

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 ۷ آذر - شماره ۱۷۸

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
۲۲	 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



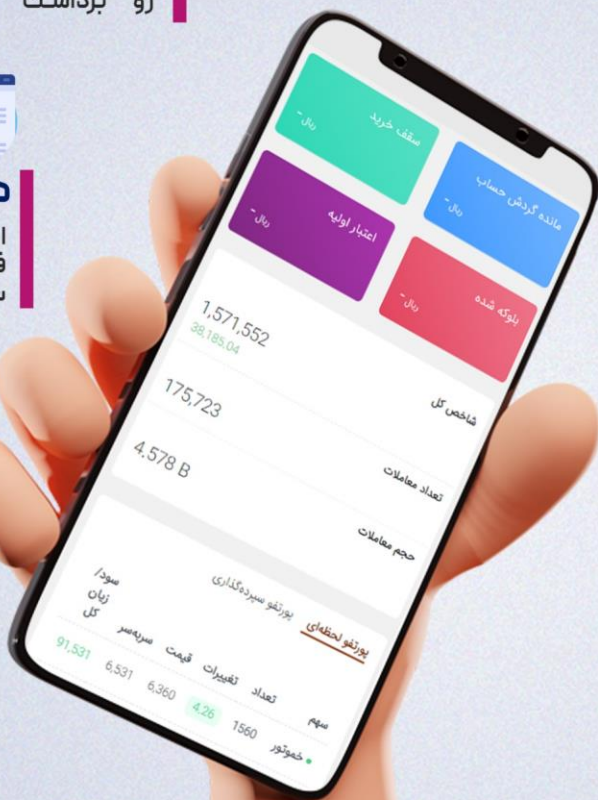
برداشت وجه آتی

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

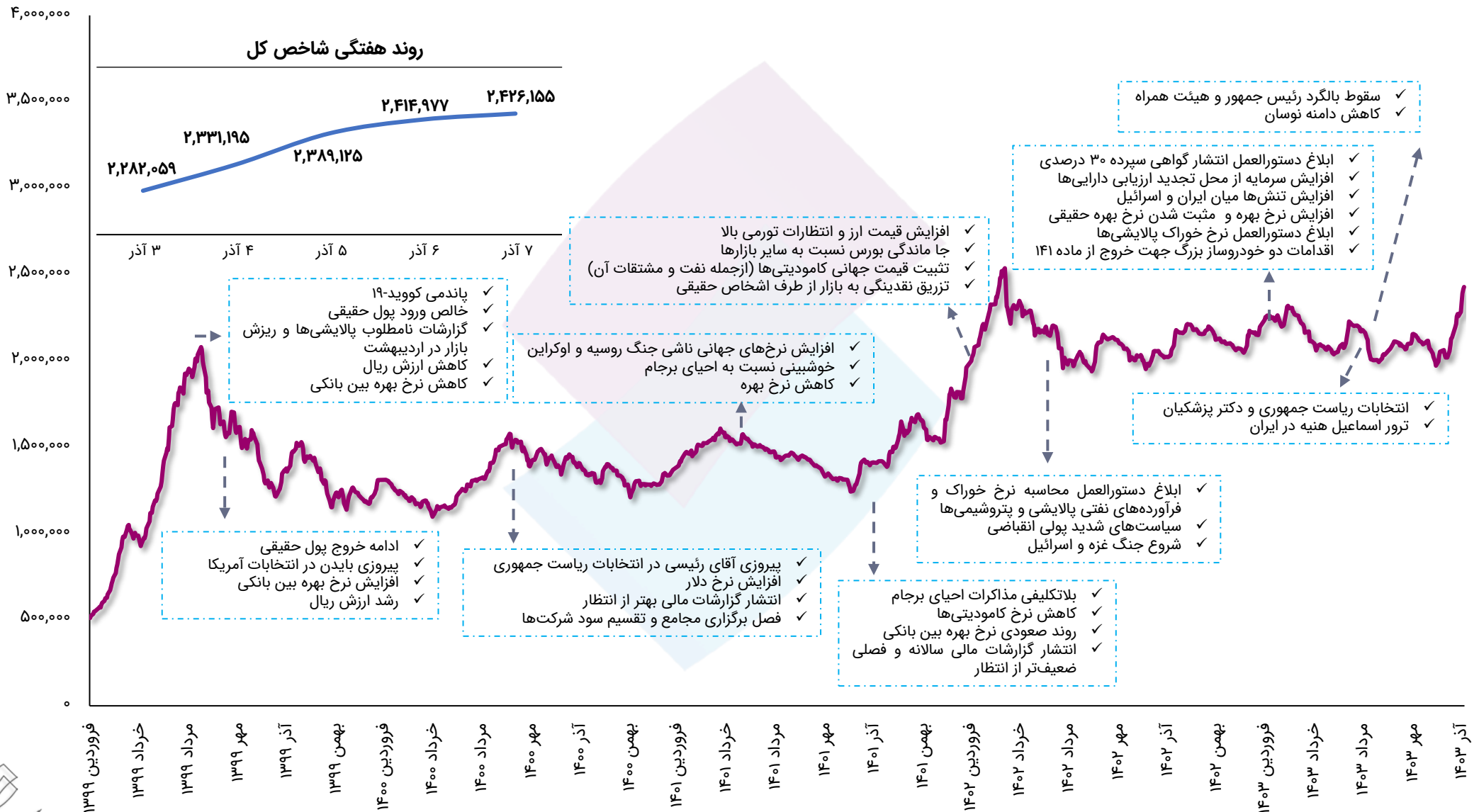
→ My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

