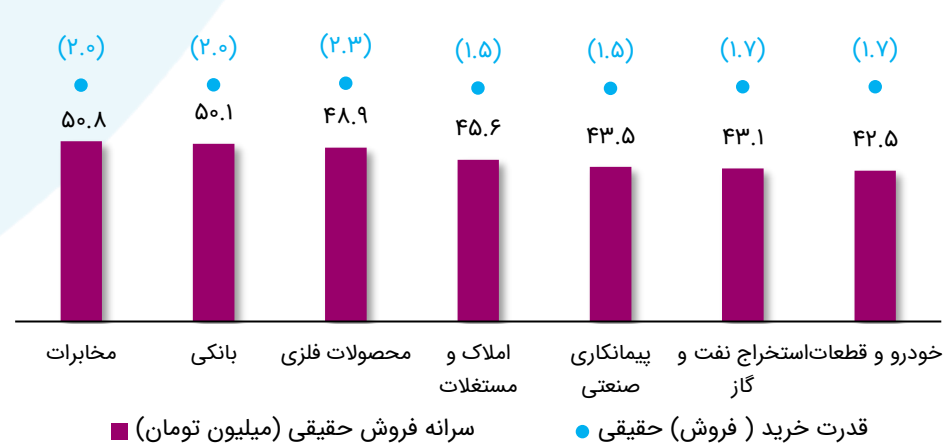
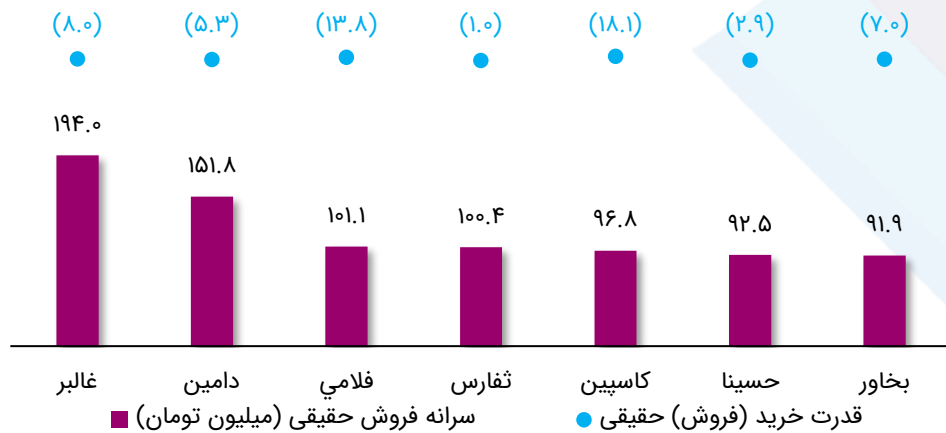
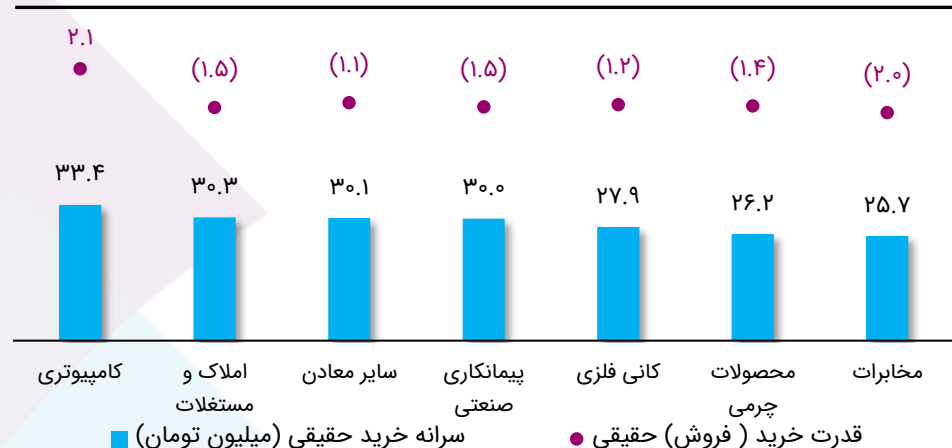


