

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 ۹ آبان - شماره ۱۷۴

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	صندوقهای اهرمی
۱۳	بیشترین ورود پول حقیقی/حقوقی
۱۴	بیشترین تغییرات قیمت
۱۵	بیشترین سرانه خرید و فروش حقیقی
۱۶	گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه
۱۸	میانگین نرخ بازده تا سررسید و دیرش اوراق خزانه اسلامی
۱۹	اوراق خزانه
۲۰	صندوقهای با درآمد ثابت
۲۱	نرخ بهره بین بانکی
۲۳	معاملات مرکز مبادله طلا و ارز
۲۴	قیمت‌های جهانی
۲۵	روند ارزش معاملات در بورس کالا
۲۶	بیشترین ارزش معاملات در بورس کالا
۲۷	روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله
۲۸	شاخص فاصله تا ارزش ذاتی
۳۰	بیشترین ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



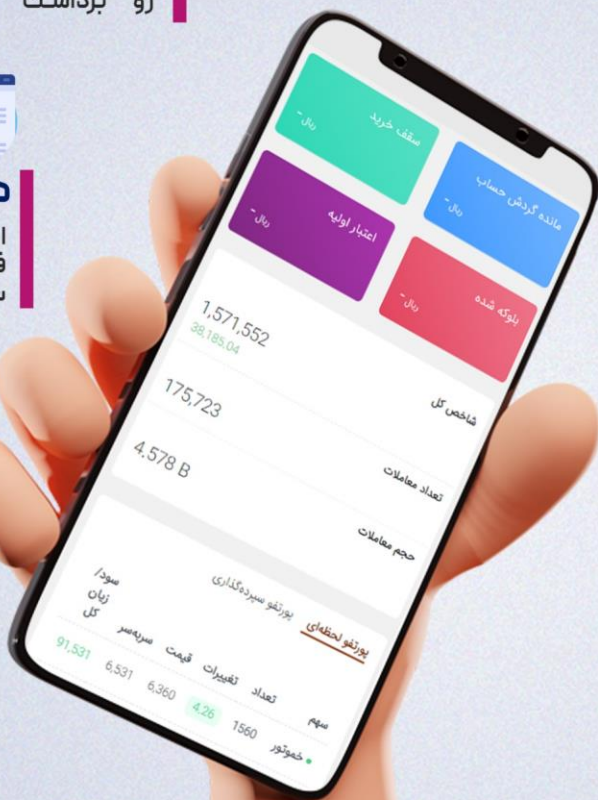
برداشت وجه آتی

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 آتی

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

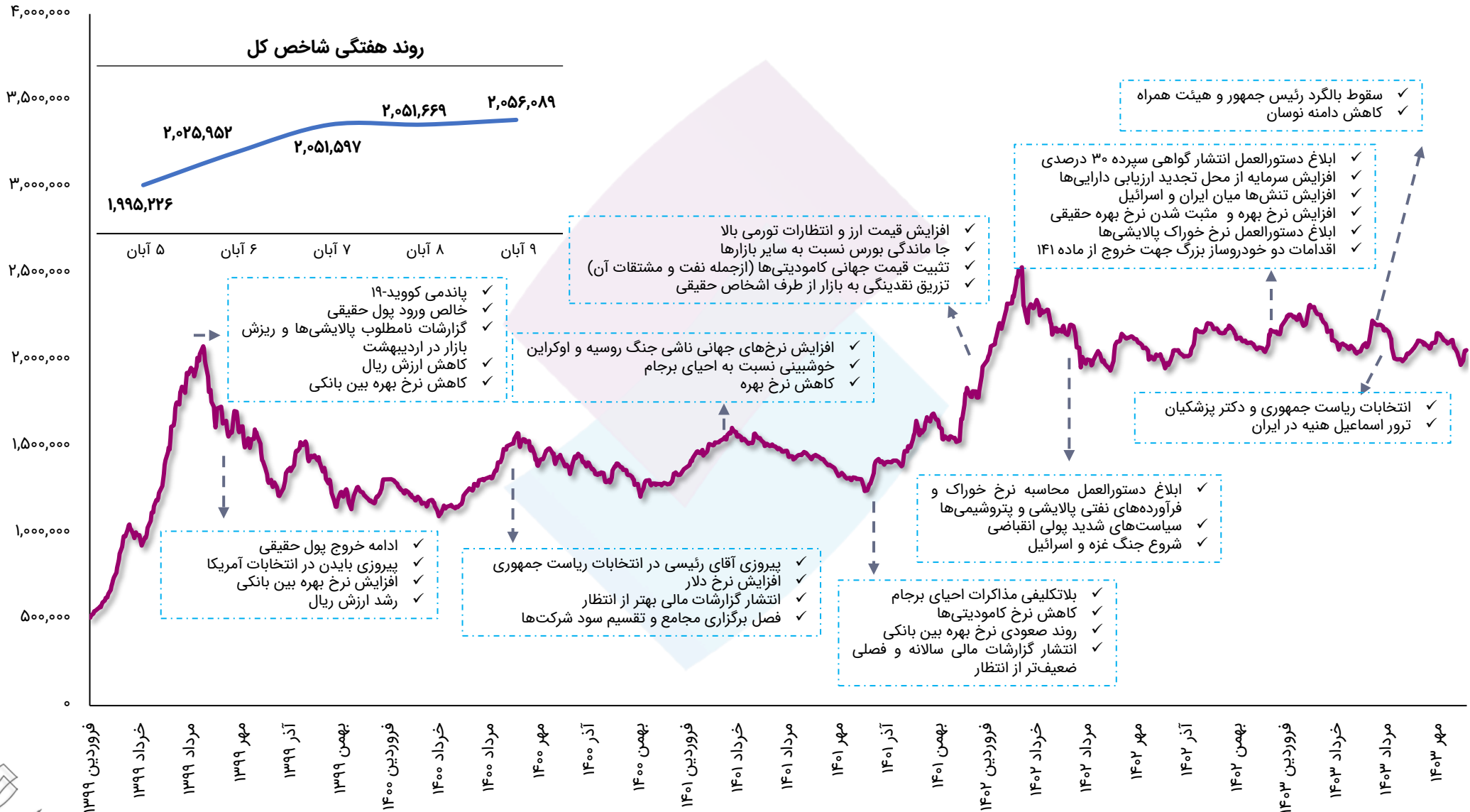
→ My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