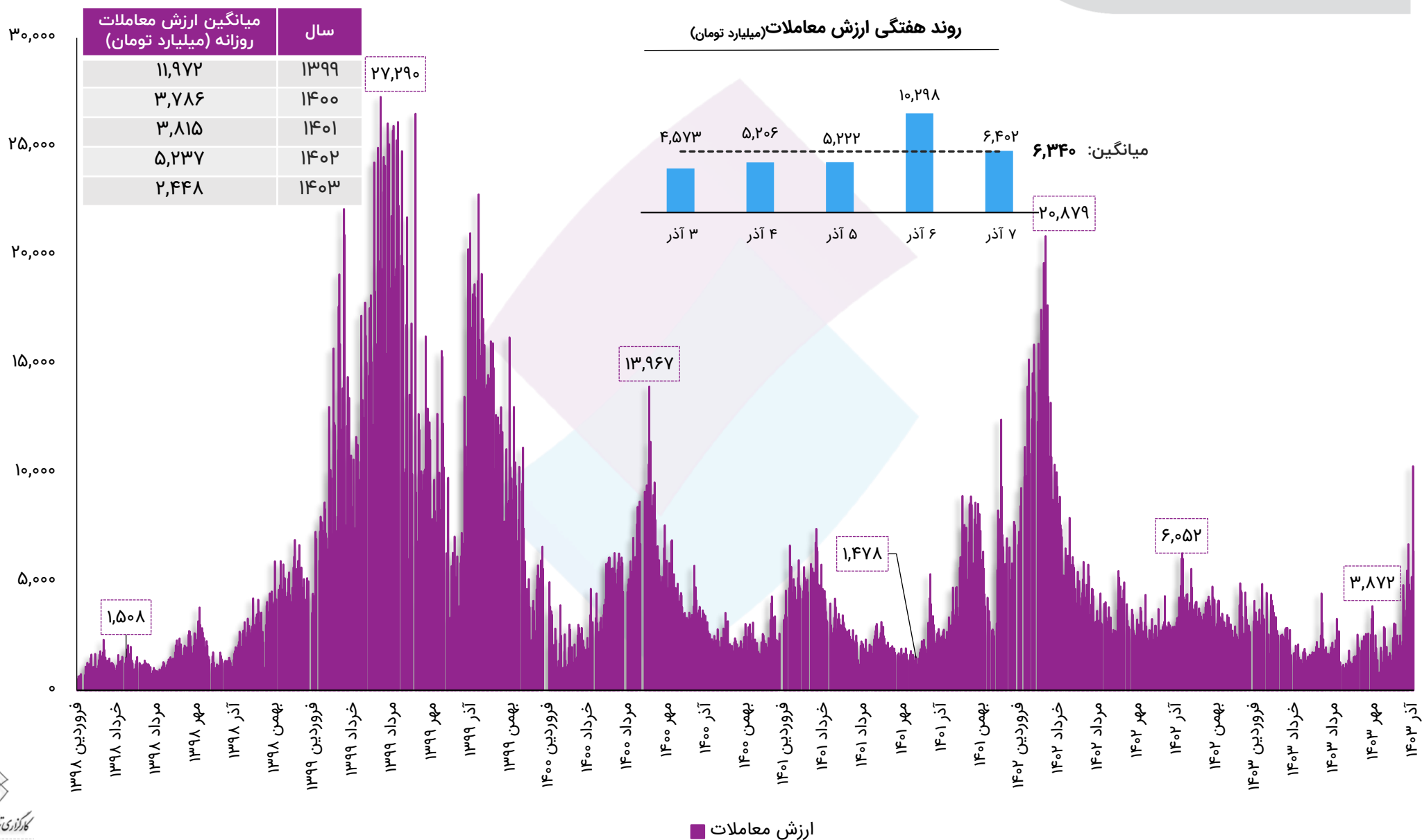


وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

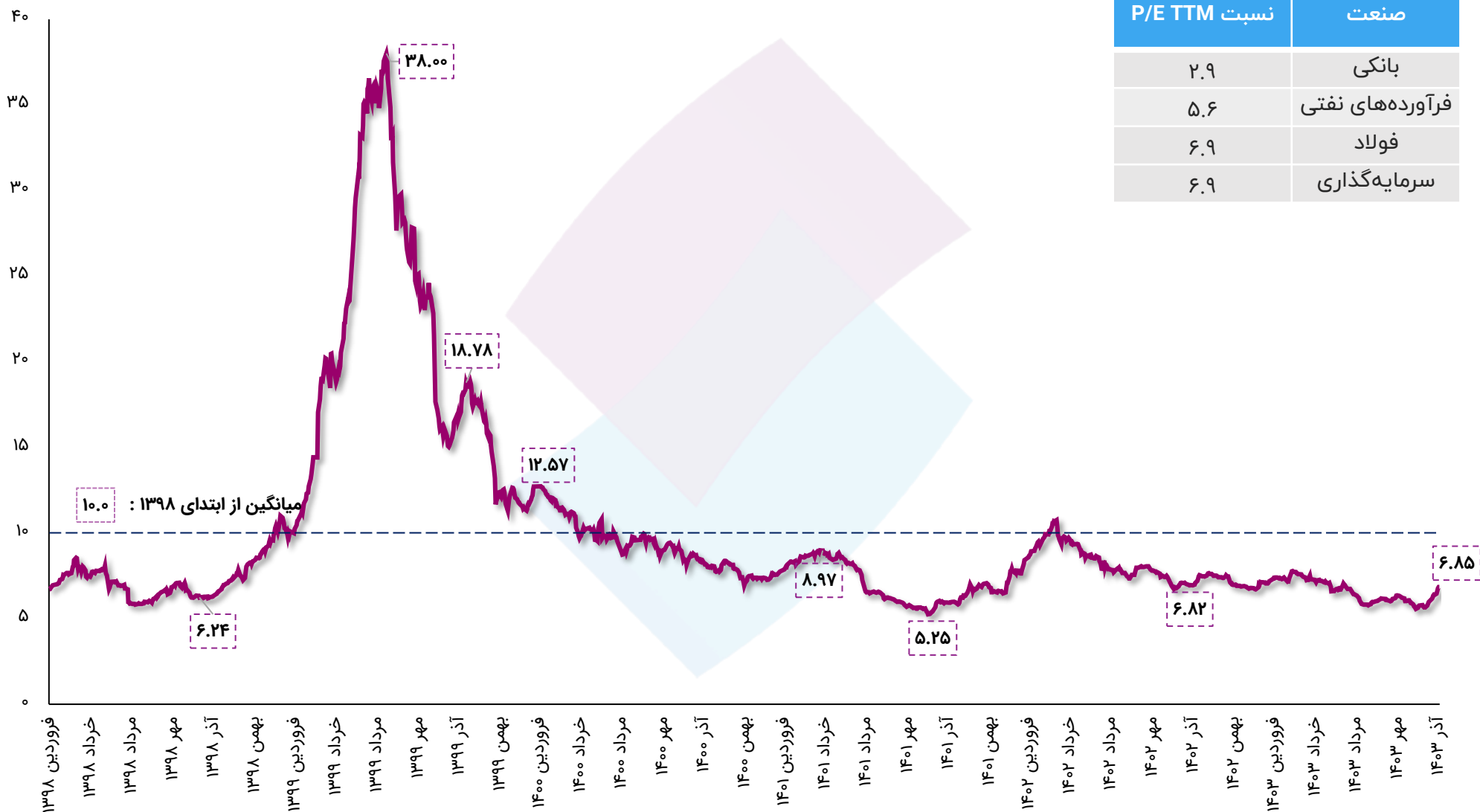
رشد ۷.۵ درصدی شاخص کل در هفته جاری



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



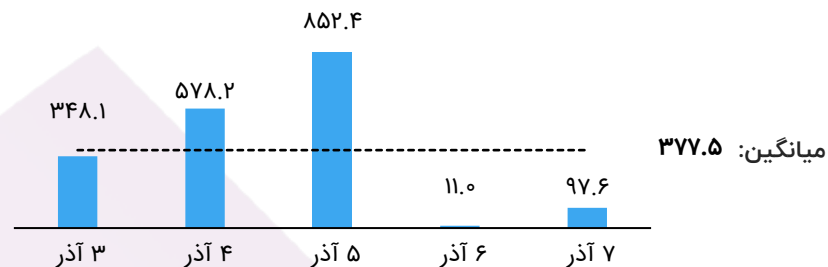
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



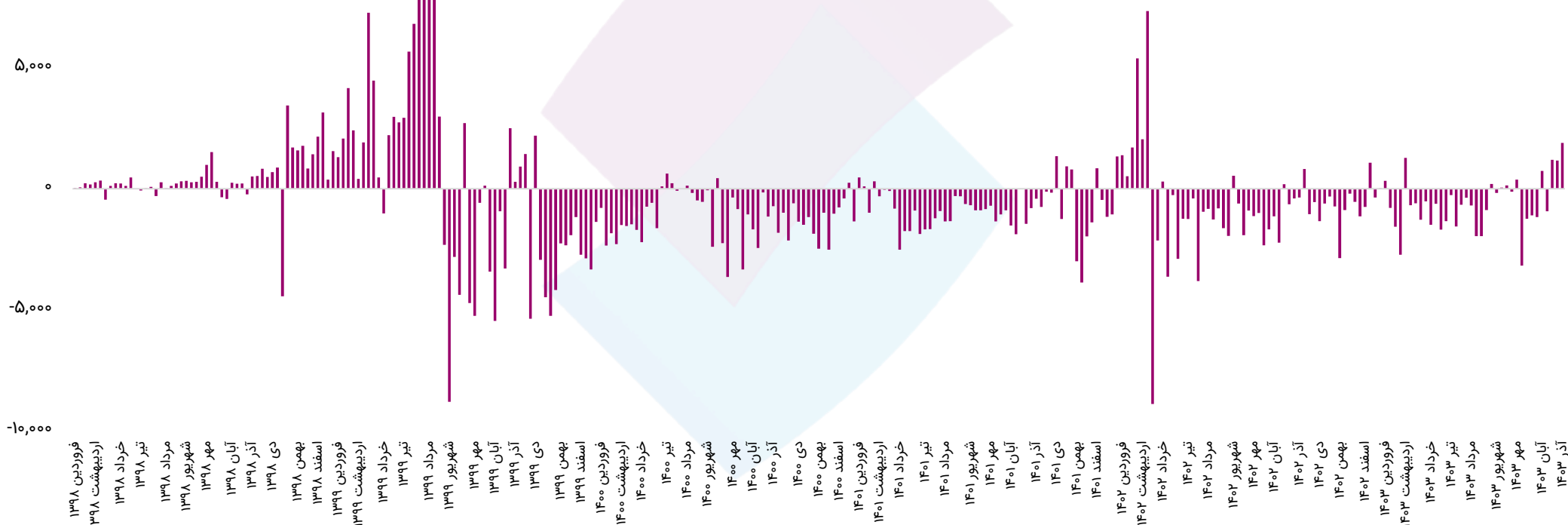
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۹	بانکی
۵.۶	فرآورده های نفتی
۶.۹	فولاد
۶.۹	سرمایه گذاری

۱،۸۸۷ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با ورود ۱،۱۶۵ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)



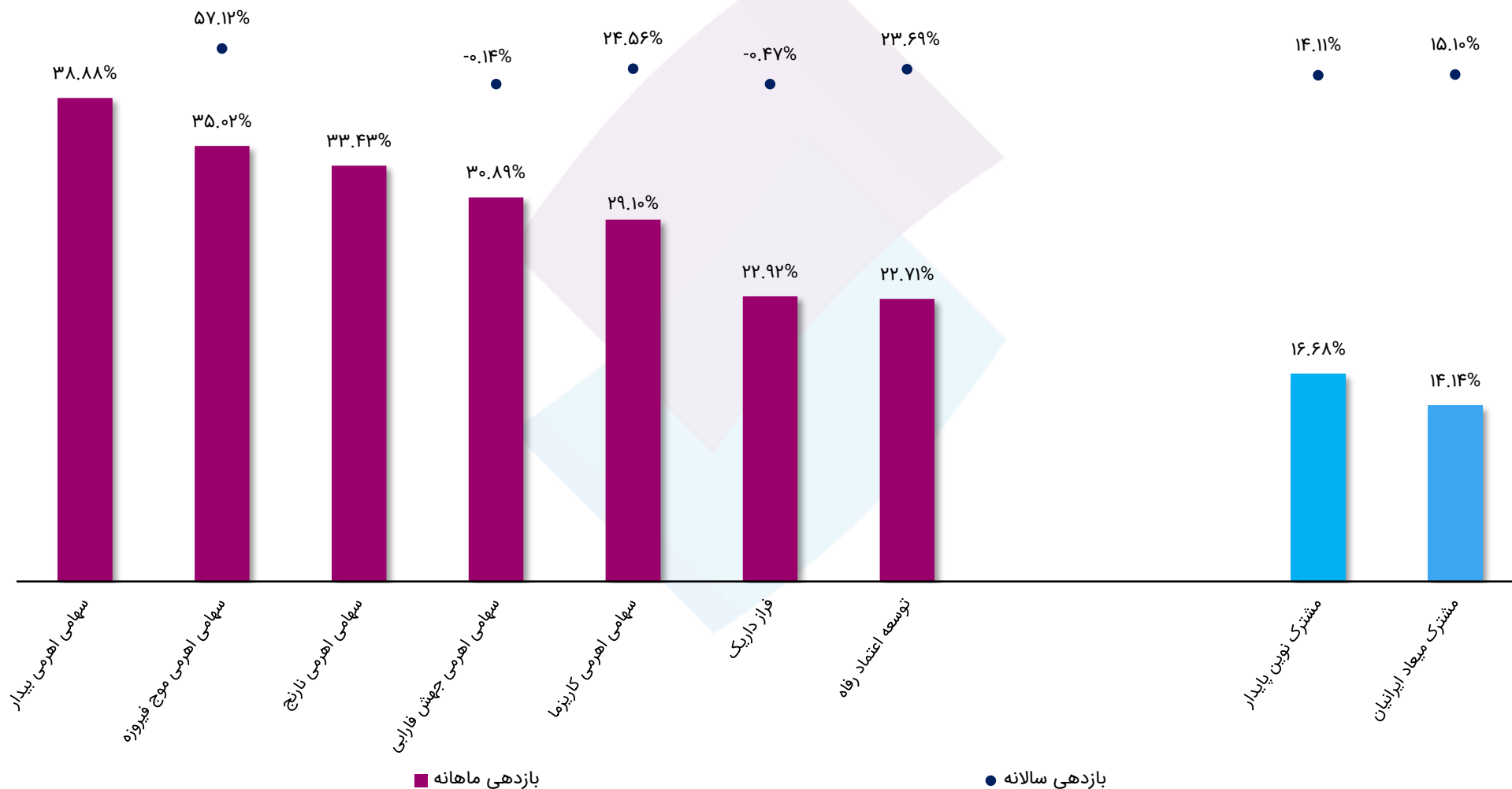
سال	خالص ورود حقیقی (همت)
۱۳۹۹	۲۱.۷
۱۴۰۰	(۵۸.۹)
۱۴۰۱	(۴۲.۸)
۱۴۰۲	(۳۶.۳)
۱۴۰۳	(۲۲.۲)