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد

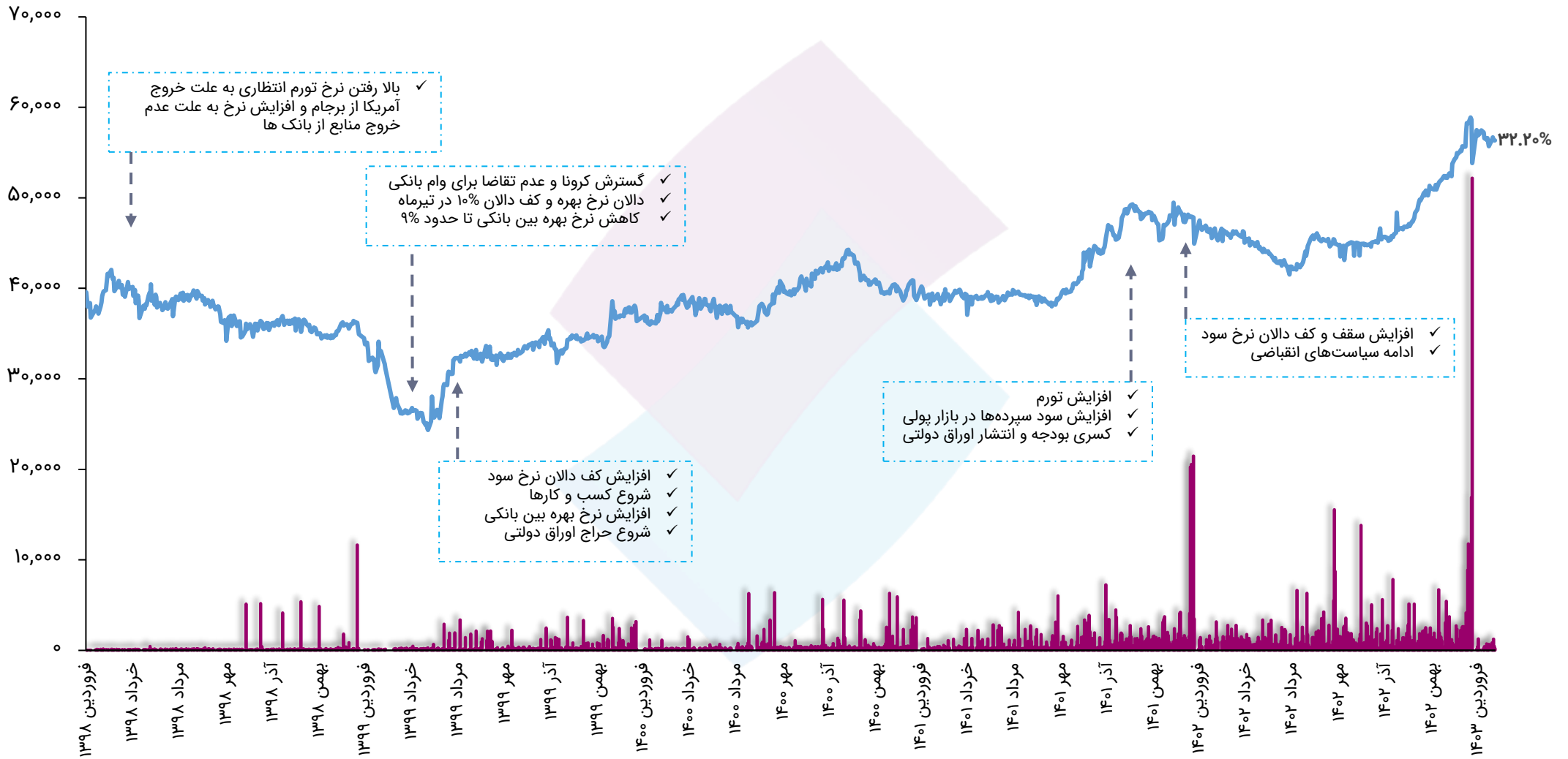


صنعت



موضوع افزایش سرمایه	محل افزایش سرمایه	تغییرات (درصد)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	نماد
آگهی ثبت افزایش سرمایه:					
اصلاح ساختار مالی، جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر	سودانباشته	۵۶%	۳۰,۰۰۰	۱۹,۲۴۳	ومعادن
اصلاح ساختار مالی	سودانباشته	۱۰۰%	۱۲۰	۶۰	خلنت
اصلاح ساختار مالی	سودانباشته (۶۷%) اندوخته (۳۳%)	۲۵%	۱,۵۰۰	۱,۲۰۰	وآفری
اصلاح ساختار مالی، افزایش سهم بازار و توسعه فعالیت لیزینگ	سودانباشته	۵۰%	۶۰۰	۴۰۰	ولصنم
تصمیمات مجمع عمومی فوق‌العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه:					
اصلاح ساختار مالی	آورده نقدی	۹۰%	۵۸۰	۳۰۵	اعتلا

رشد ۰.۲۵ واحدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۲۰ درصد



بالا رفتن نرخ تورم انتظاری به علت خروج آمریکا از برجام و افزایش نرخ به علت عدم خروج منابع از بانک ها

گسترش کرونا و عدم تقاضا برای وام بانکی
 دلان نرخ بهره و کف دلان ۱۰% در تیرماه
 کاهش نرخ بهره بین بانکی تا حدود ۹%

افزایش کف دلان نرخ سود
 شروع کسب و کارها
 افزایش نرخ بهره بین بانکی
 شروع حراج اوراق دولتی

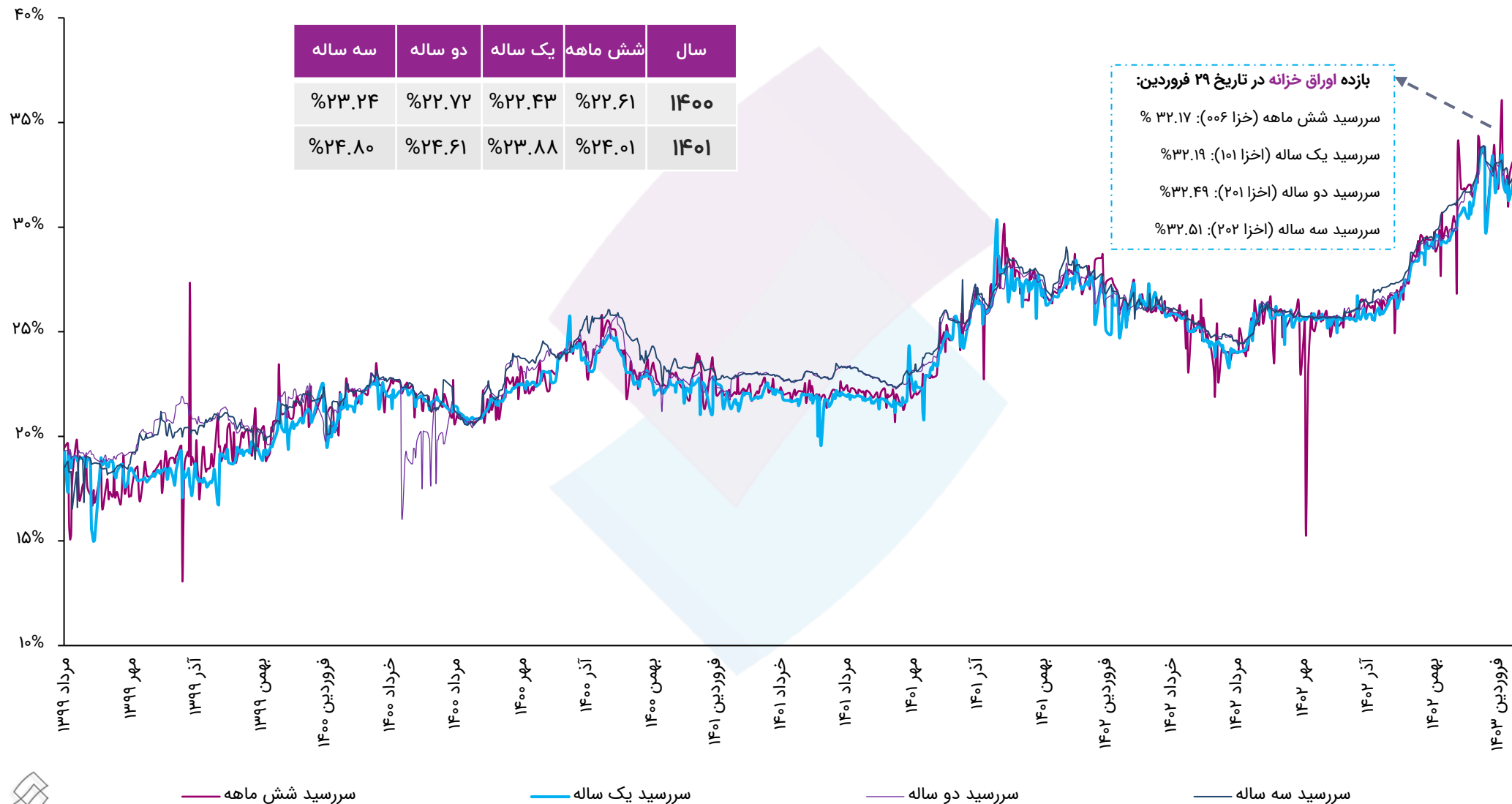
افزایش تورم
 افزایش سود سپرده‌ها در بازار پولی
 کسری بودجه و انتشار اوراق دولتی