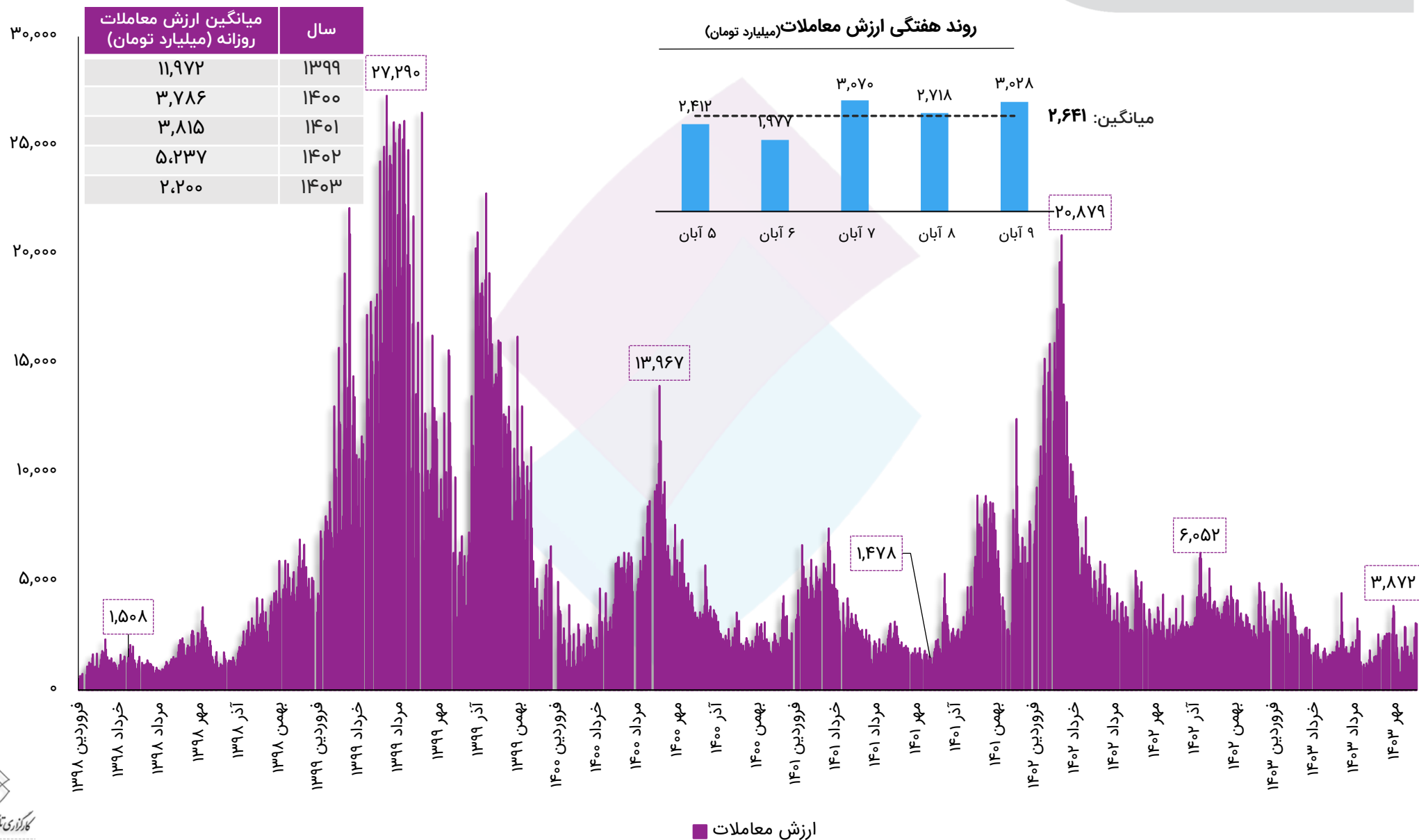


وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

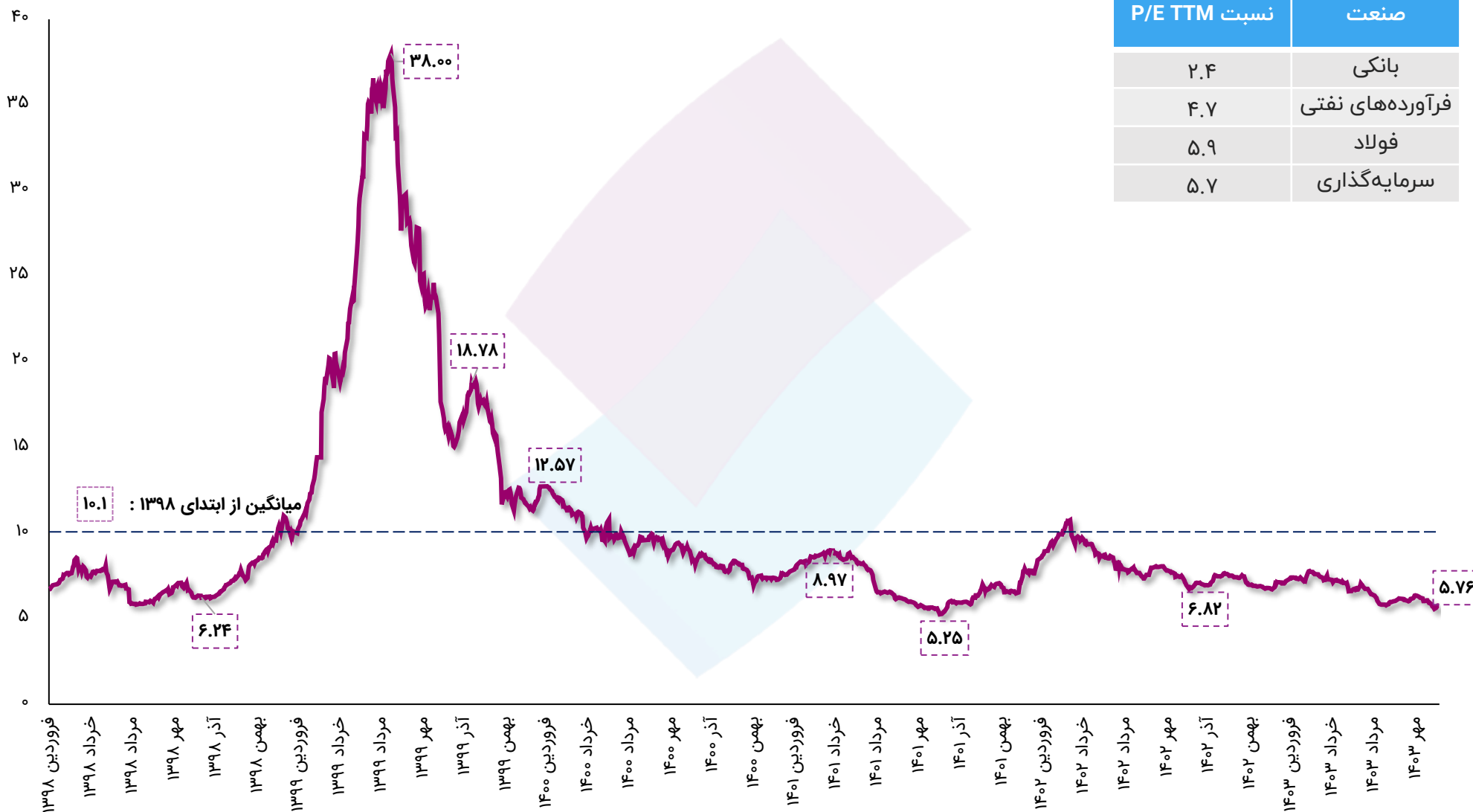
رشد ۴.۳ درصدی شاخص کل در هفته جاری



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

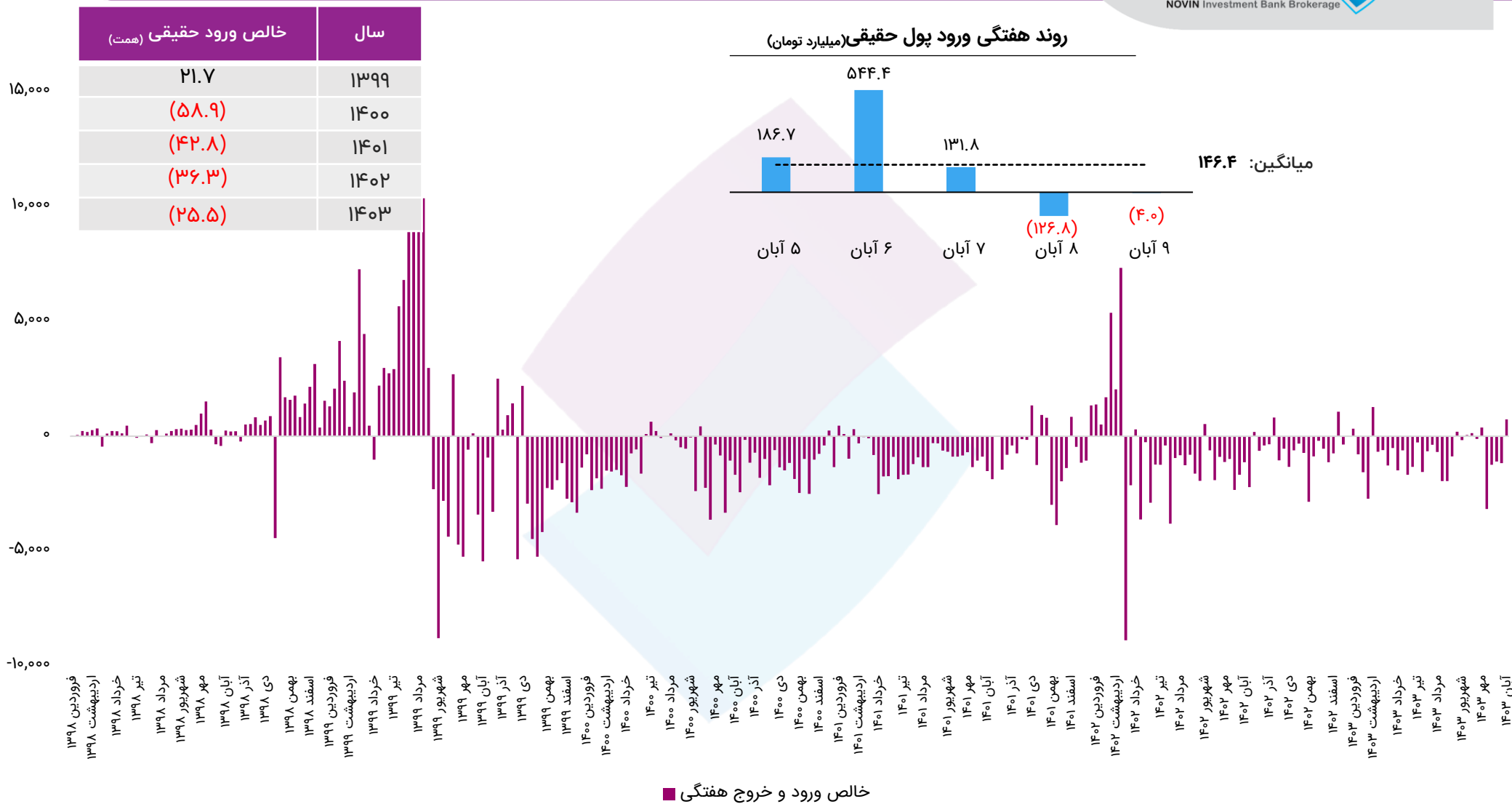


نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



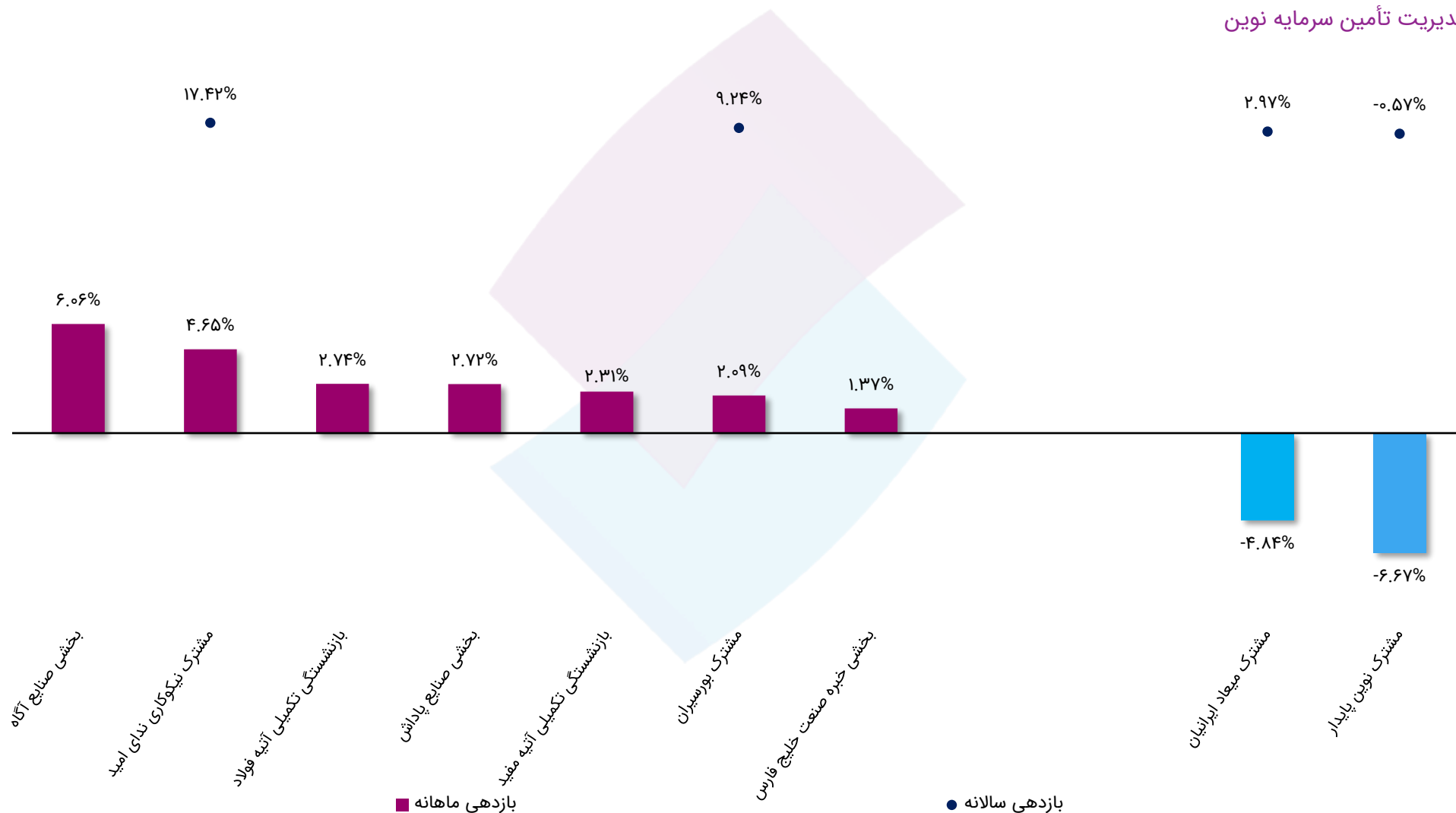
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۴	بانکی
۴.۷	فرآورده‌های نفتی
۵.۹	فولاد
۵.۷	سرمایه‌گذاری

۷۳۲ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱،۱۷۳ میلیارد تومانی هفته گذشته