خالص ورود و خروج هفتگی

صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

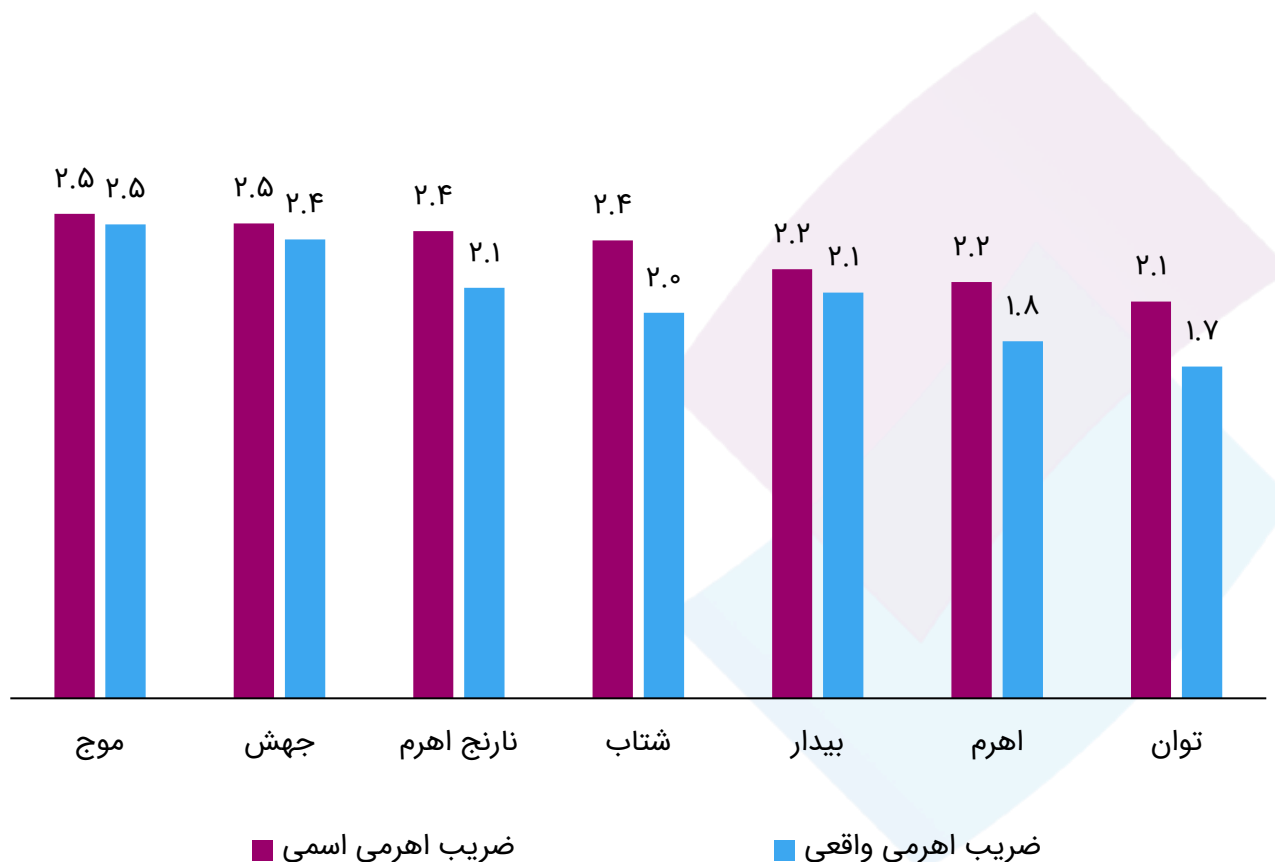
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بازدهی ماهانه

بازدهی سالانه

صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
بیدار	-۸.۳%	۲.۴
جهش	-۷.۱%	۲.۴
شتاب	-۶.۴%	۲.۱
اهرم	-۵.۷%	۲.۱
نارنج اهرم	-۵.۷%	۲.۴
توان	-۴.۶%	۲.۱
موج	-۲.۸%	۲.۲

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۴۸.۲%	۲.۵%
بیدار	۳۵.۹%	۲.۵%
جهش	۳۳.۶%	۲.۵%
نارنج اهرم	۳۳.۶%	۲.۵%
اهرم	۳۱.۷%	۲.۵%
توان	۲۷.۵%	۲.۲%
شتاب	۲۵.۰%	۲.۴%

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

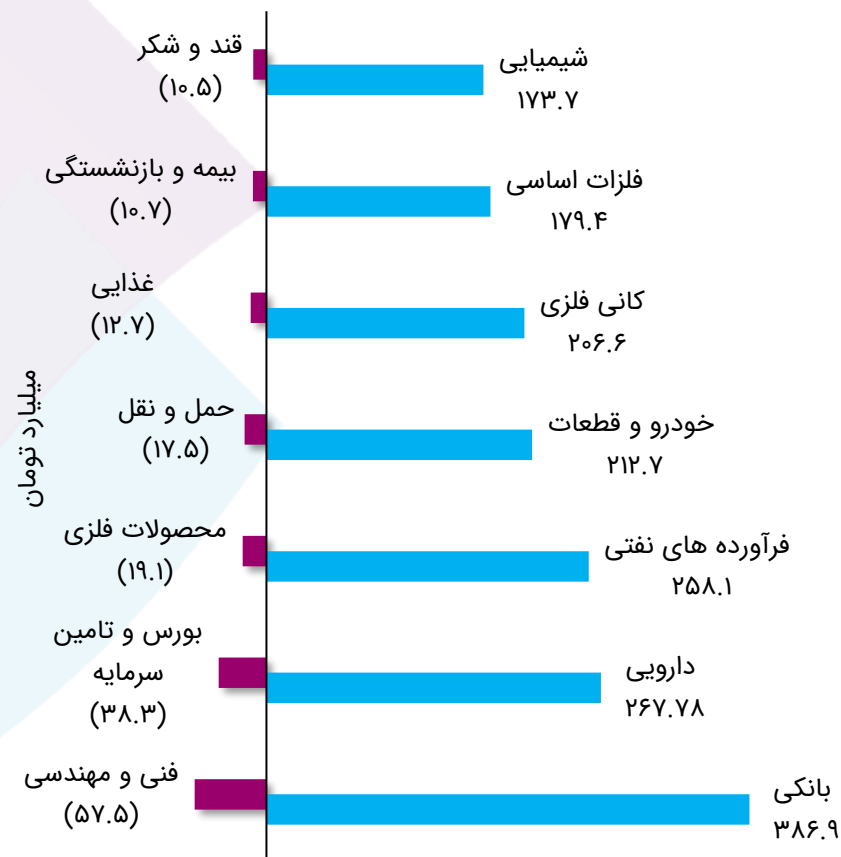
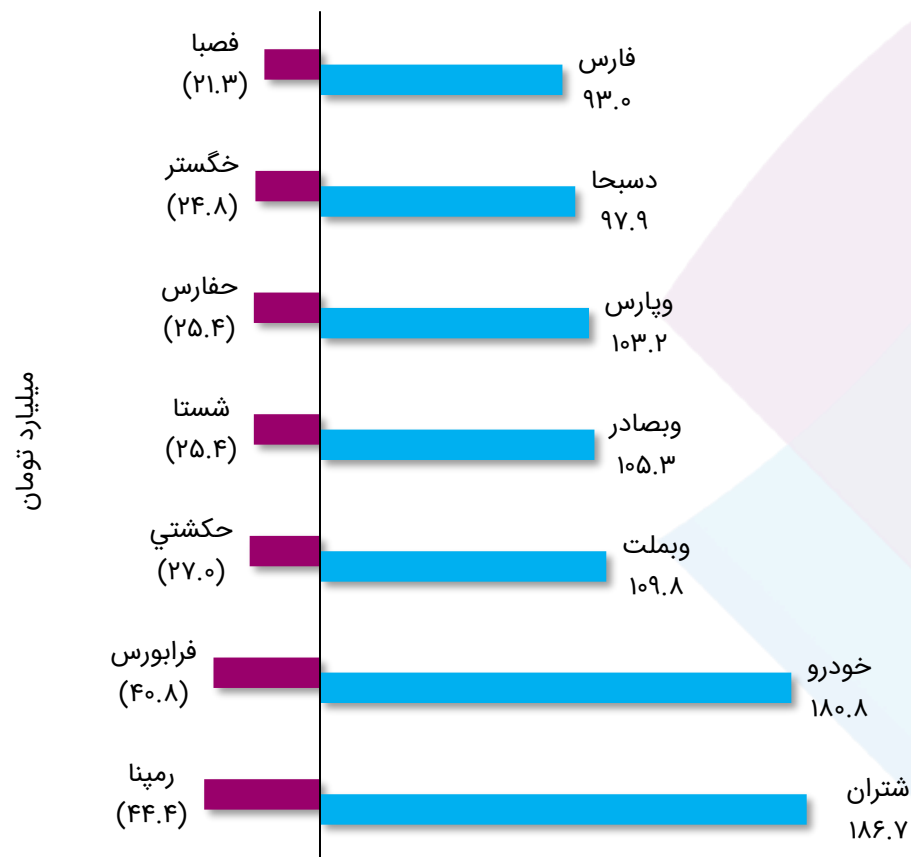
ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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.

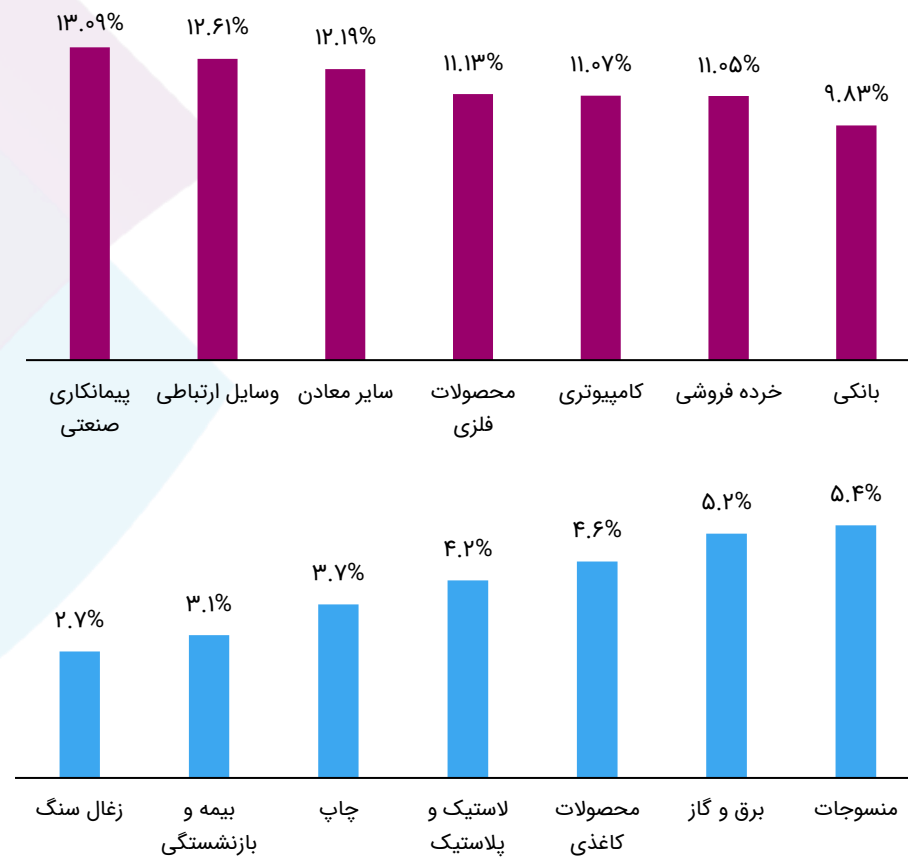
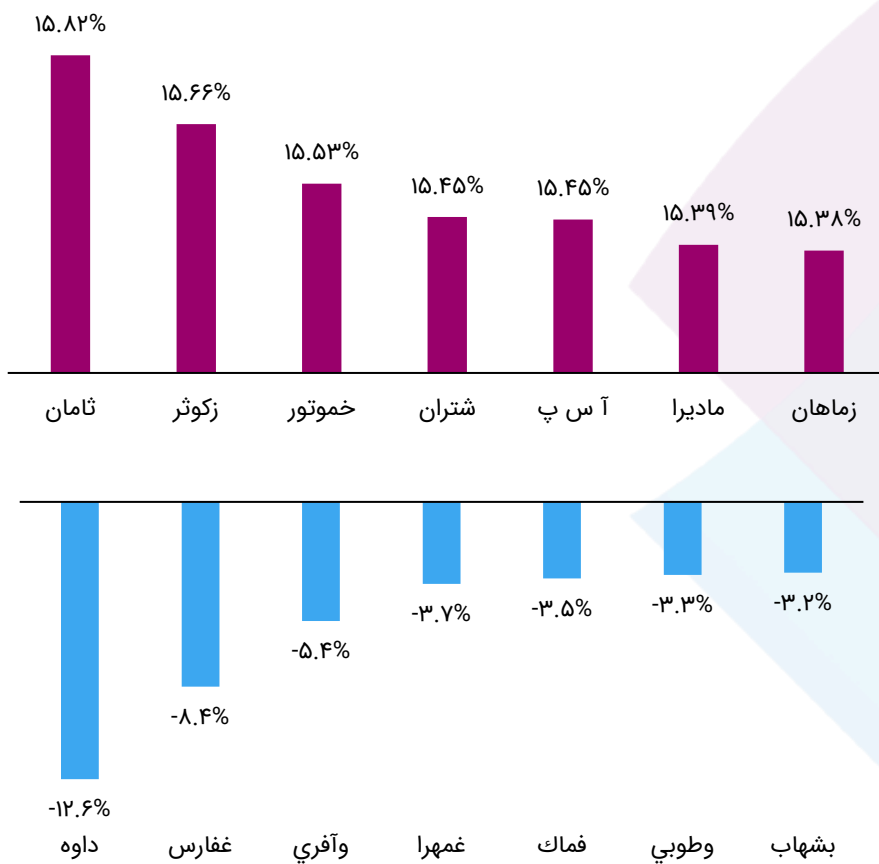
نماد