افزایش سقف و کف دلان نرخ سود
 ادامه سیاست‌های انقباضی

ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد تومان)

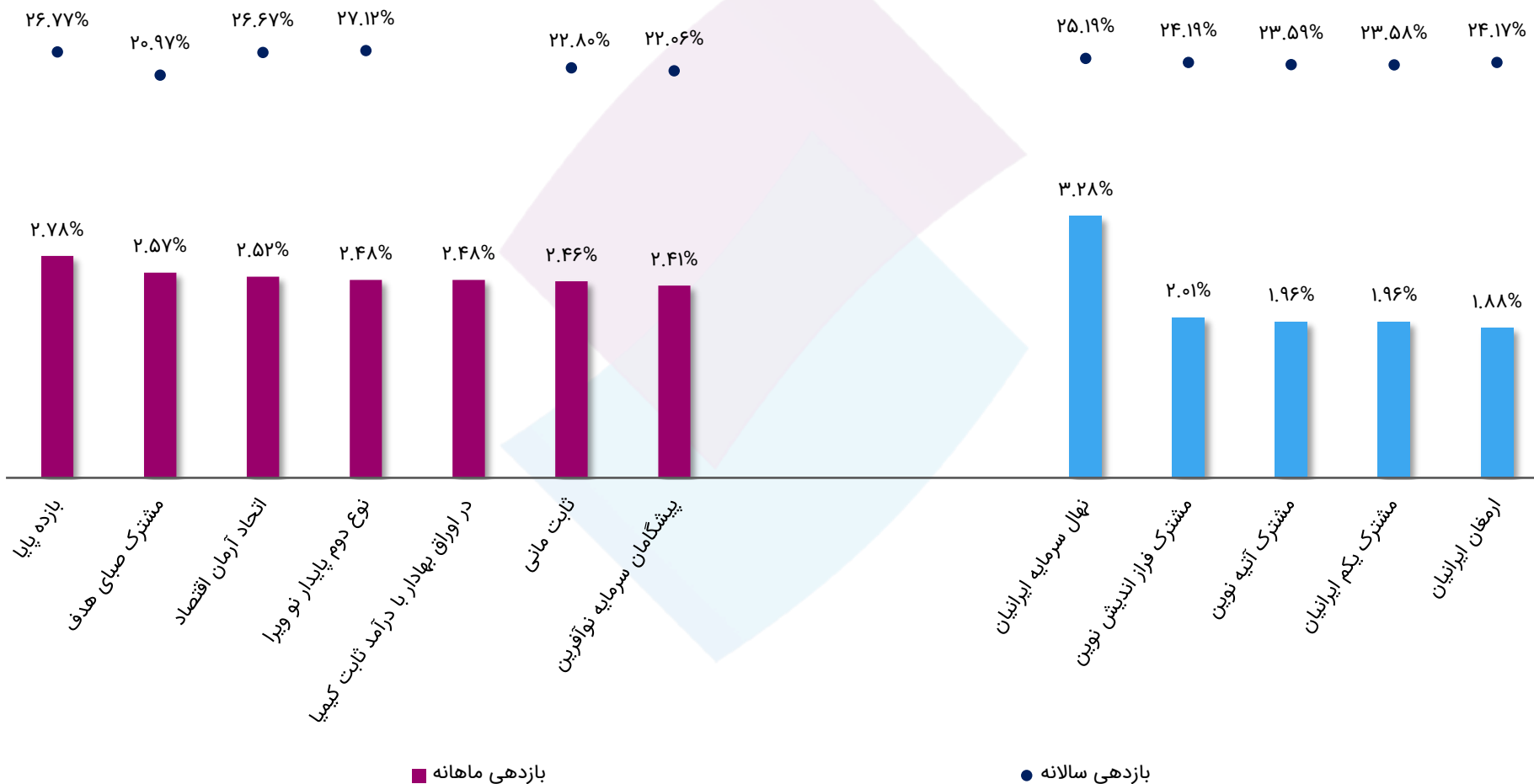
میانگین نرخ بهره بدون ریسک

بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

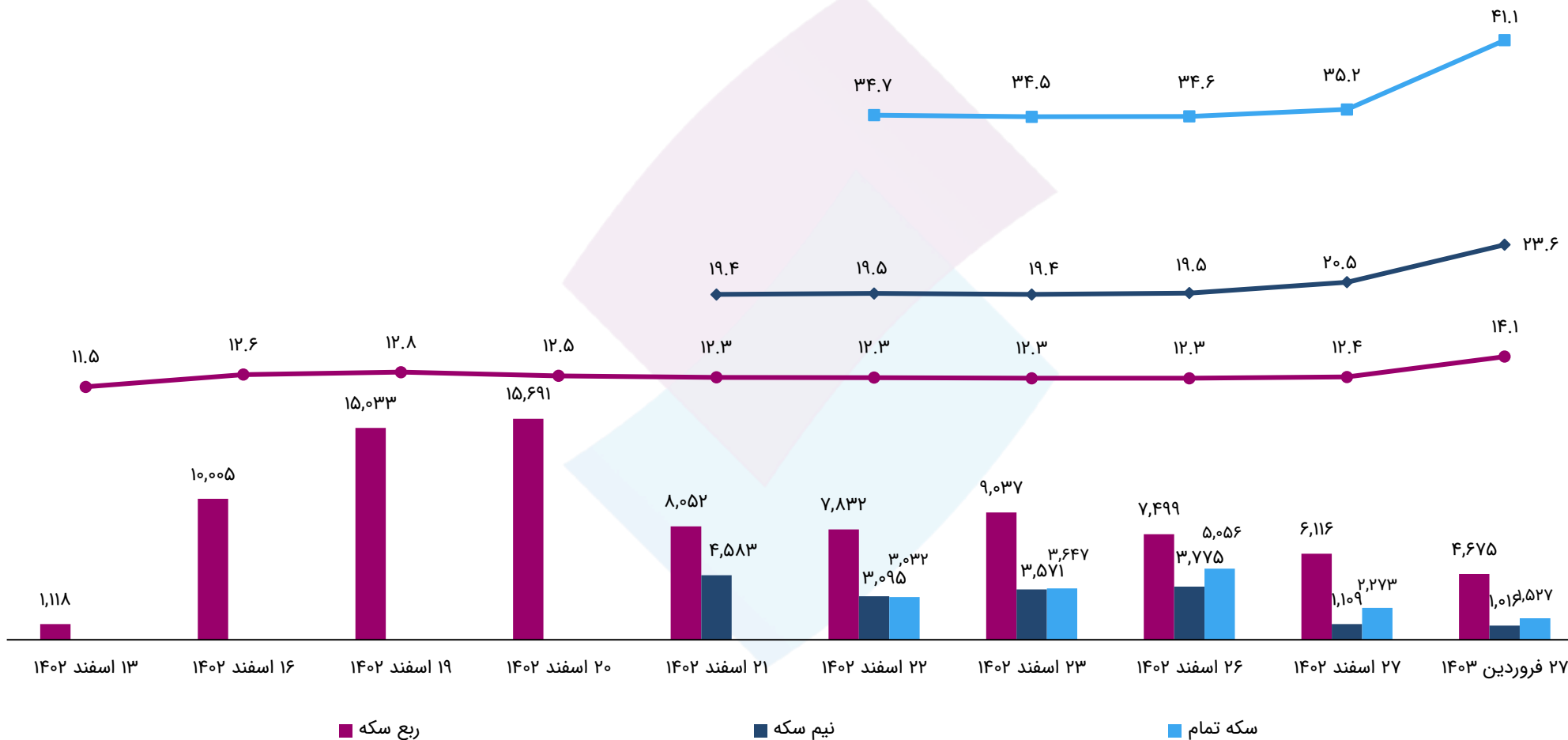