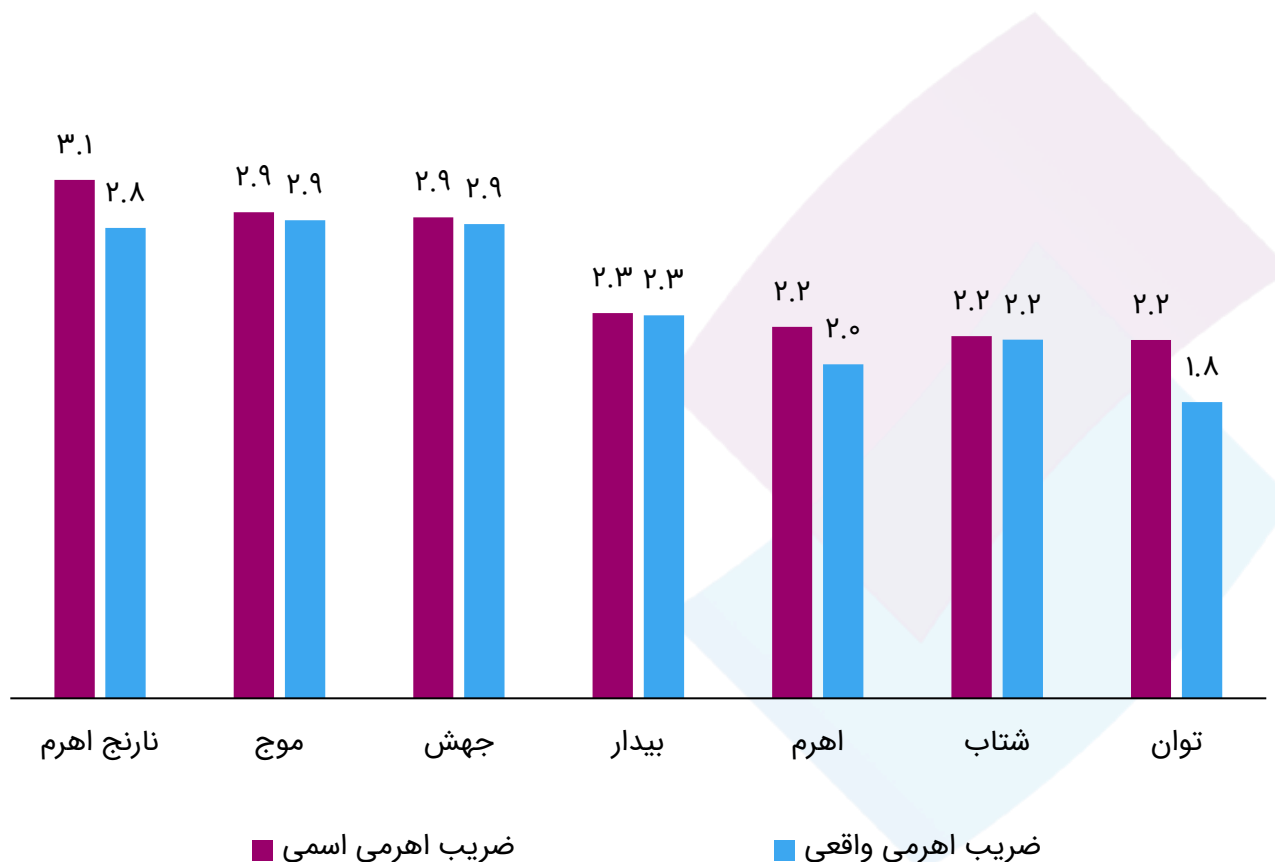


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
موج	-۱۰.۸%	۲.۴
شتاب	-۶.۷%	۲.۱
جهش	-۶.۶%	۲.۳
توان	-۶.۶%	۲.۰
بیدار	-۶.۲%	۳.۰
نارنج اهرم	-۵.۹%	۳.۱
اهرم	-۵.۸%	۲.۱

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
توان	-۵.۲%	۲.۲%
شتاب	-۷.۴%	۲.۴%
اهرم	-۹.۴%	۲.۵%
موج	-۹.۹%	۲.۵%
نارنج اهرم	-۱۶.۰%	۲.۵%
جهش	-۱۶.۹%	۲.۵%
بیدار	-۲۳.۴%	۲.۵%

حباب = قیمت پایانی تابلو/NAV ابطال - ۱

بازده ماهانه = قیمت پایانی آخرین روز معاملاتی ماه / قیمت پایانی ۳۰ روز گذشته - ۱

بازده ماهانه واحد عادی = NAV آخرین روز معاملاتی ماه واحد عادی / NAV ۳۰ روز گذشته واحد عادی - ۱

ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

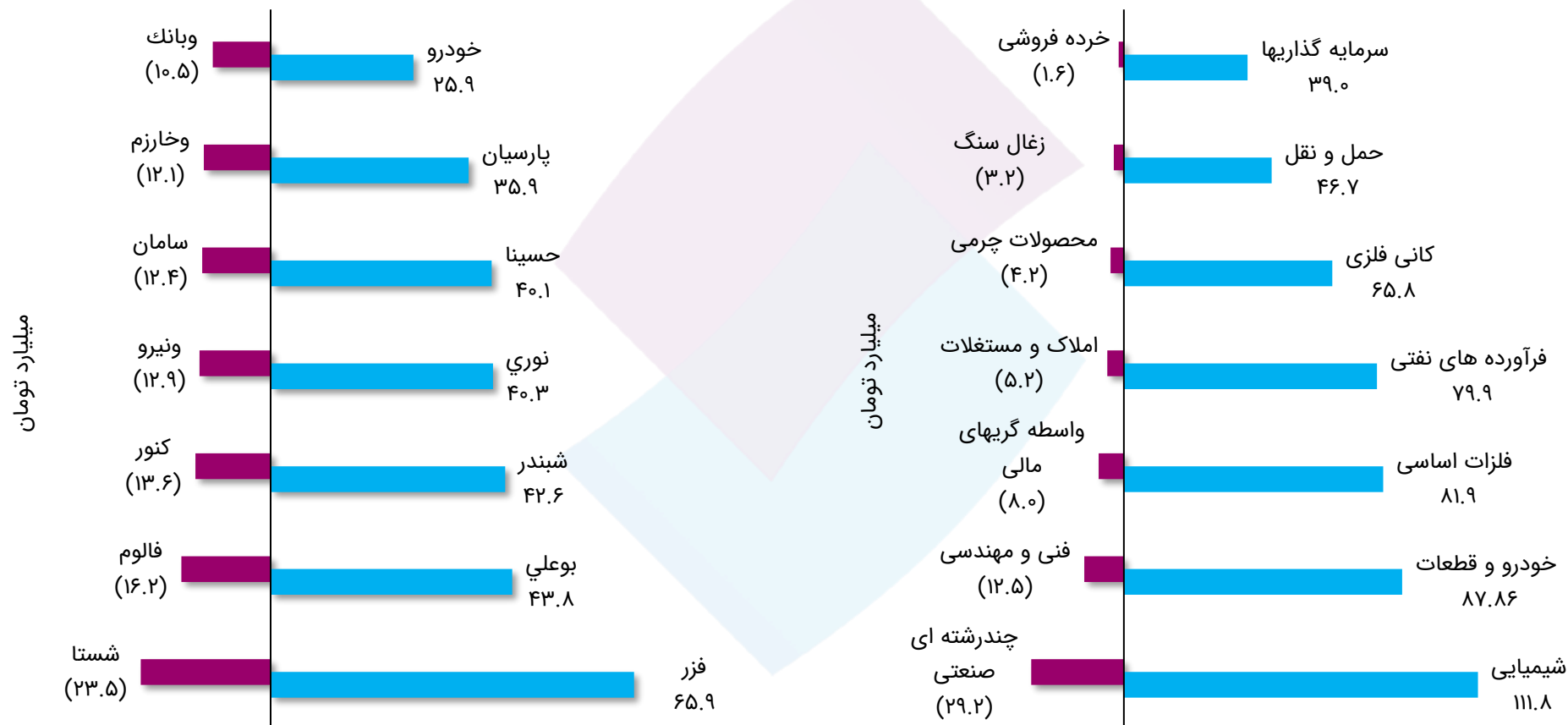
ضریب اهرمی واقعی = (خالص ارزش دارایی‌های صندوق - سپرده بانکی، اوراق و وجه نقد) / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

در محاسبه ضریب بتا از بازده قیمت پایانی و شاخص هموزن طی ۲۴۵ روز گذشته استفاده شده است.

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

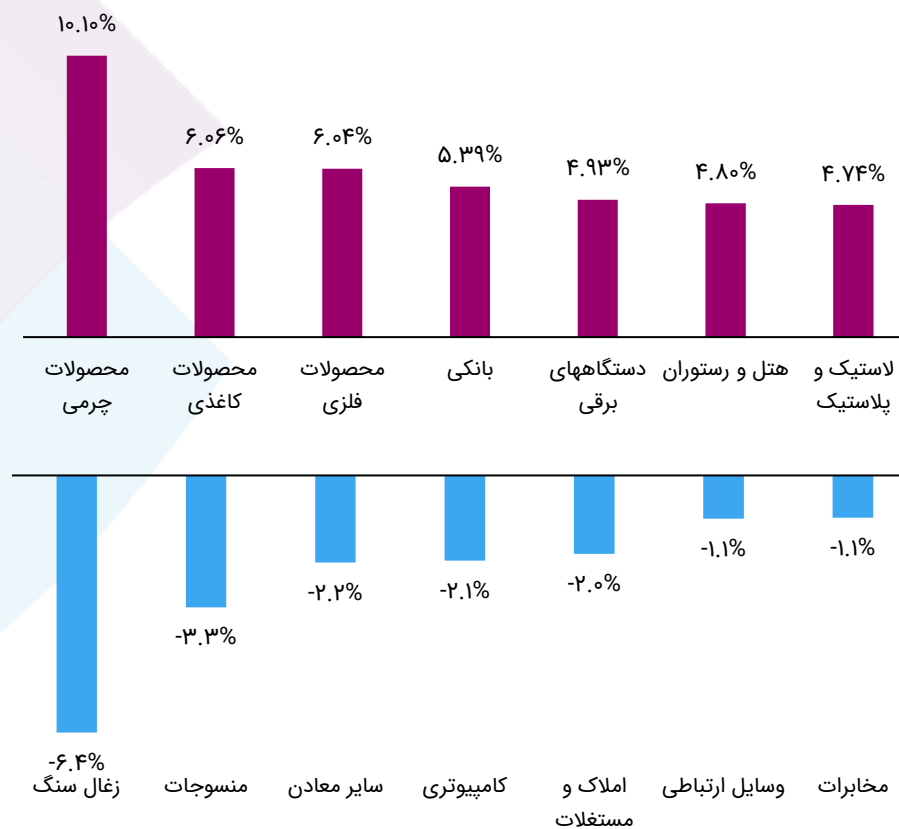
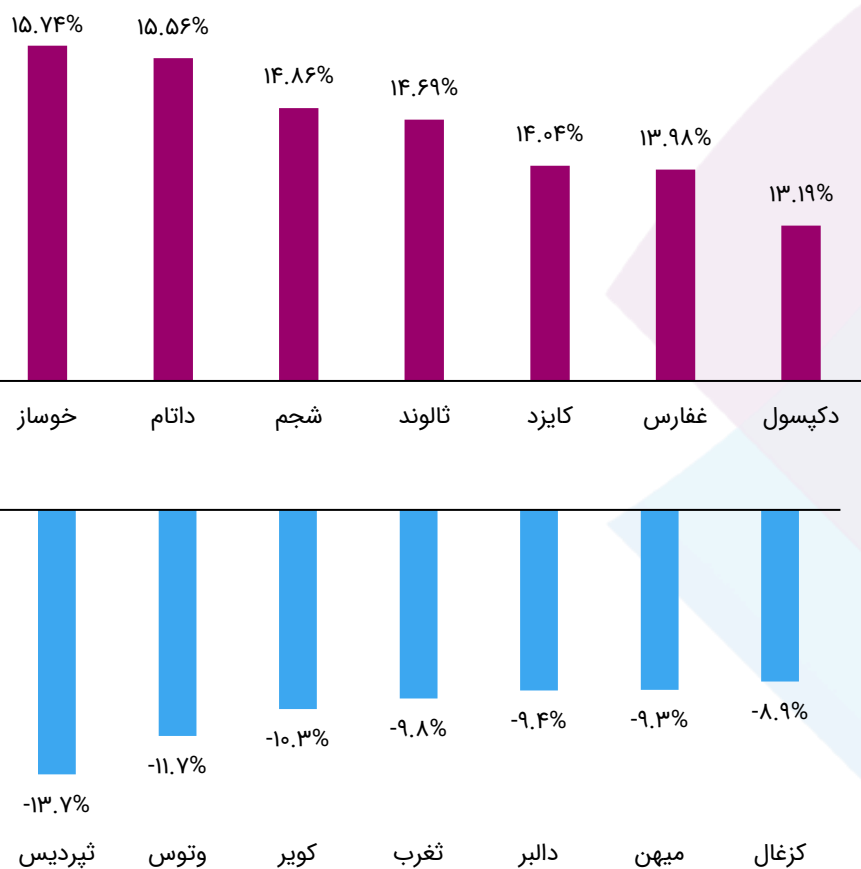
صنعت