صنعت



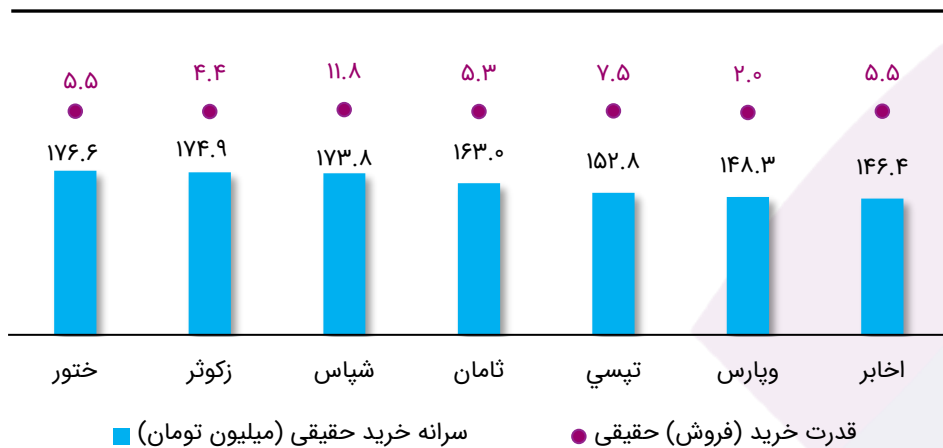
نماد

صنعت

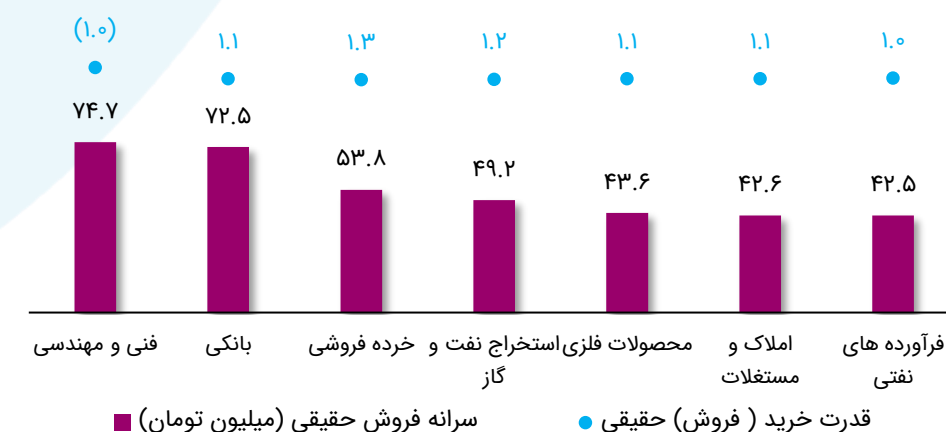
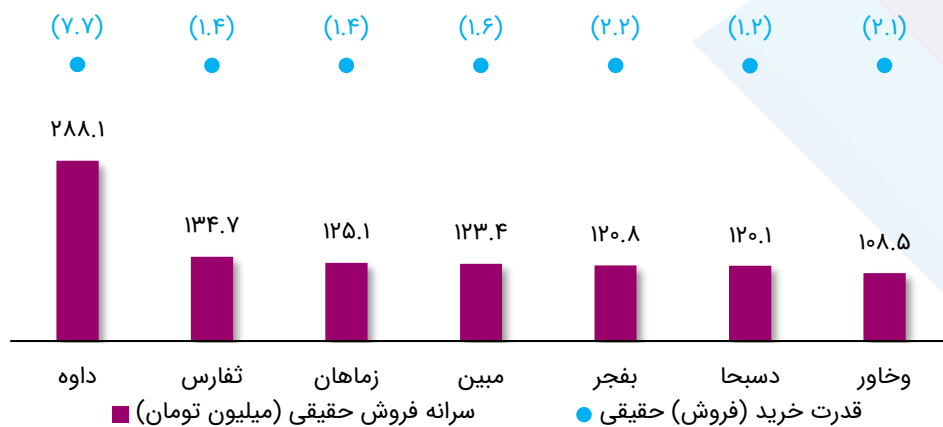
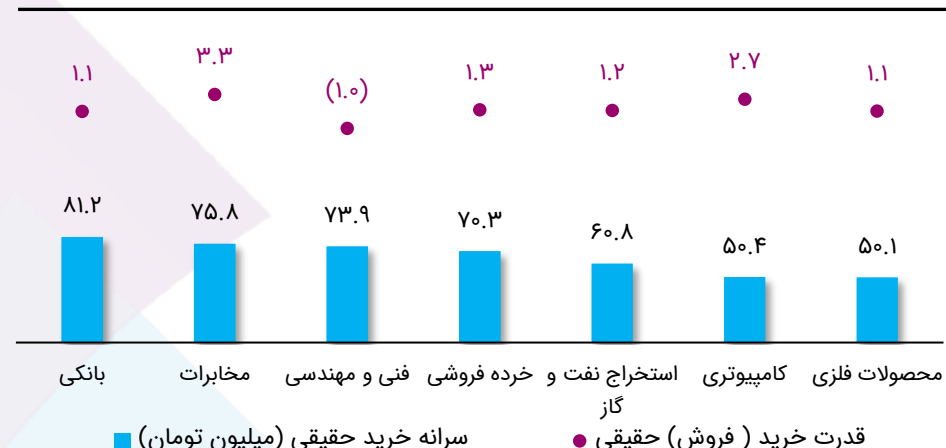


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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

پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه

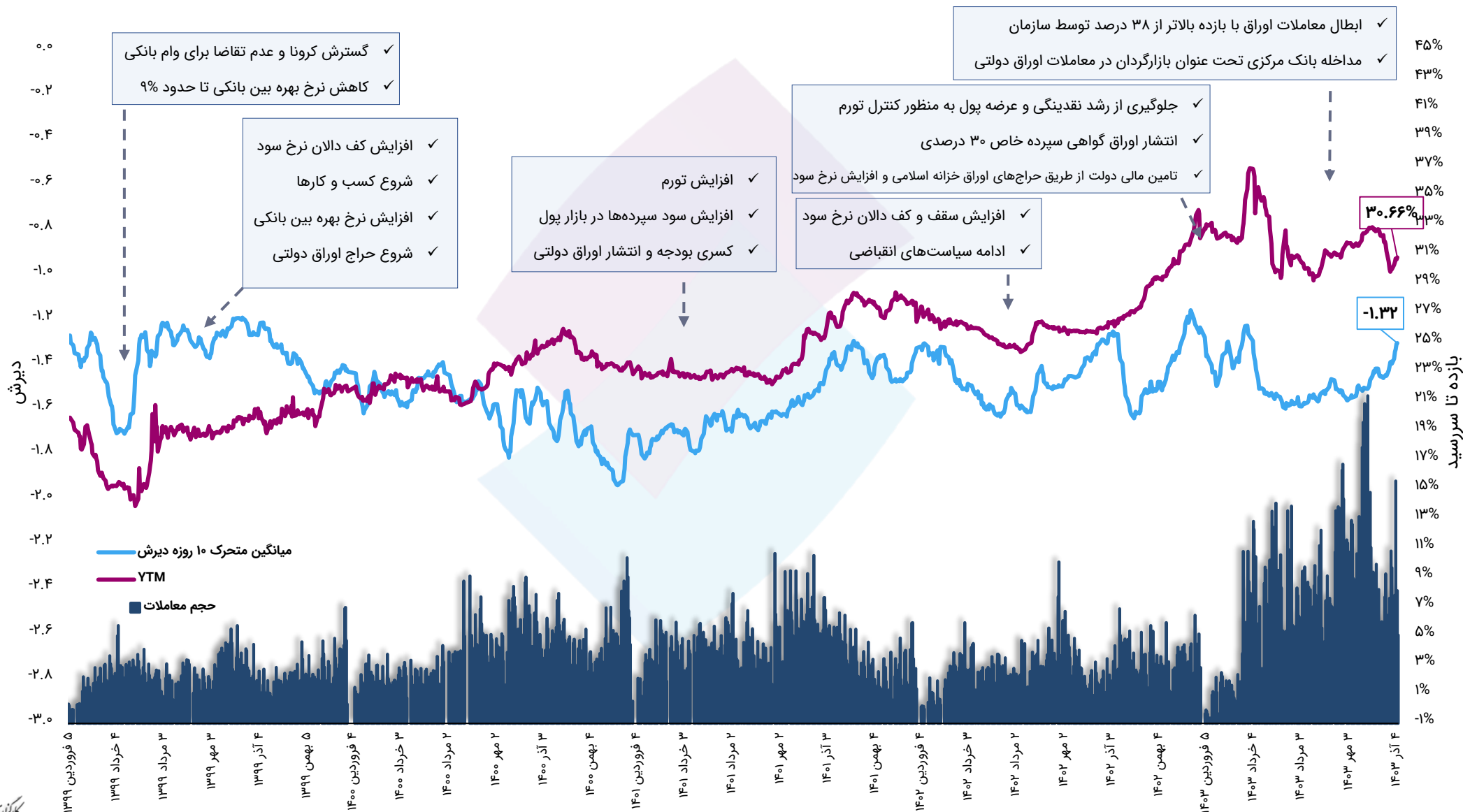
پکرمان	۵۰۵	۱,۹۶۹	۲۹۰%	آورده نقدی سود انباشته	تامین منابع مورد نیاز طرح توسعه ۲۶ هزار تنی و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های فرعی
غالب	۴۶	۱,۰۰۰	۲۰۶۵%	تجدید ارزیابی	بهبود ساختار مالی
وسپه	۳,۰۴۰	۴,۲۰۰	۳۸%	آورده نقدی سود انباشته آورده نقدی با سلب حق تقدم	جبران مخارج سرمایه ای، مشارکت در افزایش سرمایه های در جریان شرکت های سرمایه پذیر و انجام سرمایه گذاری های جدید
زملارد	۱,۴۰۲	۱,۸۸۶	۳۵%	آورده نقدی	تکمیل احداث پروژه ۳۰۰۰ راس مولد ملایر

تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه

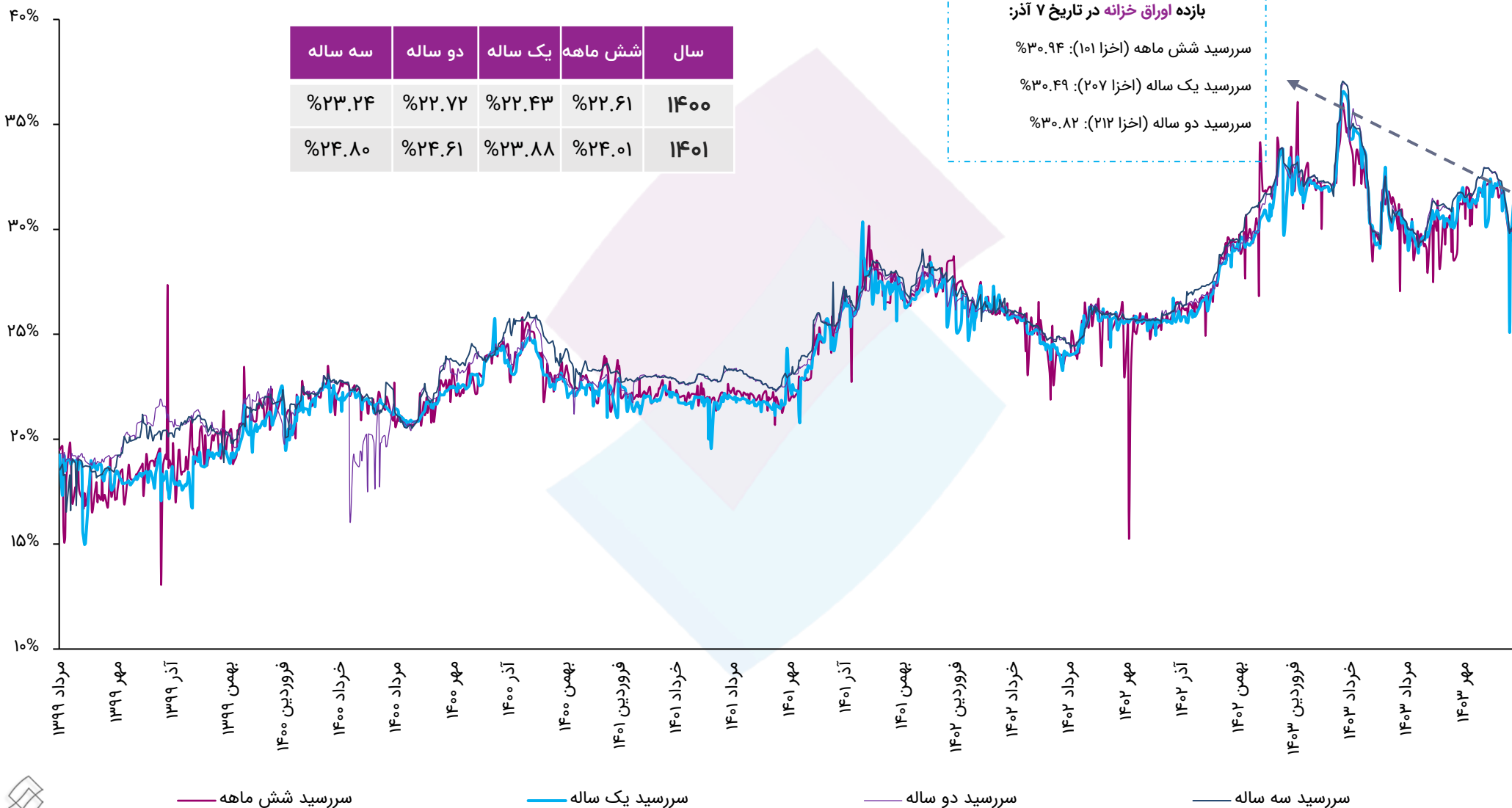
شفام	۱۰۰	۵۰۰	۴۰۰%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد
ثمسکن	۶۳۰	۱,۵۸۰	۱۵۱%	سود انباشته (۹%) اندوخته (۹۱%)	مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر و جبران مخارج سرمایه ای انجام شده
وفتخار	۲۰۰	۲۵۰	۲۵%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی و توسعه پرتفوی سرمایه گذاری
ددانا	۲۴۰	۷۲۰	۲۰۰%	سود انباشته	جلوگیری از خروج وجه نقد و تامین منابع مالی جهت اجرای طرح های توسعه ای
ساینا	۲۵	۲۱۰	۷۴۰%	آورده نقدی با سلب حق تقدم	جبران مخارج سرمایه ای

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام					
زنجان	۶۱۳	۸۷۵	۴۳%	آورده نقدی	تکمیل احداث کارخانه اوره و آمونیاک مهلت استفاده از حق تقدم سهام از تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۰۳ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۰۲ است.
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
خفهر	۲۵۰	۴۰۰	۶۰%	سودانباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی
داتام	۱,۰۰۰	۱,۲۰۰	۲۰%	آورده نقدی	مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر و تامین سرمایه در گردش

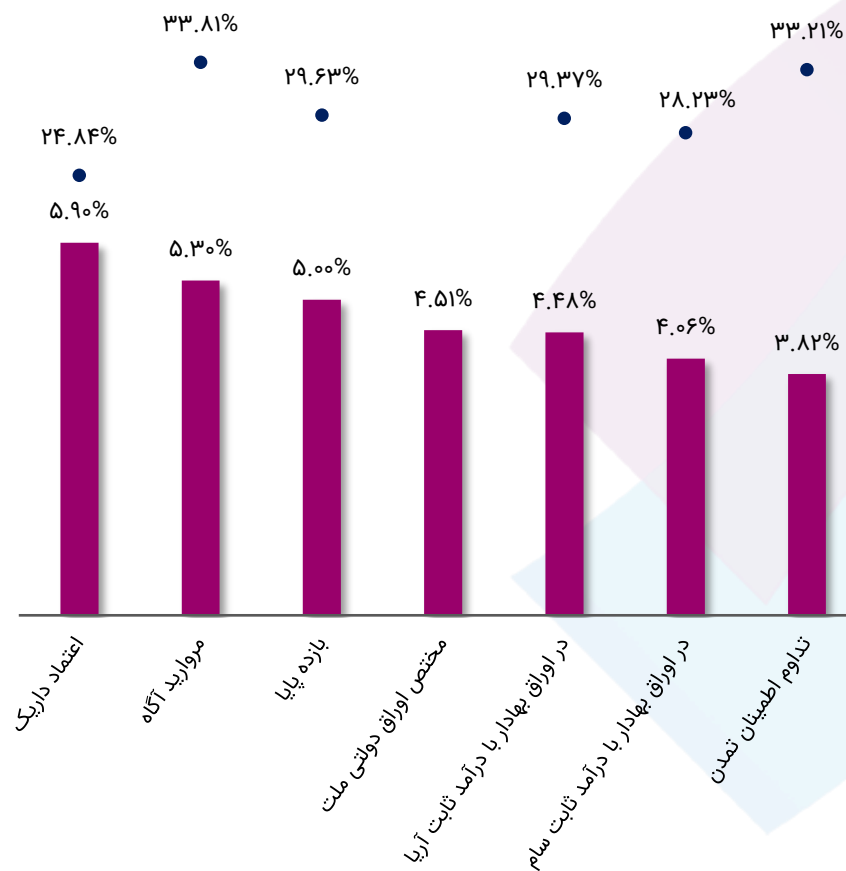
افزایش ۰.۸۱ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۰.۶۶ درصد



بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

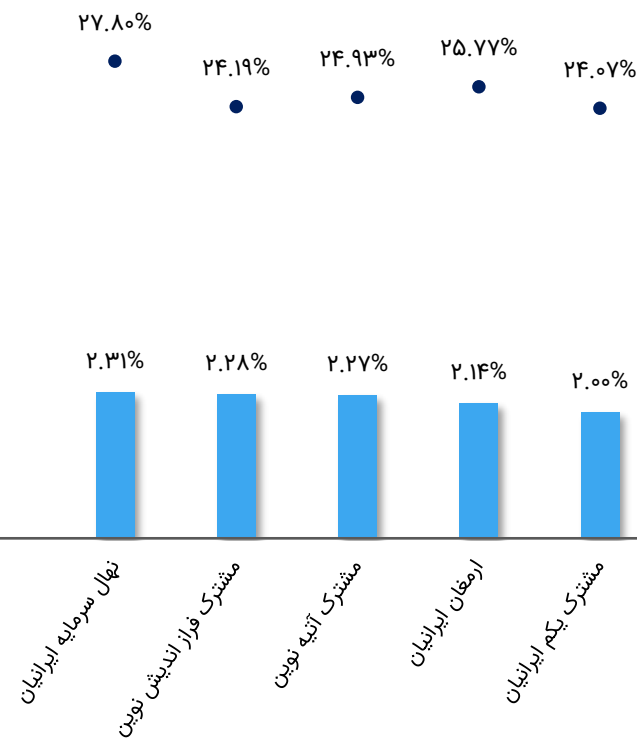


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



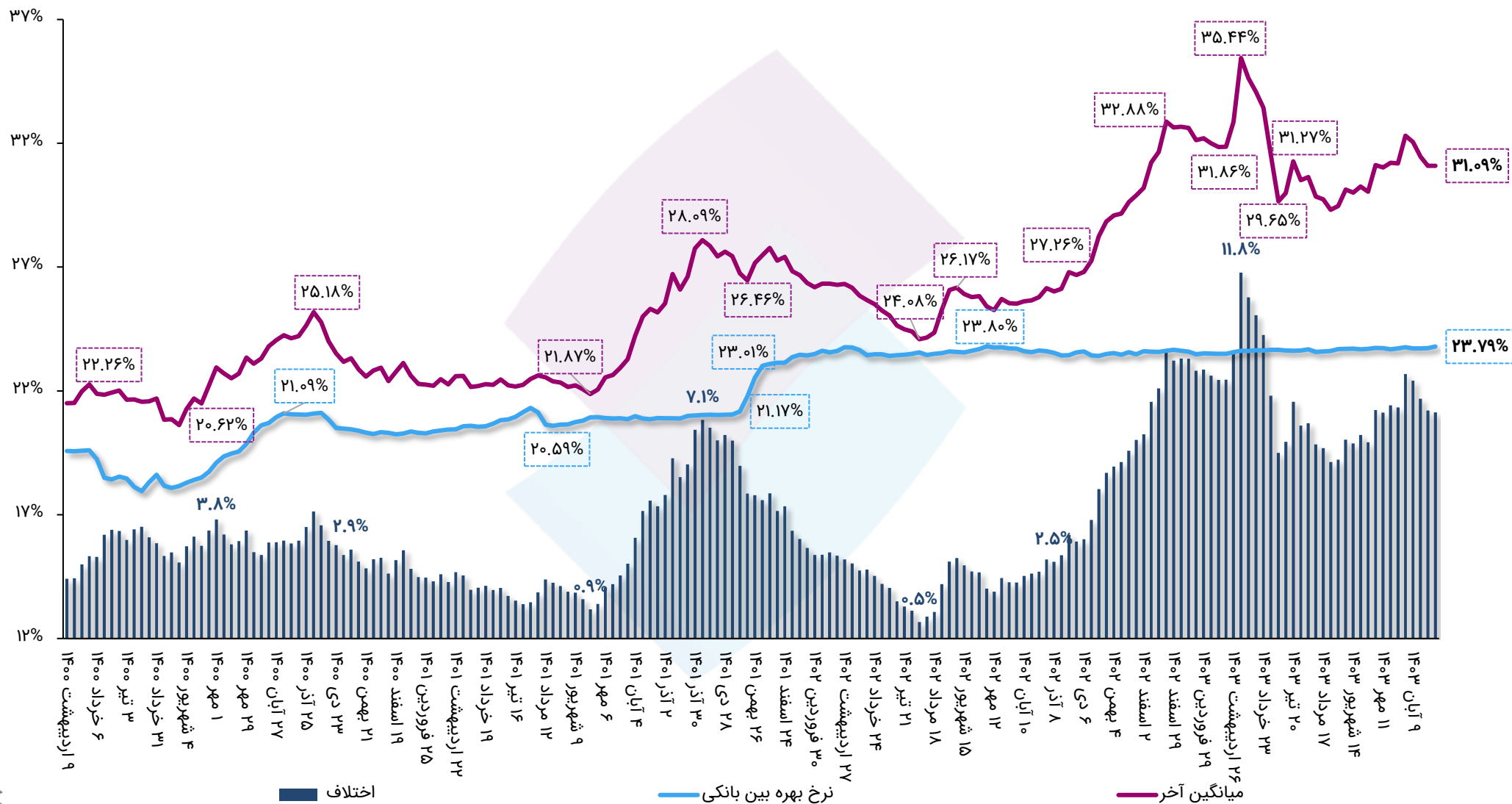
■ بازدهی ماهانه

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



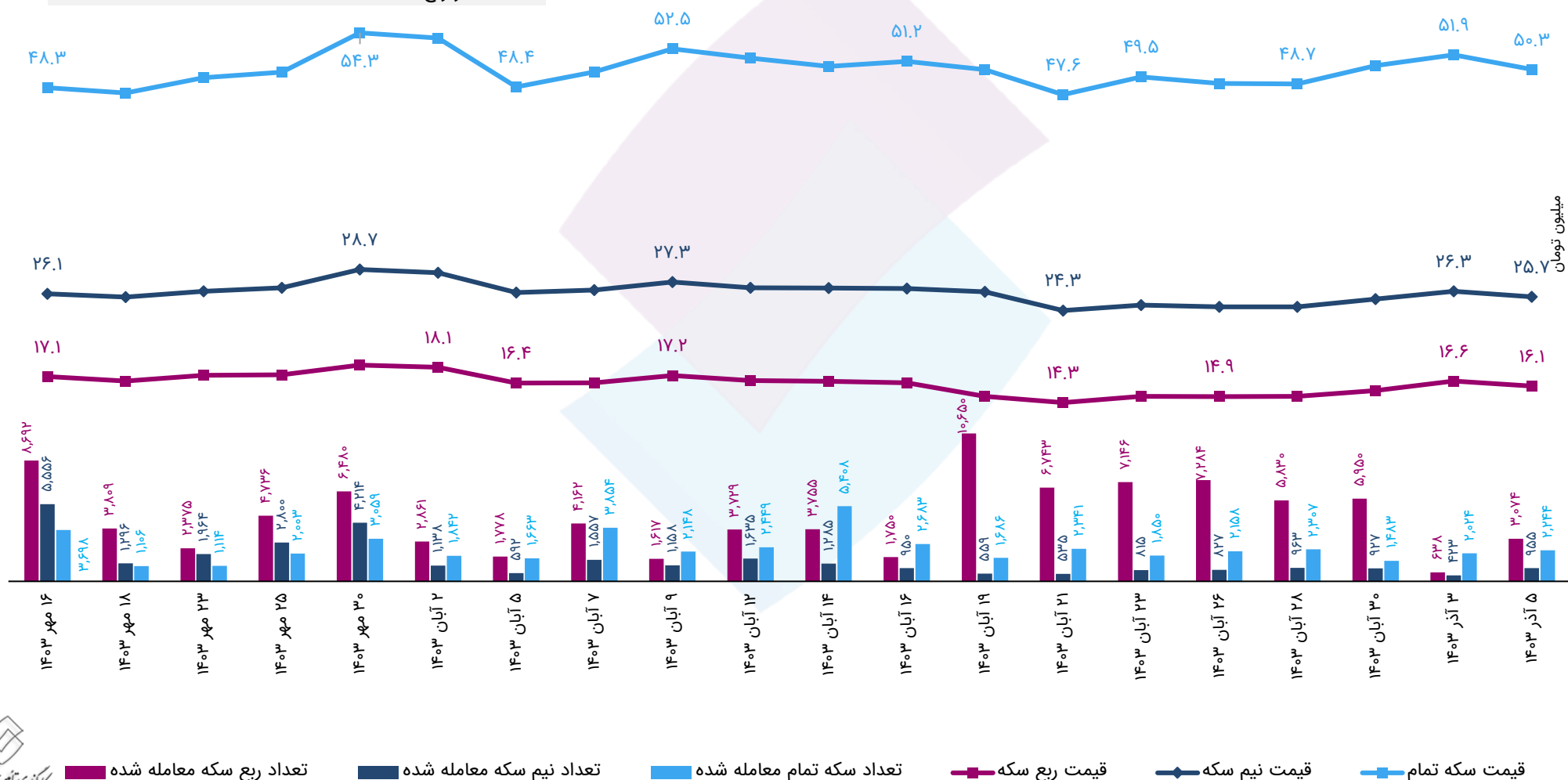
● بازدهی سالانه

افزایش ۰.۰۶ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۷۹ درصد و بیست و نهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی به مبلغ ۱۳.۱ همت



معامله ۵۰۵ هزار و ۴۷۳ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۵۳,۰۸۷	
دلار سکه تمام	۸۱,۳۰۰	
دلار نیم سکه	۸۳,۲۰۰	
دلار ربع سکه	۱۰۴,۱۰۰	



معامله ۱۲ هزار و ۶۲۸ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

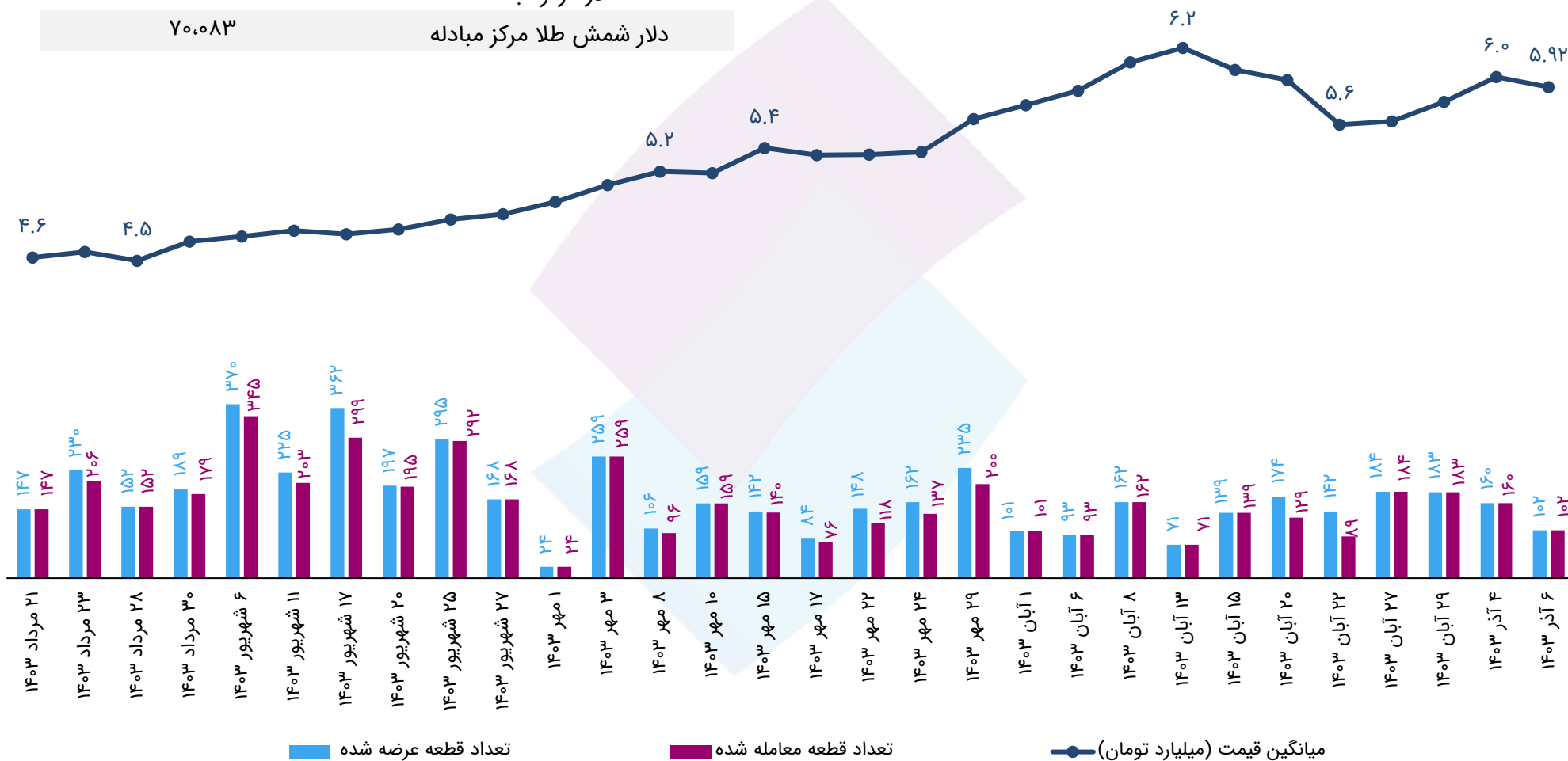
آخرین نرخ

مبلغ (تومان)