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

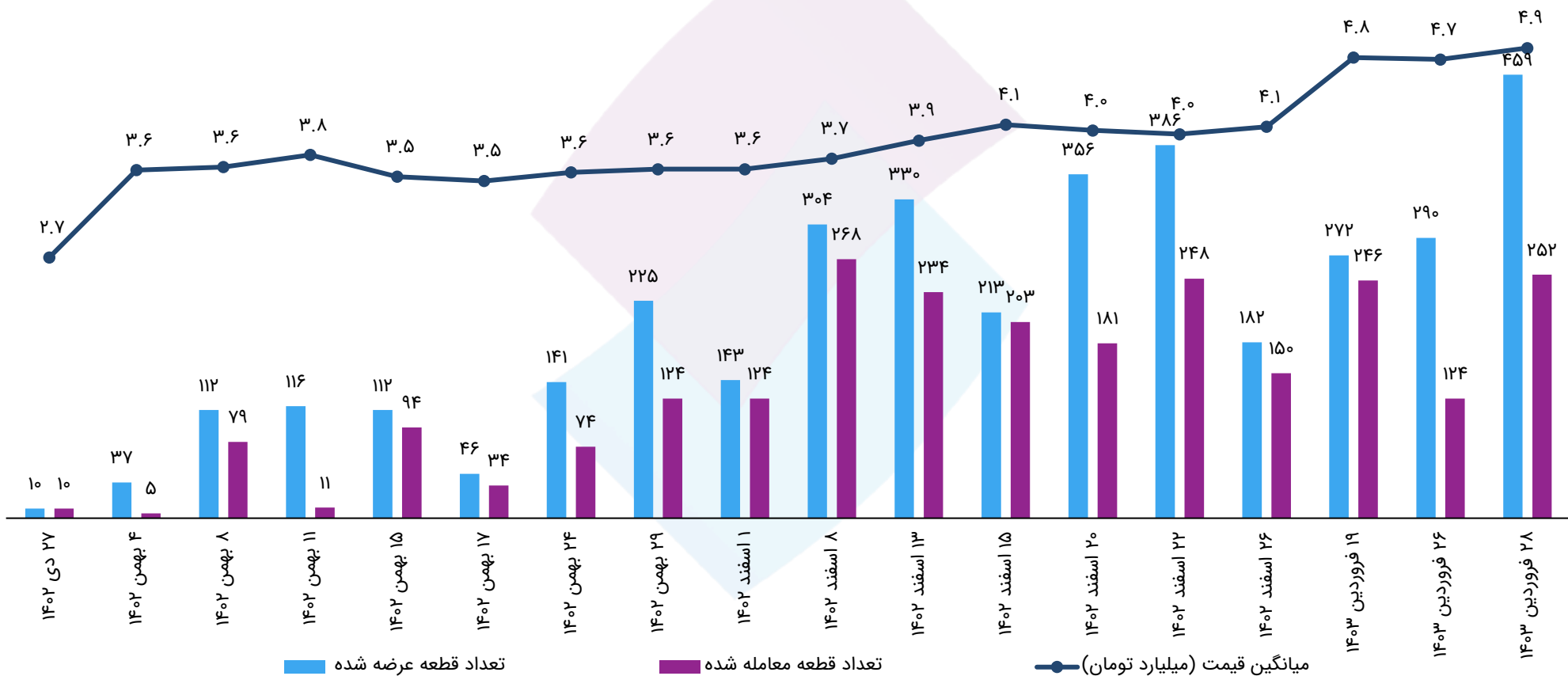


معامله ۱۱۷ هزار و ۷۴۲ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران



نمودارهای ستونی بیانگر تعداد سکه معامله شده است.
 نمودارهای خطی بیانگر میانگین قیمت معامله شده با واحد میلیون تومان است.