نماد



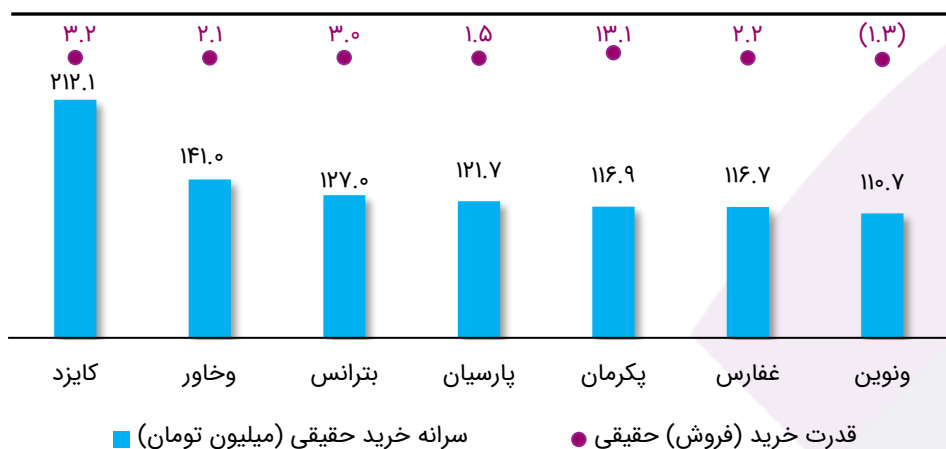
نماد

صنعت

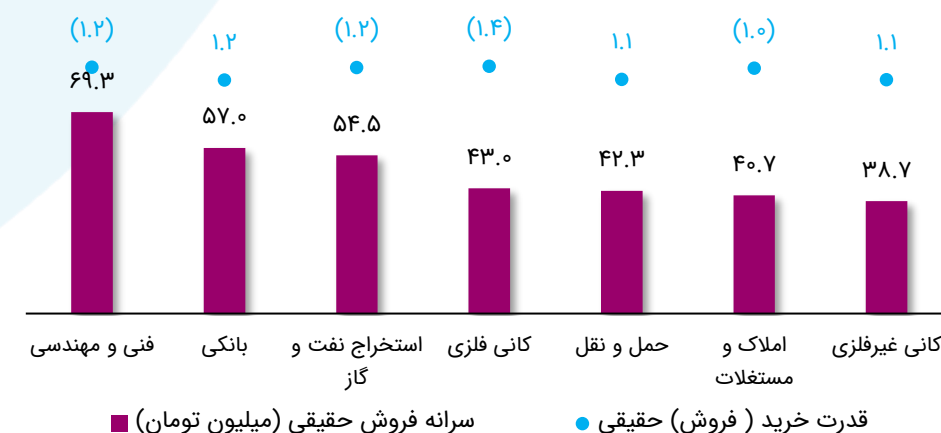
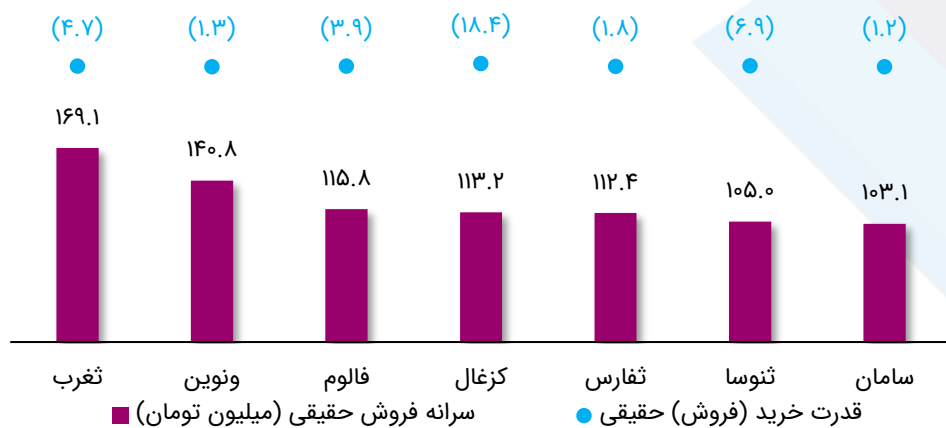
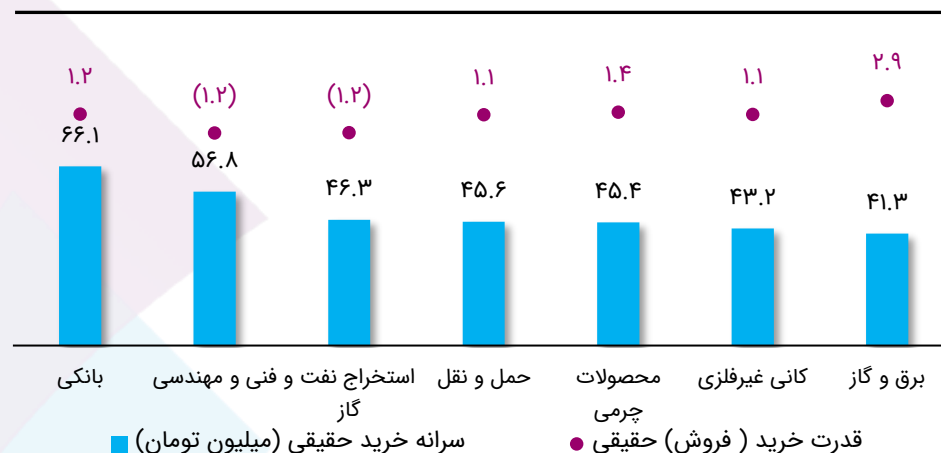


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

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 در خصوص افزایش سرمایه					
قمرو	۴۰۰	۵۰۰	۲۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و حفظ نقدینگی شرکت و جبران مخارج سرمایه ای انجام شده و بهبود سرمایه در گردش
توسن	۳۰۰	۵۰۰	۶۷%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد
خریخت	۱,۰۸۱	۱,۱۶۶	۸%	سود انباشته	استفاده از معافیت مالیاتی و اصلاح ساختار مالی در جهت استفاده از حداکثر توان تولیدی
کچاد	۳۷,۱۵۰	۵۱,۵۰۰	۳۹%	آورده نقدی سود انباشته	تأمین بخشی از منابع مورد نیاز جهت تکمیل طرح های توسعه در دست اجرا و جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر و مشارکت در حال انجام شرکت های سرمایه پذیر
کگل	۴۳,۰۰۰	۵۸,۰۰۰	۳۵%	آورده نقدی سود انباشته	۱) جبران مخارج انجام شده بابت سرمایه گذاری های صورت گرفته در طرح های توسعه ، خرید ماشین آلات معدنی و نوسازی ناوگان معدن و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر، ۲) مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر
آریان	۵,۹۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵۴%	آورده نقدی سود انباشته سایر اندوخته ها	تأمین سرمایه در گردش مورد نیاز برای مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر، بازپرداخت تسهیلات مالی (ریالی و ارزی) و بهبود ساختار سرمایه
وبوعلی	۹۰۰	۱,۲۰۰	۳۳%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، جبران مخارج سرمایه گذاری های انجام شده و بکارگیری مبلغ مذکور در اصلاح سبد سهام شرکت و همچنین ارتقاء جایگاه شرکت در بازار سرمایه
غشهداب	۷۲۳	۸۸۵	۲۲%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
پخش	۶۸۰	۱,۰۰۰	۴۷%	آورده نقدی سود انباشته	ساخت مرکز توزیع اهواز
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه					
افق	۲,۰۰۰	۳,۰۰۰	۵۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
زگلدشت	۷۰	۵۶۰	۷۰۰%	آورده نقدی	تأمین مخارج اجرا و تکمیل طرح های توسعه شرکت با عنوان طرح احداث گاوآبادی ۶۰۰۰ رأسی (شامل ۳۰۰۰ راس دام مولد) شهرستان دلفان استان لرستان و طرح احداث گاوآبادی ۱۲۰۰۰ رأسی (شامل ۶۰۰۰ راس دام مولد) شهرستان رزن استان همدان
وثنو	۲۵۰	۳۳۰	۳۲%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

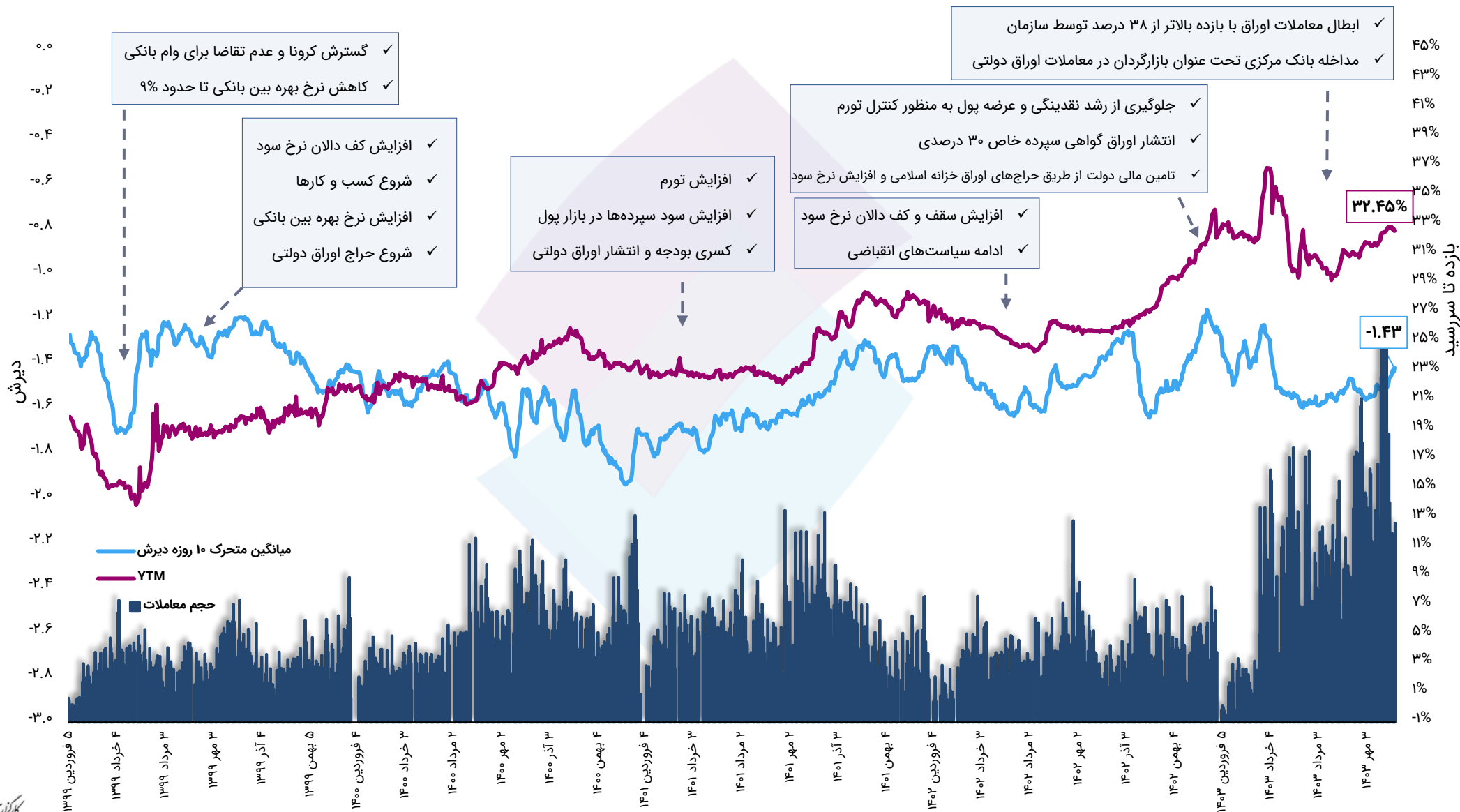
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
------	-----------------------------	-----------------------------	----------------	-------------------	---------------------