در تاریخ آخرین حراج

دلار مرکز مبادله

دلار شمش طلا مرکز مبادله



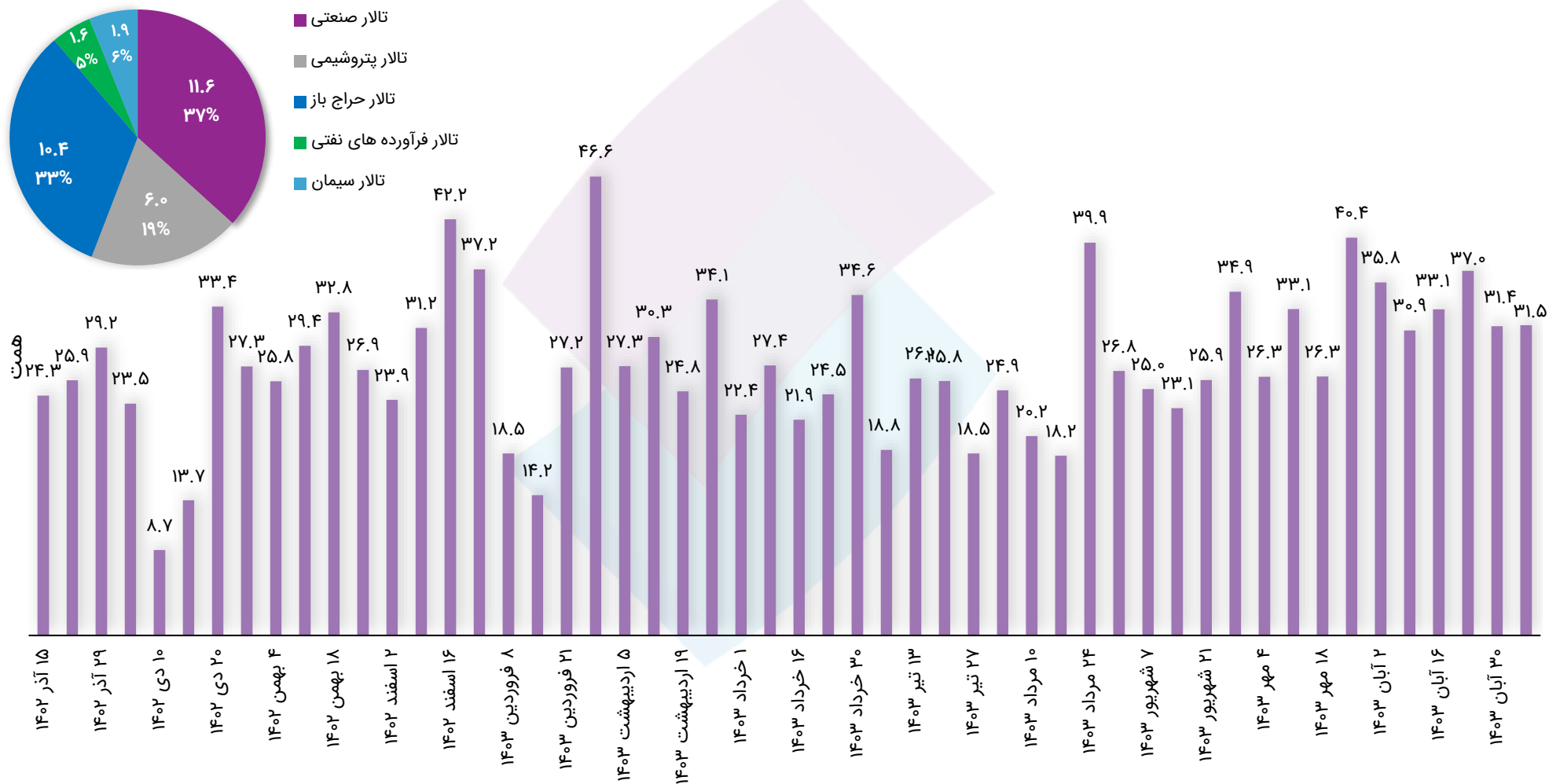
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

کاهش ۵.۶ درصدی قیمت بیلت در پی کاهش تقاضای فولاد تحت تأثیر نزدیک شدن فصل رکود ساخت و ساز

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۲۹.۸%	۲,۰۴۰	-۳.۴%	۲,۷۴۳	۰.۰%	۲,۶۴۹	۲,۶۴۹	طلا (دلار/انس)
۷۸.۵%	۲۸۹,۴۶۰	-۳.۵%	۵۳۵,۲۵۰	-۰.۴%	۵۱۸,۶۵۰	۵۱۶,۷۵۰	سکه (هزار ریال)
۲۷.۱%	۴۱۸,۷۶۱	۵.۵%	۵۰۴,۴۵۰	۱.۴%	۵۲۴,۵۴۶	۵۳۲,۰۴۷	دلار اسکناس (ریال)
۳۶.۰%	۳۸۰,۶۹۲	۵.۵%	۴۹۰,۷۱۰	۱.۴%	۵۱۰,۲۵۹	۵۱۷,۵۵۵	دلار حواله (ریال)
-۱۰.۶%	۸۲	۱.۳%	۷۲	-۰.۲%	۷۳	۷۳	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۴۷.۹%	۳۷,۸۳۱	۳۴.۲%	۶۹,۹۰۸	-۰.۶%	۹۴,۳۳۹	۹۳,۷۸۵	بیت کوین (دلار)
۷.۸%	۸,۲۷۷	-۵.۱%	۹,۴۰۰	-۱.۱%	۹,۰۲۱	۸,۹۲۳	مس LME (دلار/تن)
۲۱.۹%	۲,۵۲۹	-۰.۷%	۳,۱۰۵	۳.۹%	۲,۹۶۷	۳,۰۸۲	روی LME (دلار/تن)
-۶.۹%	۴۹۲	-۵.۸%	۴۸۶	۰.۰%	۴۵۸	۴۵۸	بیلت CIS (دلار/تن)
-۵.۶%	۴۶۶	-۵.۶%	۴۶۶	-۵.۶%	۴۶۶	۴۴۰	بیلت ایران (دلار/تن)
۶.۸%	۲۷۹	۴.۶%	۲۸۵	۴.۲%	۲۸۶	۲۹۸	متانول CFR (\$/mt)
۲.۸%	۳۲۲	-۷.۳%	۳۵۷	-۰.۷%	۳۳۳	۳۳۱	سبب اوره (mt/\$)
۲۰.۹%	۲.۷۸	۶۵.۵%	۲.۰۳	۵.۳%	۳.۱۹	۳.۳۶	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