معامله ۲ هزار و ۴۶۱ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران



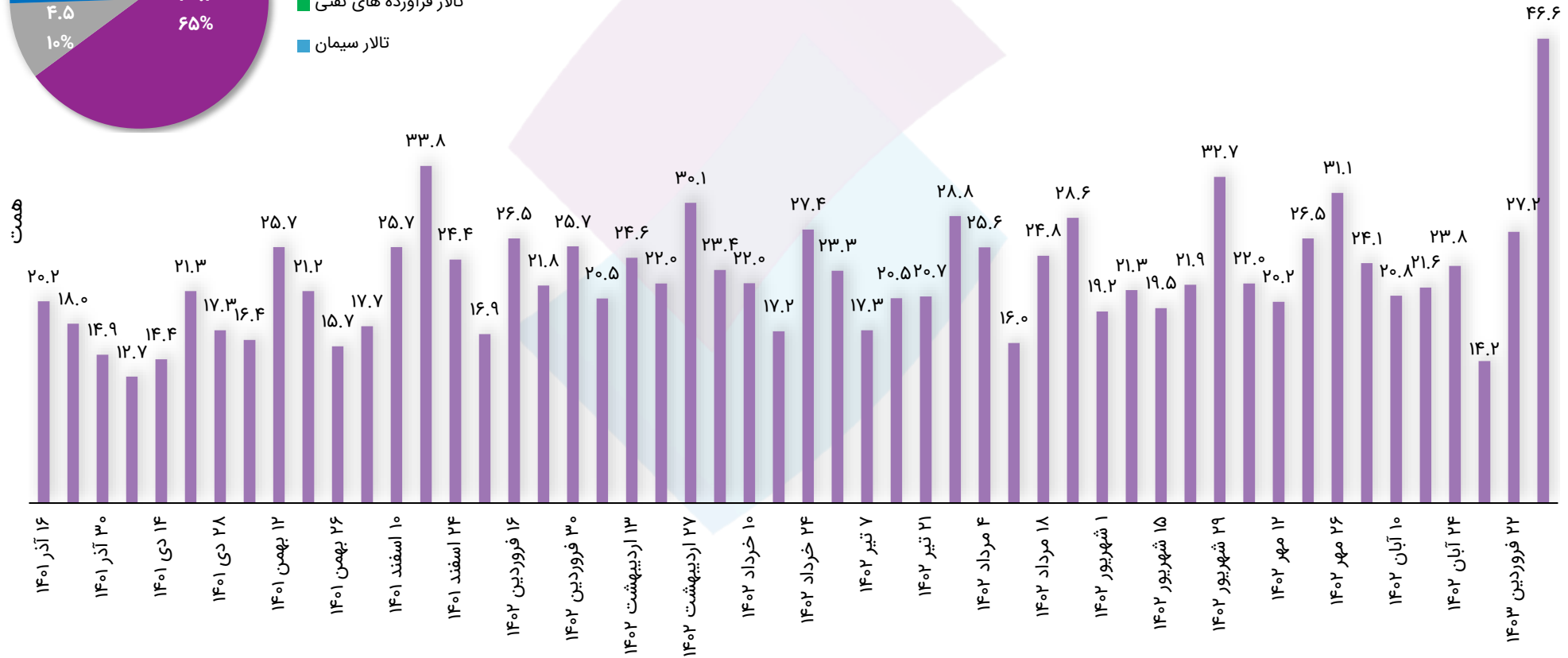
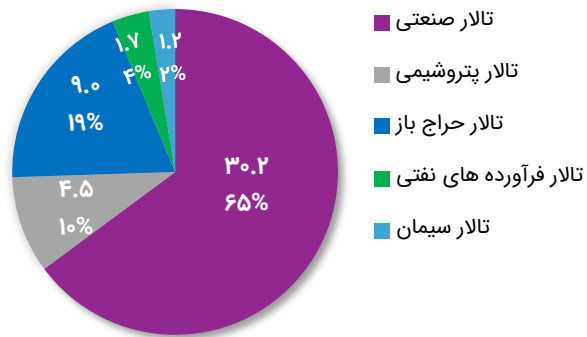
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

کاهش ۱۰.۶ درصدی گاز طبیعی در پی افزایش عرضه و کاهش تقاضا

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۱۹.۲%	۲,۰۰۵	۱۰.۷%	۲,۱۶۰	۱.۴%	۲,۳۵۷	۲,۳۹۰	طلا (دلار/انس)
۳۹.۸%	۳۱۳,۹۰۰	۱۳.۱%	۳۸۸,۰۶۰	۰.۴%	۴۳۷,۰۶۰	۴۳۸,۹۴۰	سکه (هزار ریال)
۳.۳%	۴۲۱,۶۷۲	۰.۲%	۴۳۴,۷۲۵	۰.۰%	۴۳۵,۶۷۷	۴۳۵,۶۷۶	دلار اسکناس (ریال)
۶.۰%	۳۸۳,۳۳۸	۰.۲%	۴۰۵,۵۲۷	۰.۰%	۴۰۶,۴۸۳	۴۰۶,۴۸۲	دلار حواله (ریال)
۵.۵%	۸۵	۳.۰%	۸۷	-۱.۳%	۹۱	۹۰	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۰۹.۰%	۳۰,۳۹۸	-۵.۹%	۶۷,۵۴۹	-۱۰.۰%	۷۰,۵۸۸	۶۳,۵۳۲	بیت کوین (دلار)
۴.۶%	۸,۹۶۵	۴.۵%	۸,۹۷۳	۰.۲%	۹,۳۶۰	۹,۳۷۵	مس LME (دلار/تن)
-۵.۳%	۲,۸۵۳	۷.۴%	۲,۵۱۵	-۱.۱%	۲,۷۳۱	۲,۷۰۲	روی LME (دلار/تن)
-۱۱.۰%	۵۶۰	۰.۰%	۴۹۹	-۰.۷%	۵۰۲	۴۹۸	بیلت CIS (دلار/تن)
-۴.۴%	۴۹۹	-۴.۴%	۴۹۹	-۰.۴%	۴۷۹	۴۷۷	بیلت ایران (دلار/تن)
-۱.۷%	۲۹۵	-۳.۳%	۳۰۰	-۱.۷%	۲۹۵	۲۹۰	متانول CFR (\$/mt)
-۸.۶%	۳۴۴	-۱۸.۹%	۳۸۷	-۹.۵%	۳۴۷	۳۱۴	سبب اوره (mt/\$)
-۲۴.۲%	۲.۲۳	۹.۷%	۱.۵۴	-۱۰.۶%	۱.۸۹	۱.۶۹	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