آگهی ثبت افزایش سرمایه

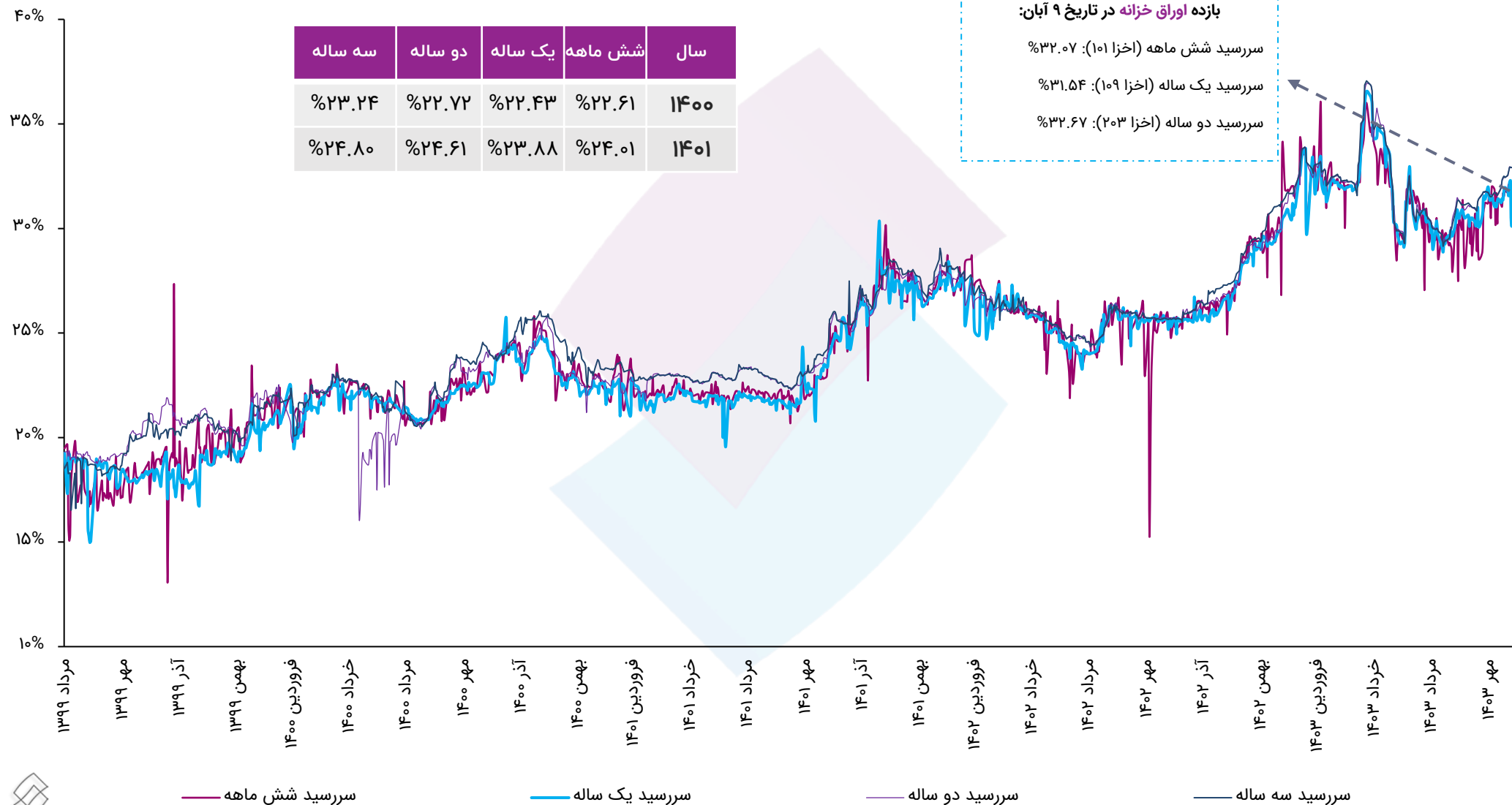
اعتلا	۳۰۵	۴۰۰	۳۱%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی
قرن	۶۰۰	۱,۰۰۰	۶۷%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی
لبوتان	۲۵۰	۱,۴۲۷	۴۷۱%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالای ایرانی
کرومیت	۱۵۵	۲۹۵	۹۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی

کاهش ۰.۲۲ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۴۵ درصد



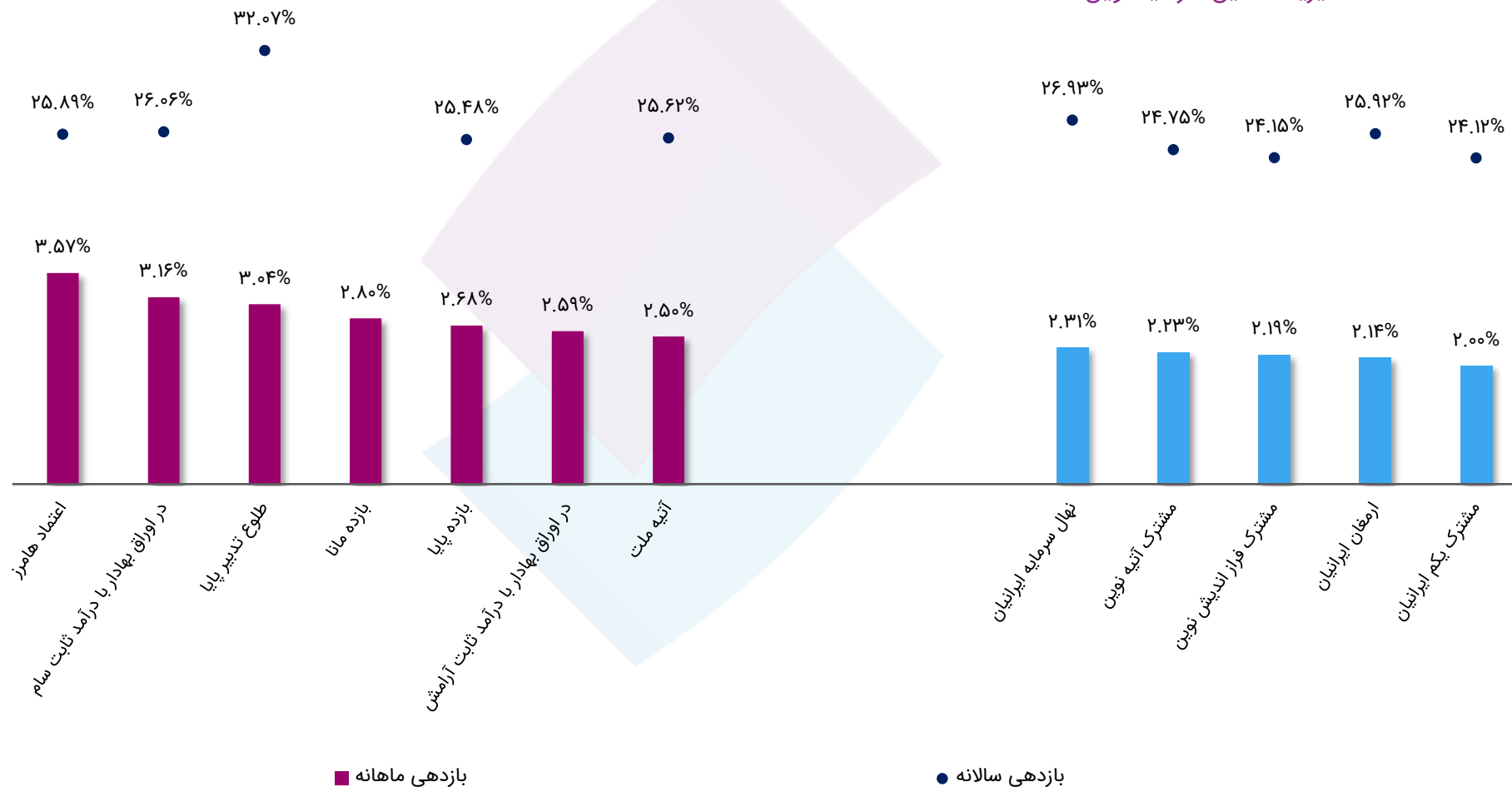
بازده تا سررسید

بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

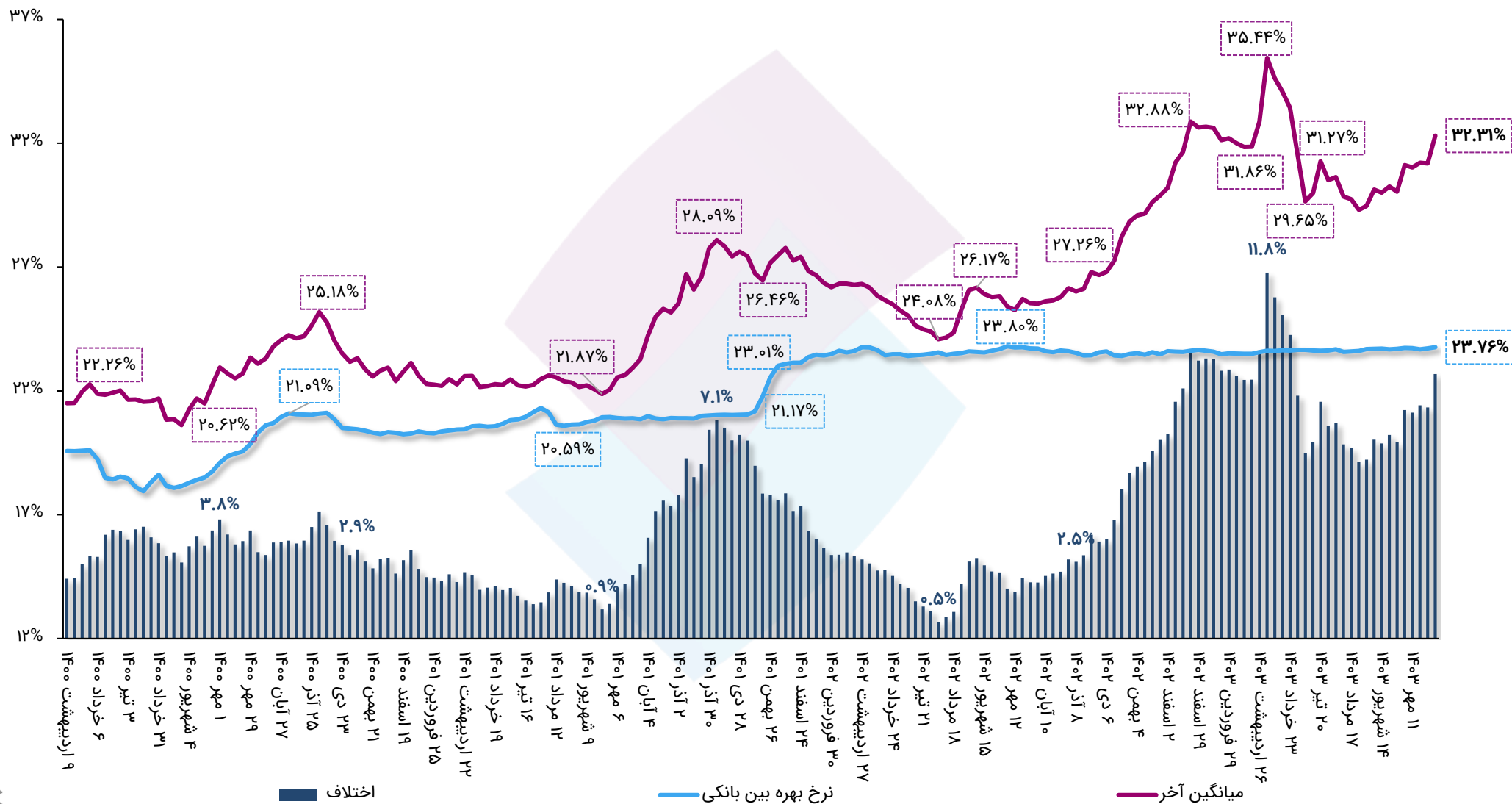


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

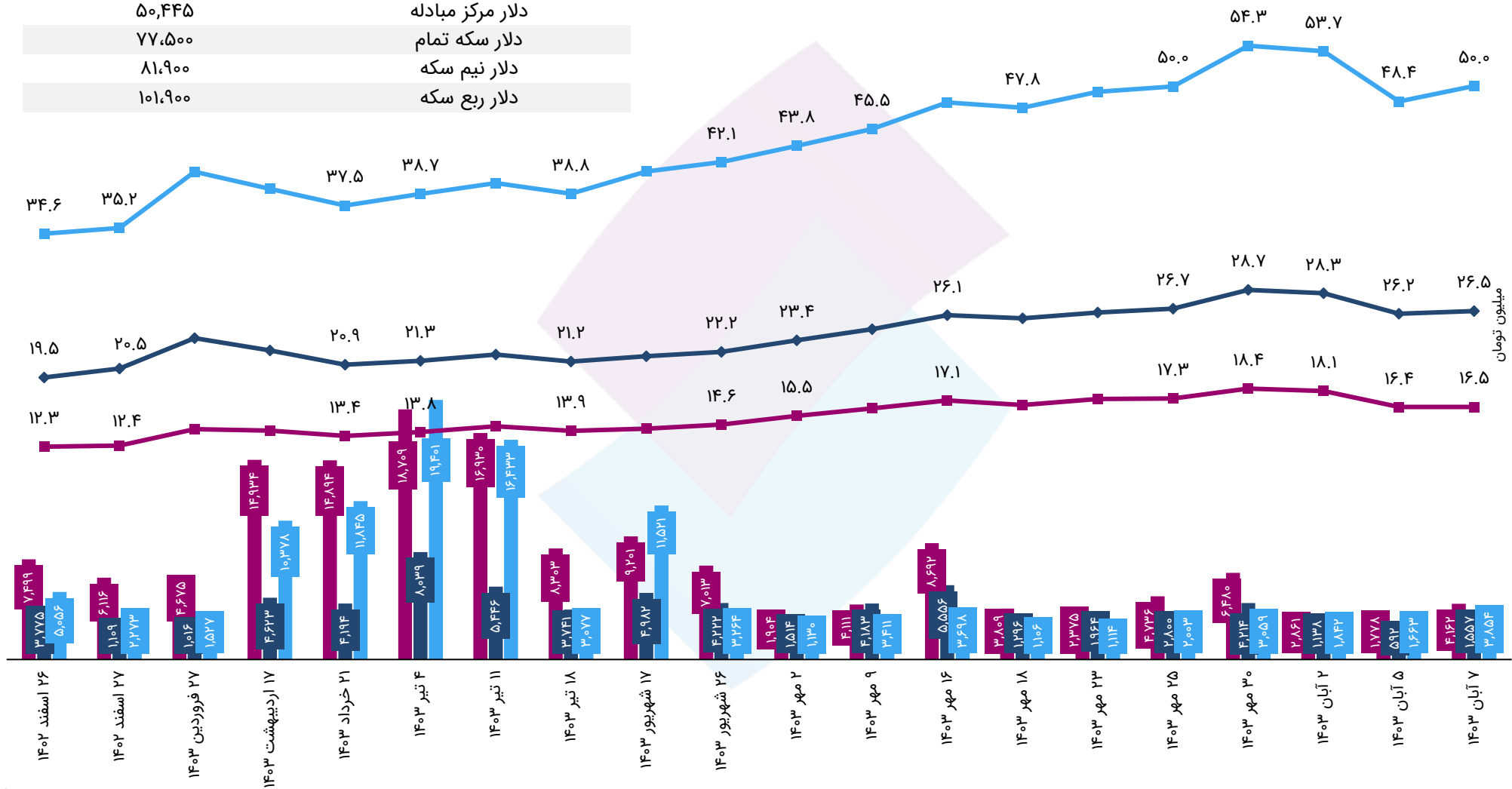


افزایش ۰.۰۴ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۷۶ درصد و اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخرید به ارزش ۲۴۷ همت



معامله ۴۰۷ هزار و ۴۹۴ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)
دلار مرکز مبادله	۵۰,۴۴۵
دلار سکه تمام	۷۷,۵۰۰
دلار نیم سکه	۸۱,۹۰۰
دلار ربع سکه	۱۰۱,۹۰۰



معامله ۱۱ هزار و ۵۷۱ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

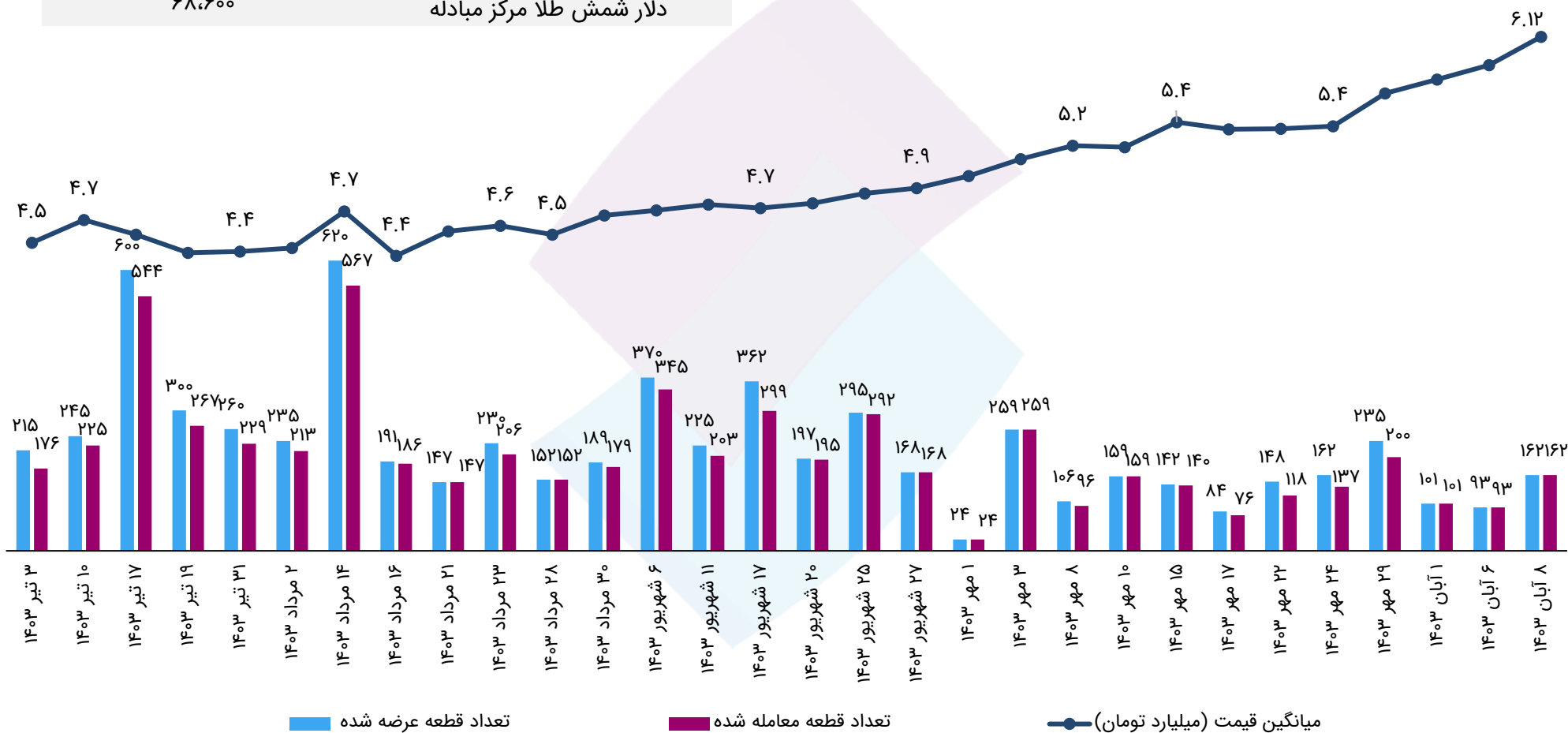
آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