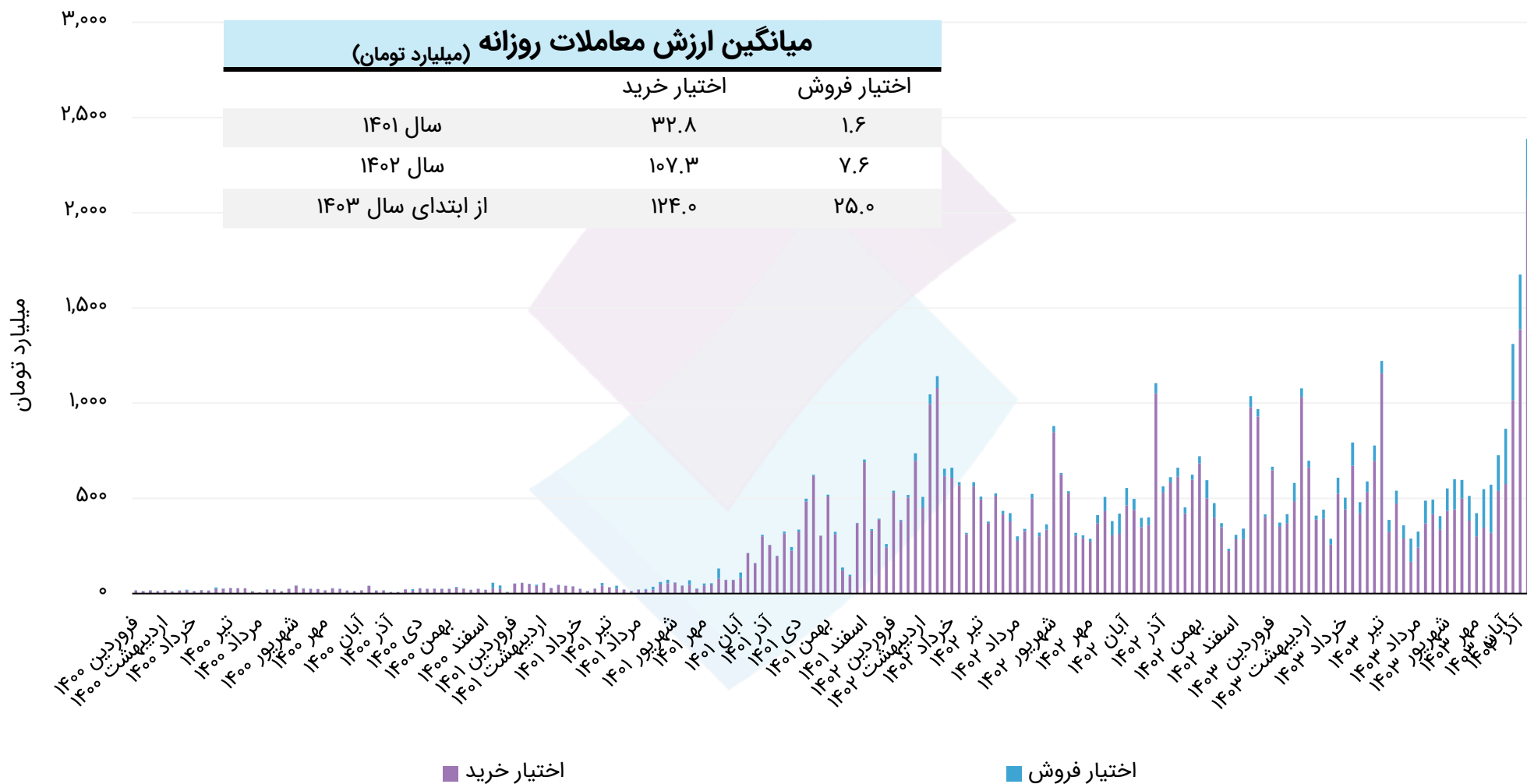


ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

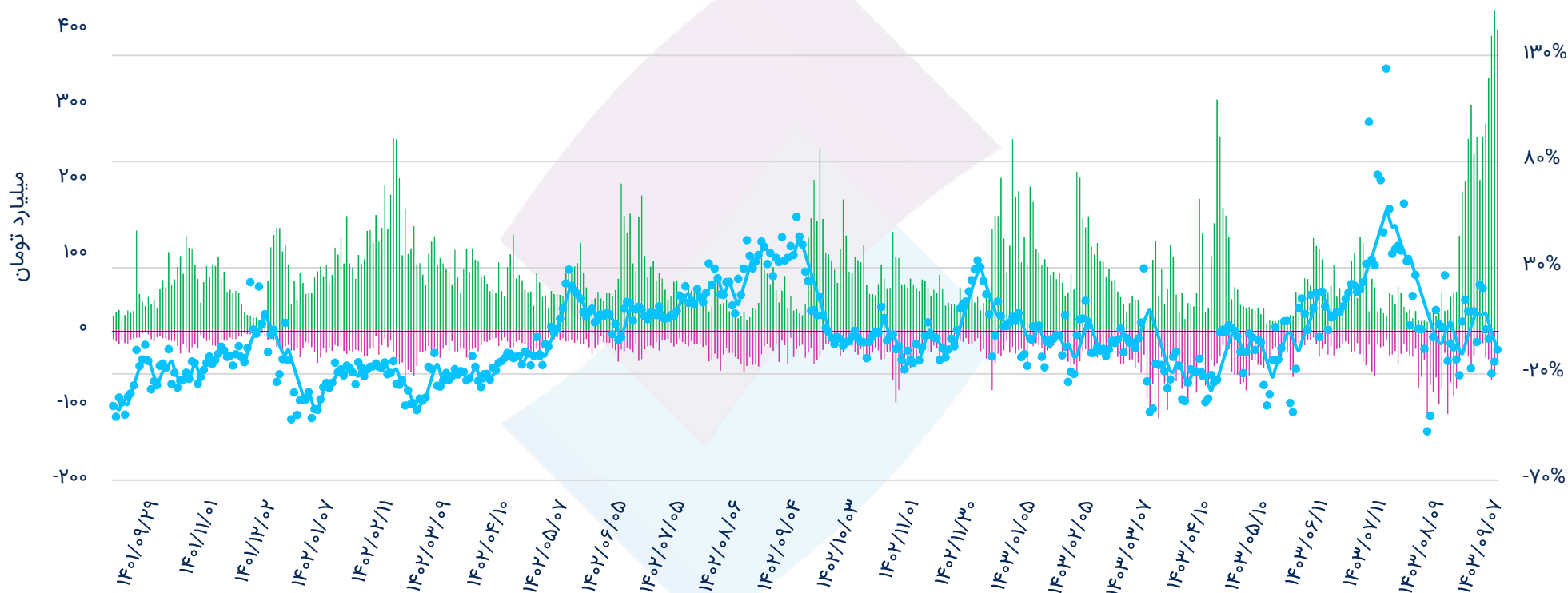
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵۰	۸۹,۰۰۰	آهن و فولاد ارفع، پارس فولاد سبزوار، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صنعت فولاد شادگان، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، مجتمع فولاد اردکان
پلی پروپیلن نساجی	۵۶.۱	۱۱,۸۵۲	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۴	۱,۳۴۸,۰۱۰	بین‌المللی ساروج بوشهر، توسعه گستر هلال خاورمیانه (سیمان مارگون)، ساروج اصفهان، سیمان آبیگ، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان آرتا اردبیل، سیمان اردستان، سیمان ارومیه، سیمان استهبان، سیمان اصفهان، سیمان اکباتان، سیمان ایلام، سیمان باقران، سیمان بجنورد، سیمان بهبهان، سیمان پیوند گلستان، سیمان تهران، سیمان توسعه ماهان کرمان، سیمان جوبین، سیمان خاش
شمش آلومینیوم	۱۸۲.۳	۵,۶۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم مهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۴.۲	۱۴۰,۹۲۲	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، فولاد کویر دامغان
کنسانتره سنگ آهن	۴۰	۲۰۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، بین‌المللی اسم ایران
گندله سنگ آهن	۵.۵	۲۳۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، فولاد سیرجان ایرانیان
لوب کات	۲۳.۸	۵۳,۲۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس کاتد	۵۱۷.۲	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۲۸۰	۲۴,۲۸۵	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد سپهر ایرانیان، فولاد شاهرود، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، فولاد کاوه ارون، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب، فولاد آذربایجان، ذوب آهن آرمان آسیا
وکیوم باتوم	۲۱.۸	۱۶۰,۵۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز
مس مفتول	۵۴۹.۵	۲,۱۵۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، آریا کابل فذک
ورق سرد	۴۰.۲	۳۱,۳۵۰	فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
تختال	۲۵.۳	۷۱,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب، فولاد جهان آرا ارون
خاک روی	۲۲.۳	۶۱,۰۰۰	مجتمع سرب و روی انگوران

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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



ارزش معاملات در زیان

ارزش معاملات در سود

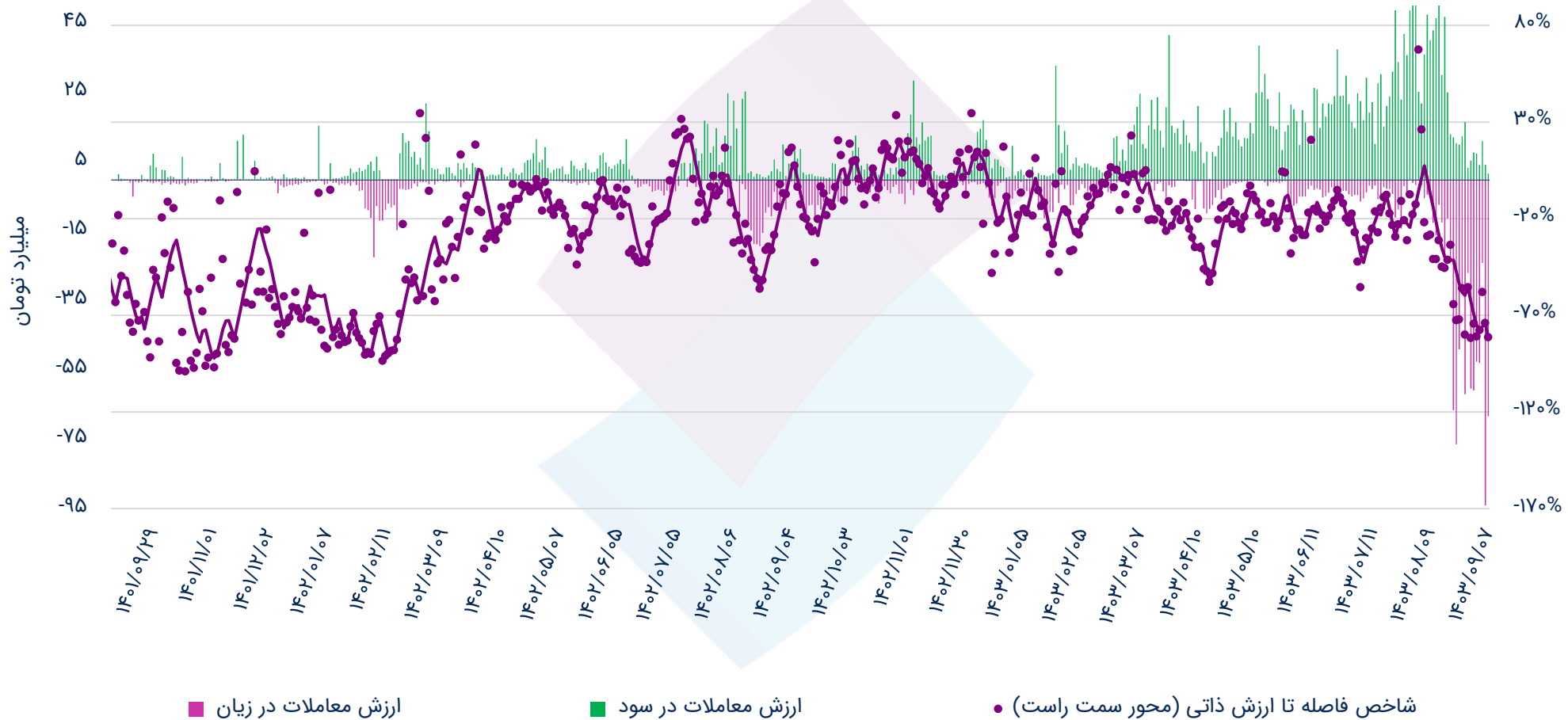
شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (محور سمت راست)

(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

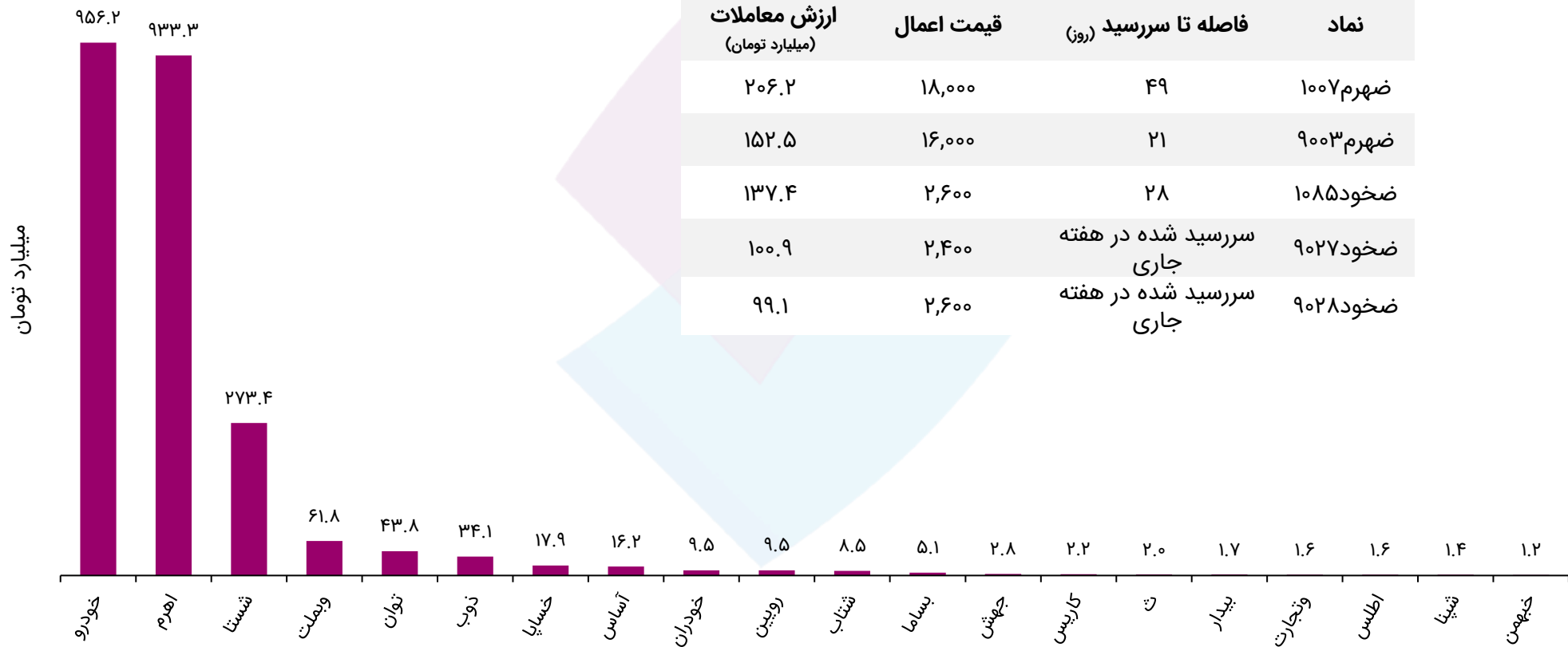


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).
(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

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 ۱۰۰۷	۴۹	۱۸,۰۰۰	۲۰۶.۲
ضهرم ۹۰۰۳	۲۱	۱۶,۰۰۰	۱۵۲.۵
ضخود ۱۰۸۵	۲۸	۲,۶۰۰	۱۳۷.۴
ضخود ۹۰۲۷	سررسید شده در هفته جاری	۲,۴۰۰	۱۰۰.۹
ضخود ۹۰۲۸	سررسید شده در هفته جاری	۲,۶۰۰	۹۹.۱



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)