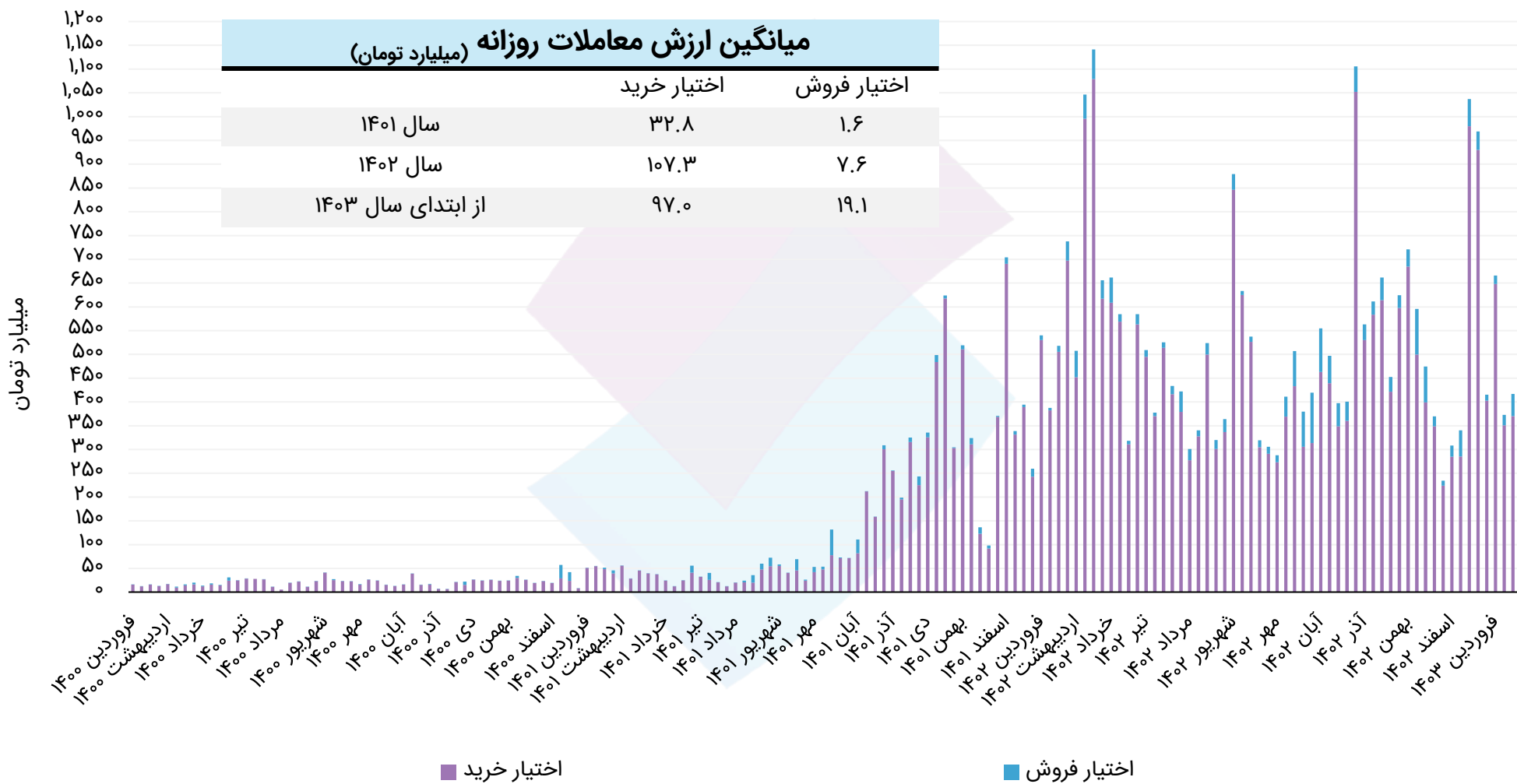
سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



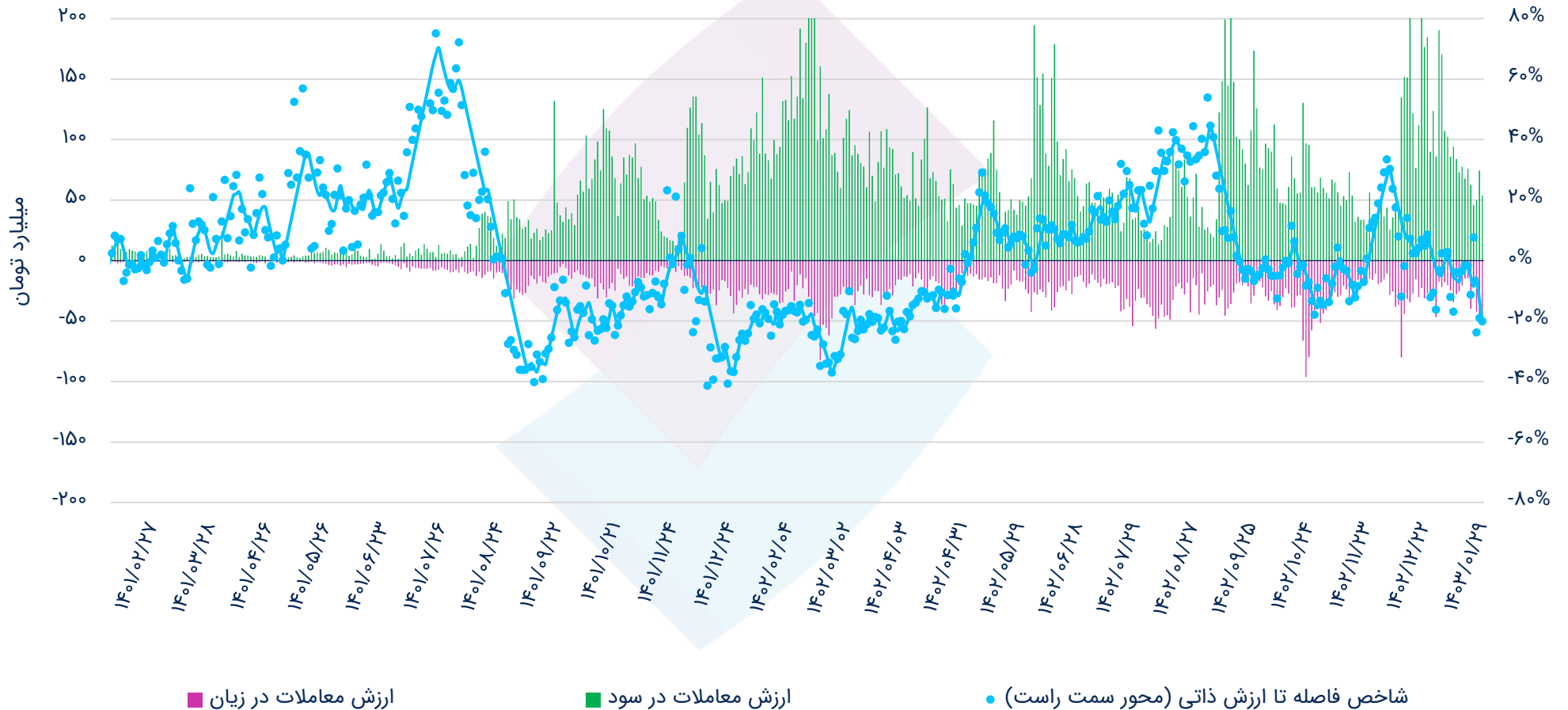
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان در تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
ورق گرم	۳۵.۶	۳۳۴,۹۳۴	فولاد مبارکه اصفهان، نورد و لوله اهواز، فولاد خرم آباد
آهن اسفنجی	۱۴.۰	۴۰۵,۶۰۰	توسعه آهن و فولاد گل گهر، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، صبا فولاد خلیج فارس، صنعت فولاد شادگان، پارس فولاد سبزواری، احیاء استیل فولاد بافت، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، آهن و فولاد غدیر ایرانیان
شمش بلوم	۲۲.۰	۱۶۸,۰۶۰	فولاد خوزستان، آهن و فولاد ارفع، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد کاوه جنوب کیش، فولاد سیرجان ایرانیان، صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، مجتمع فولاد خراسان، جهان فولاد سیرجان
ورق سرد	۴۱.۲	۶۵,۲۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، فولاد غرب آسیا، صنایع هفت الماس
وکیوم باتوم	۱۳.۴	۱۸۸,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز
مس کاتد	۵۲۹.۲	۴,۳۲۰	ملی صنایع مس ایران
لوب کات	۲۰.۸	۶۶,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
خاک روی	۲۰.۸	۶۵,۰۰۰	مجتمع سرب و روی انگوران
مس مفتول	۵۴۲.۳	۲,۴۵۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، گیل راد شمال
کنسانتره سنگ آهن	۳.۶	۳۴۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، توسعه معدنی و صنعتی صبانور، سنگ آهن گهر زمین، بین‌المللی اسم ایران
سیمان	۱.۰	۱,۲۳۱,۱۲۵	سیمان آبیک، سیمان تهران، سیمان ساوه، سیمان صوفیان، سیمان مازندران، سیمان ارومیه، سیمان سپاهان، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان هرمزگان، سیمان هگمتان، سیمان ممتازان کرمان، سیمان آرتا اردبیل، سیمان شرق
میلگرد	۲۵.۴	۴۷,۱۵۵	مجتمع فولاد خراسان، جهان فولاد سیرجان، فولاد کاوه اروند، ذوب آهن اصفهان، نورد میلگرد کاسپین، فولاد آلیاژی ایران، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، صنایع نورد میلاد یزد، فولاد امیرکبیرخزر
گندله سنگ آهن	۵.۲	۲۱۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، سنگ آهن گهر زمین
ورق گالوانیزه	۴۸.۳	۱۵,۳۰۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تراز چهارمحال، فولاد دشتستان، مجتمع فولادی روی اندودکاوه، صنایع هفت الماس، گروه صنعتی دانیال استیل
شمش آلومینیوم	۱۳۵.۶	۵,۳۲۵	مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، آلومینیوم مهدی، آلومینای ایران