۵۰،۵۲۵

دلار مرکز مبادله

۶۸،۶۰۰

دلار شمش طلا مرکز مبادله



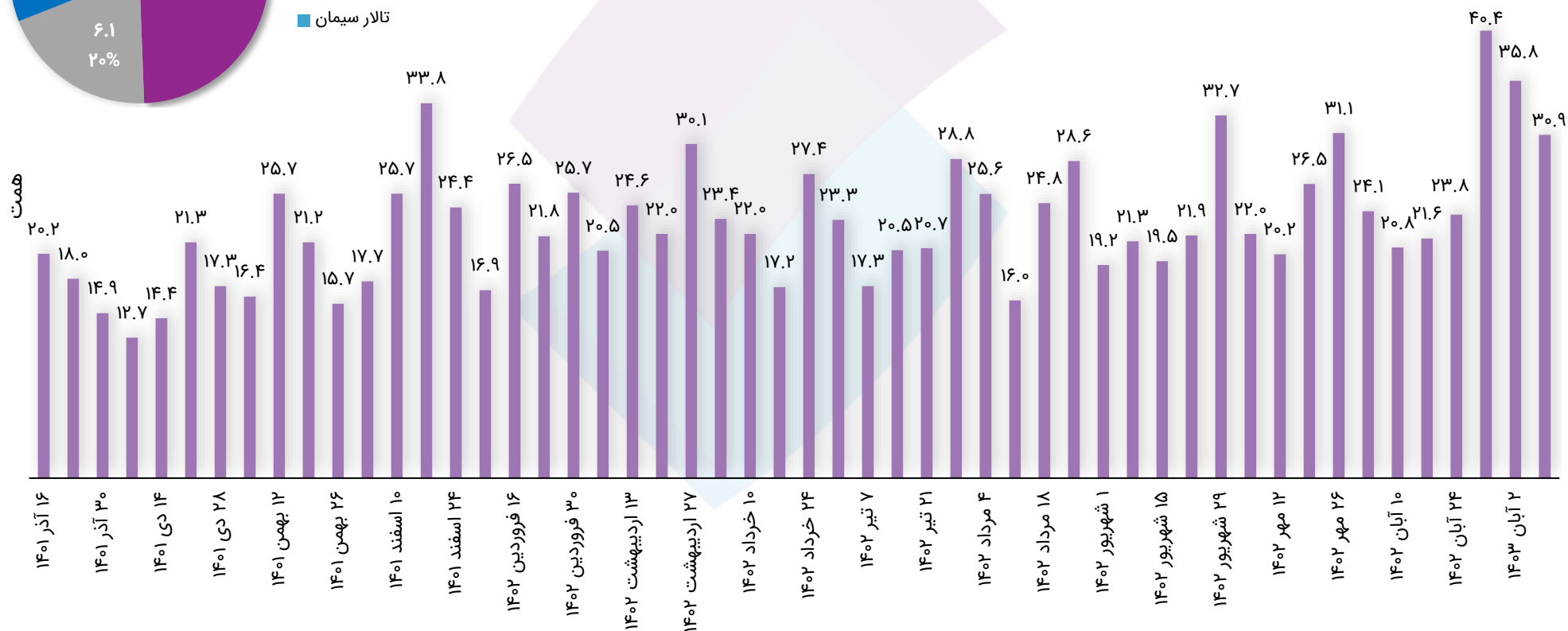
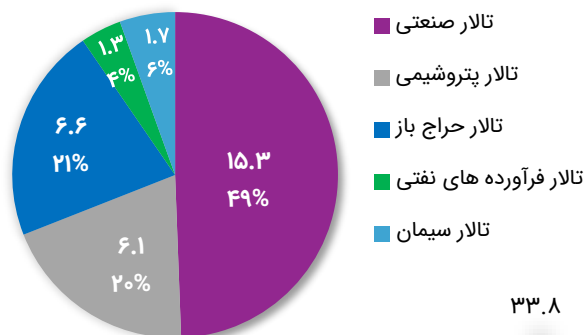
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلوگرمی بوده است.

افزایش ۲۳.۱ درصدی قیمت گاز طبیعی در پی تشدید تحریم‌های اروپا علیه روسیه به دلیل احتمال پیروزی ترامپ در انتخابات و تغییر سیاست‌های وی در مقابل روسیه

شرح	آخرین قیمت	هفته گذشته		ماه گذشته		سال گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۲,۷۸۱	۲,۷۱۵	۲.۴%	۲,۶۳۳	۵.۶%	۱,۹۸۴	۴۰.۲%
سکه (هزار ریال)	۵۴۴,۹۰۰	۵۵۱,۷۵۰	-۱.۲%	۴۶۲,۷۰۰	۱۷.۸%	۲۹۷,۰۱۰	۸۳.۵%
دلار اسکناس (ریال)	۵۰۶,۳۱۴	۵۰۳,۴۴۰	۰.۶%	۴۹۷,۳۹۲	۱.۸%	۴۱۲,۷۸۸	۲۲.۷%
دلار حواله (ریال)	۴۹۲,۵۲۳	۴۸۹,۷۲۸	۰.۶%	۴۶۷,۴۷۴	۵.۴%	۳۷۵,۲۶۲	۳۱.۲%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۷۲	۷۵	-۴.۷%	۷۲	-۰.۱%	۸۶	-۱۶.۳%
بیت‌کوین (دلار)	۷۲,۳۹۳	۶۶,۴۳۲	۹.۰%	۶۳,۳۳۰	۱۴.۳%	۳۴,۶۶۸	۱۰۸.۸%
مس LME (دلار/تن)	۹,۴۳۰	۹,۳۶۳	۰.۷%	۹,۷۶۶	-۳.۴%	۸,۰۳۶	۱۷.۳%
روی LME (دلار/تن)	۳,۱۶۰	۳,۱۶۵	-۰.۲%	۳,۰۷۵	۲.۸%	۲,۴۳۲	۲۹.۹%
بیلت CIS (دلار/تن)	۴۷۹	۴۸۶	-۱.۴%	۴۵۹	۴.۴%	۴۷۰	۱.۹%
بیلت ایران (دلار/تن)	۴۶۶	۴۶۶	۰.۰%	۴۵۹	۱.۵%	۴۵۹	۱.۵%
متانول CFR (\$/mt)	۲۸۵	۲۸۳	۰.۷%	۲۹۲	-۲.۴%	۲۷۶	۳.۳%
سبد اوره (mt/\$)	۳۵۷	۳۵۹	-۰.۵%	۳۴۲	۴.۵%	۳۷۵	-۴.۷%
گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)	۲.۸۸	۲.۳۴	۲۳.۱%	۲.۶۵	۸.۷%	۳.۳۴	-۱۳.۸%

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهم هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

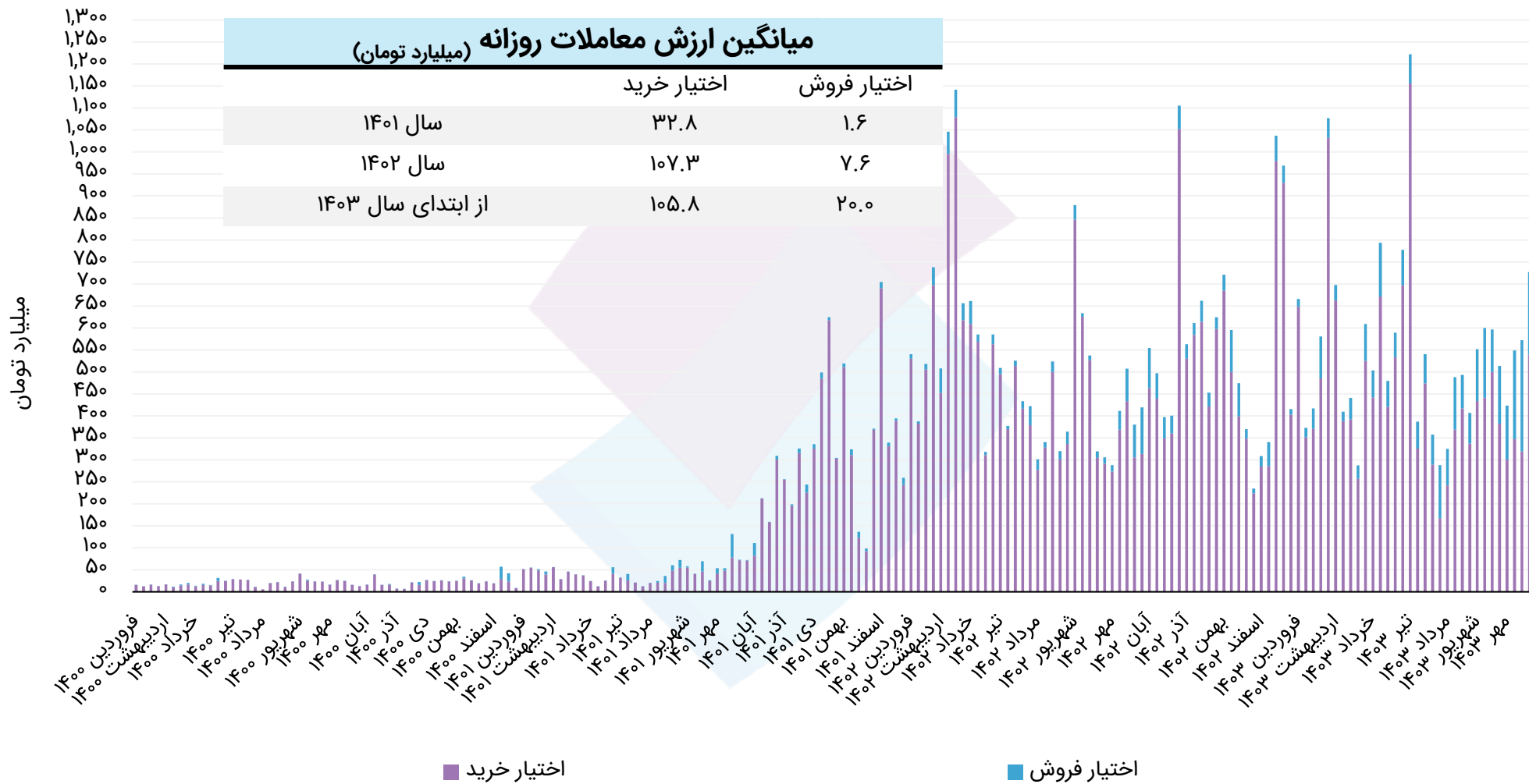


ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

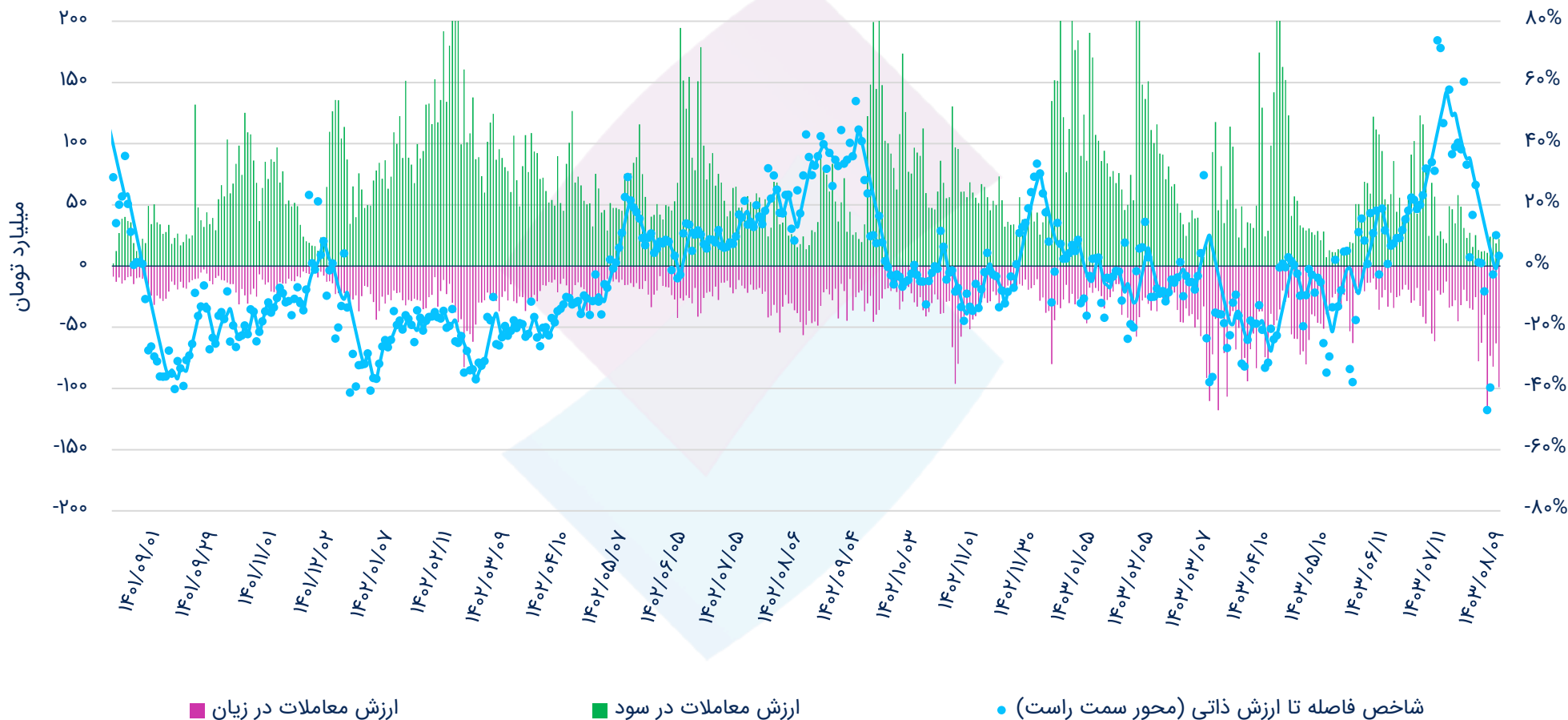
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات(تن)	عرضه کننده
شمش بلوم	۲۲.۹	۲۲۱,۱۵۰	فولاد کاوه جنوب کیش، فولاد خوزستان، آهن و فولاد ارفع، فولاد بوتیای ایرانیان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، ذوب آهن اصفهان
آهن اسفنجی	۱۳.۳	۱۷۲,۵۰۰	توسعه آهن و فولاد گل گهر، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، احیاء استیل فولاد بافت، پارس فولاد سبزواری، فولاد غدیر نی ریز
وکیوم باتوم	۱۶.۹	۱۱۲,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز
مس کاتد	۵۰۱.۱	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
سیمان	۱.۴	۱,۲۵۹,۱۸۷	سیمان تهران، سیمان ساوه، سیمان آبیک، سیمان مازندران، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان صوفیان، سیمان هرمزگان، سیمان هگمتان، سیمان سپاهان، سیمان خوزستان، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان ارومیه
میلگرد	۲۷.۲	۵۲,۸۰۵	مجتمع فولاد خراسان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد آذربایجان، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، فولاد عتیق آذر سهند، فولاد شاهرود، فولاد کاوه اروند، فولاد آلیاژی ایران
ورق سرد	۳۶.۸	۳۵,۸۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، فولاد غرب آسیا، فولاد امیرکبیر کاشان، صنایع هفت الماس
مس مفتول	۵۳۳.۶	۲,۲۳۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، گروه صنایع کابلسازی افق البرز، فرآوری مس درخشان تخت گنبد، صنایع مس مفتولی ابهر، صنایع شکوه مس قم
ورق گالوانیزه	۴۳.۰	۲۴,۸۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تاراز چهارمحال، فولاد مبارکه اصفهان، مجتمع فولادی روی اندودکاوه، صنایع هفت الماس، گروه صنعتی دانیال استیل
گندله سنگ آهن	۵.۵	۱۹۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر
سنگ آهن	۱.۵	۵۷۰,۰۰۰	سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، تماس
لوب کات	۲۳.۱	۳۸,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت بندرعباس
کنسانتره سنگ آهن	۳.۷	۱۹۰,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، بین‌المللی اسم ایران
تختال	۲۳.۳	۳۰,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد جهان آرا اروند
پلی اتیلن ترفتالات	۵۴.۳	۱۲,۰۴۲	پتروشیمی تندگویان، پتروشیمی محب پلی استر خاوران

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

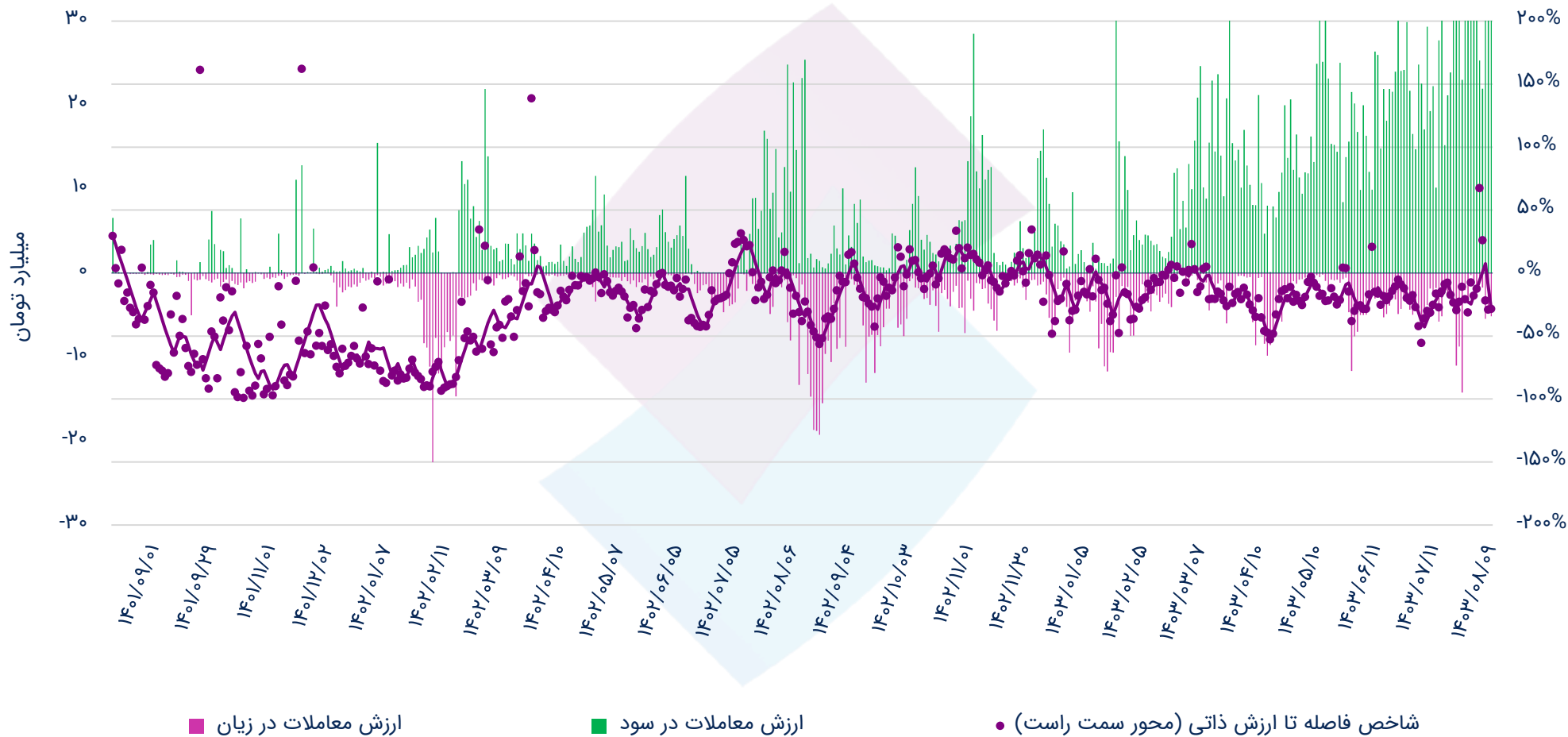


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

(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

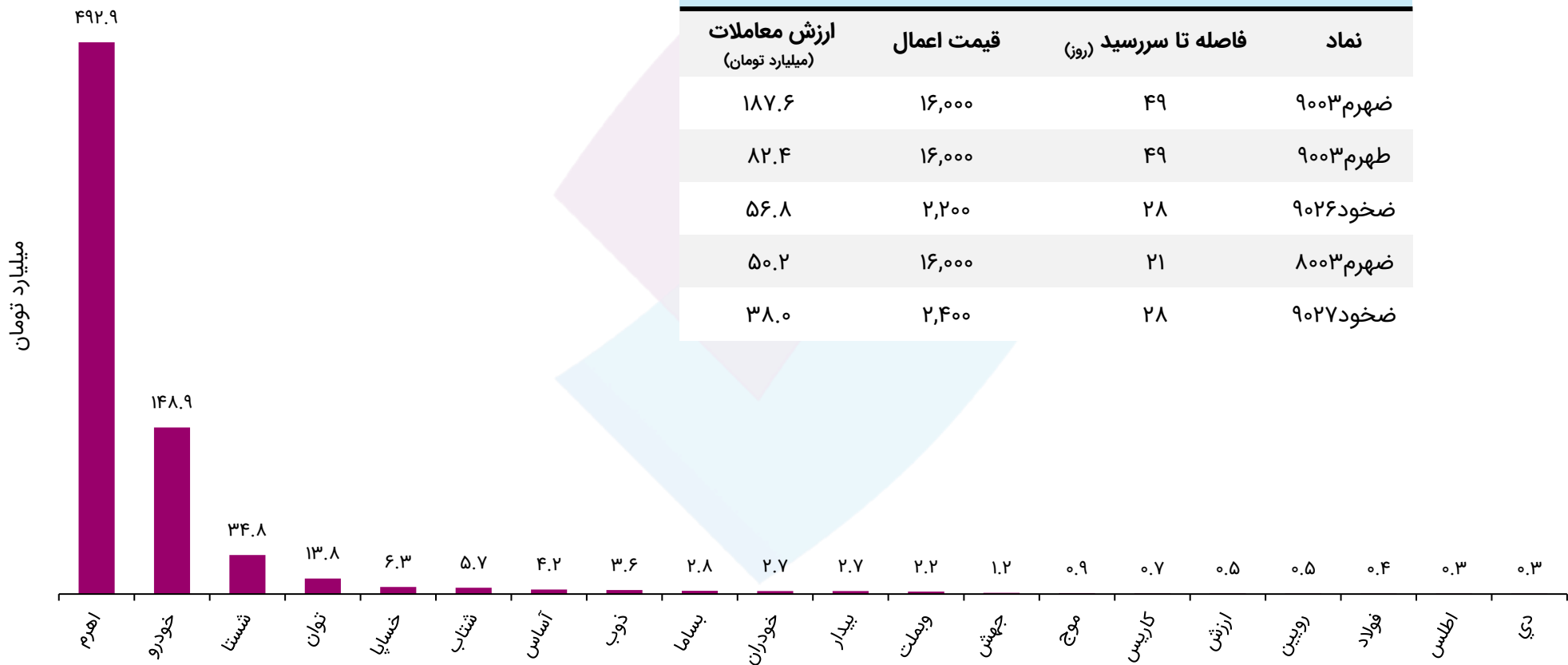


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).
(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

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)
ضهرم ۹۰۰۳	۴۹	۱۶,۰۰۰	۱۸۷.۶
طهرم ۹۰۰۳	۴۹	۱۶,۰۰۰	۸۲.۴
ضخود ۹۰۲۶	۲۸	۲,۲۰۰	۵۶.۸
ضهرم ۸۰۰۳	۲۱	۱۶,۰۰۰	۵۰.۲
ضخود ۹۰۲۷	۲۸	۲,۴۰۰	۳۸.۰



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 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.nibbroker.com)