رند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله

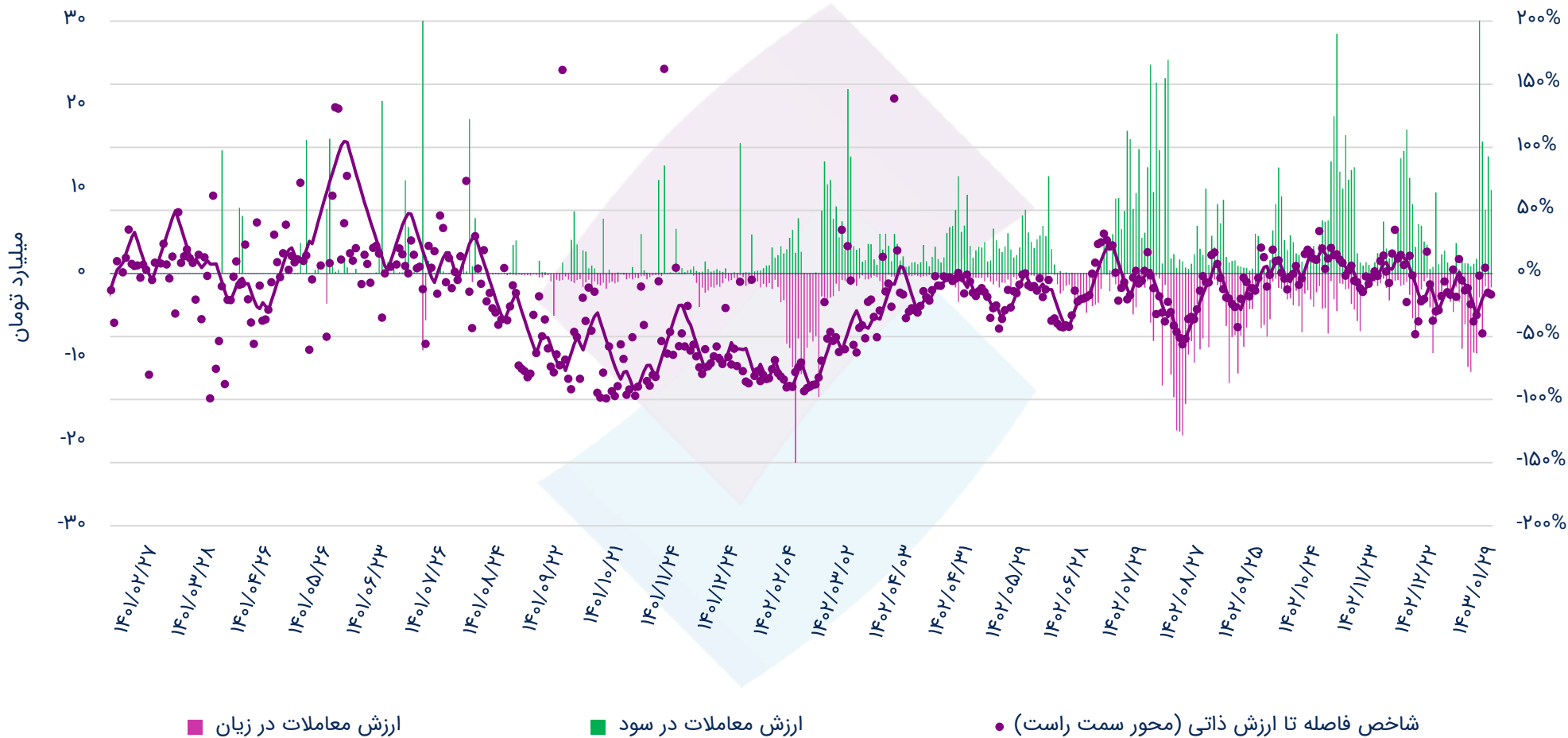


شاخص فاصله تا ارزش ذاتی^(۱) - اختیار خرید



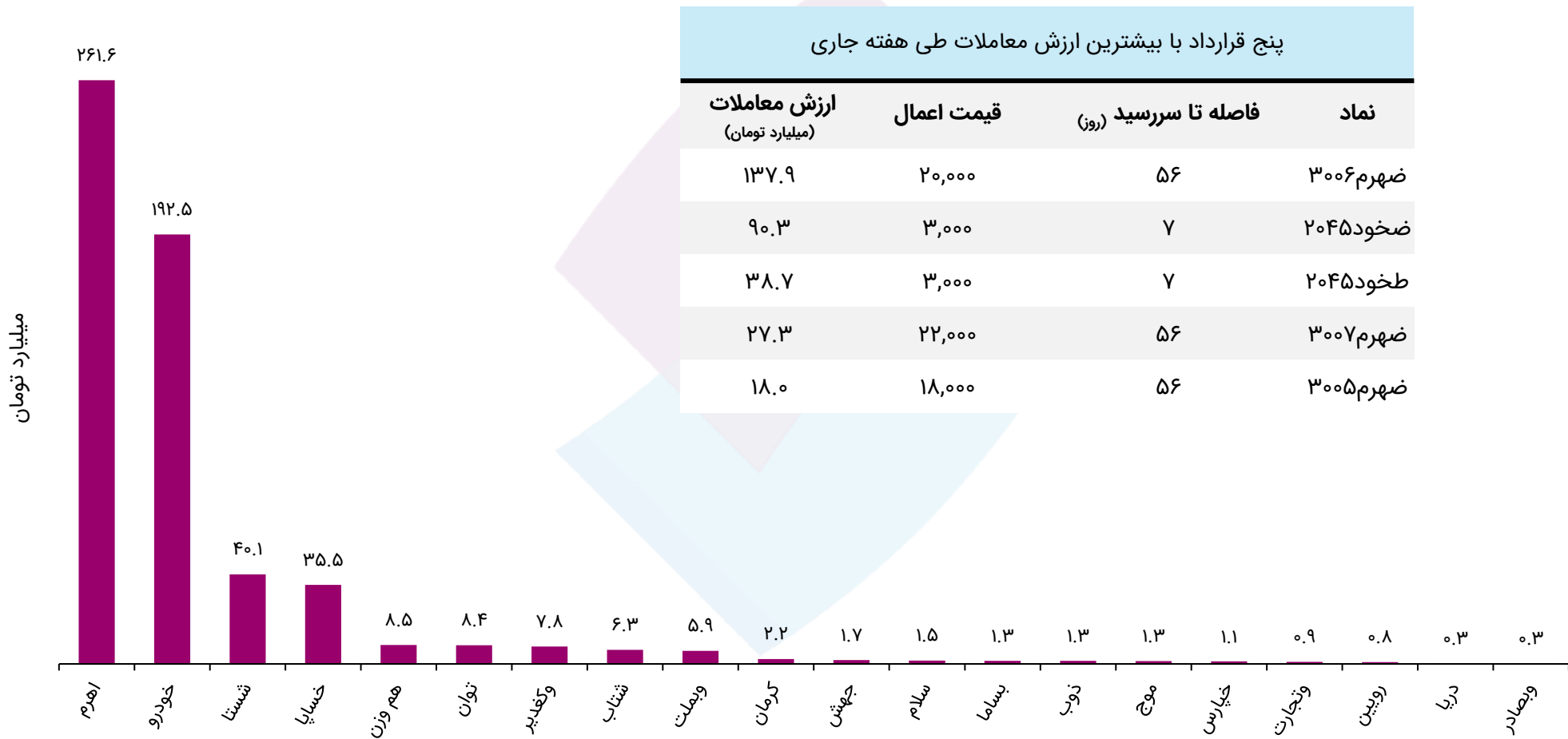
(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).
 (۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه
 (۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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)
زهرم ۳۰۰۶	۵۶	۲۰,۰۰۰	۱۳۷.۹
زخود ۲۰۴۵	۷	۳,۰۰۰	۹۰.۳
طخود ۲۰۴۵	۷	۳,۰۰۰	۳۸.۷
زهرم ۳۰۰۷	۵۶	۲۲,۰۰۰	۲۷.۳
زهرم ۳۰۰۵	۵۶	۱۸,۰۰۰	۱۸.۰

ثبت نام آنلاین آئی

دوست دار طبیعت باشیم

NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیازهای نوین

→ My.Nibb.ir



شرایط ویژه اعتباری برای مشتریان

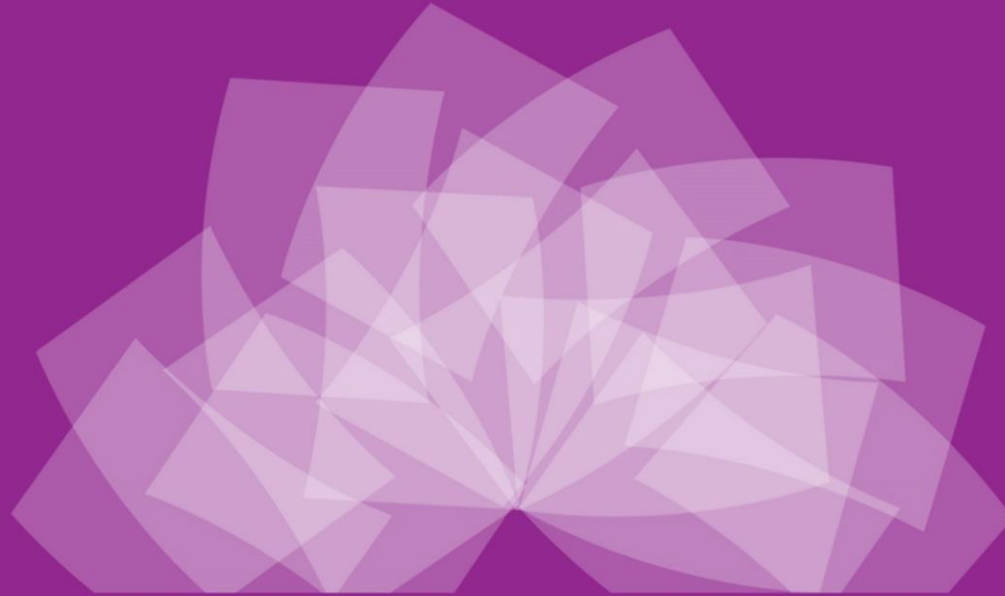
- ◆ برگشت کارمزد و اعطای اعتبار رایگان برای مشتریان پرگردش
- ◆ تا ۲ درصد تخفیف اعتبار در نرخ هزینه مالی با هربار گردش اعتبار
- ◆ اعطای اعتبار رایگان با حداقل ۱۴ بار گردش اعتبار در ماه



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 با 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

☎ ۰۲۱ - ۸۶۷۹ ۱۰۰۰

🌐 www.nibb.ir

✉ info@nibb.ir

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

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

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