

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 ۱۴ آذر - شماره ۱۷۹

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



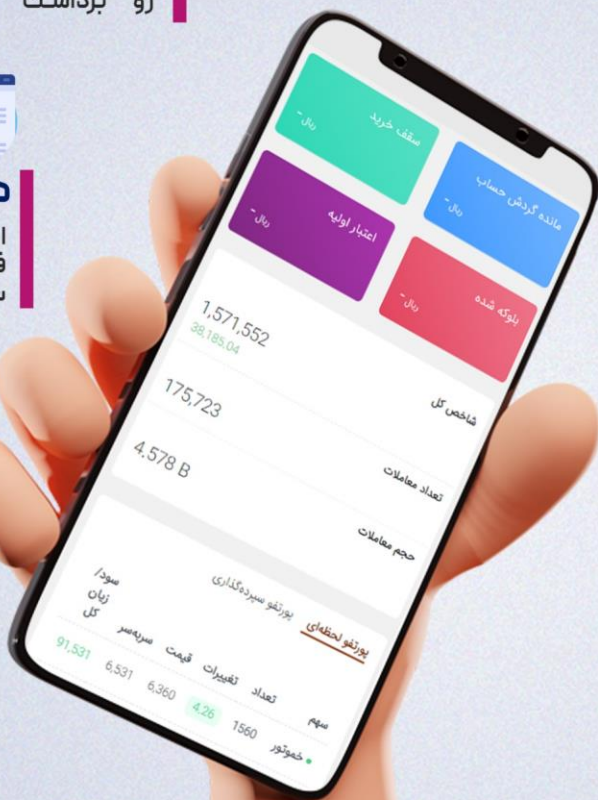
برداشت وجه آتی

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

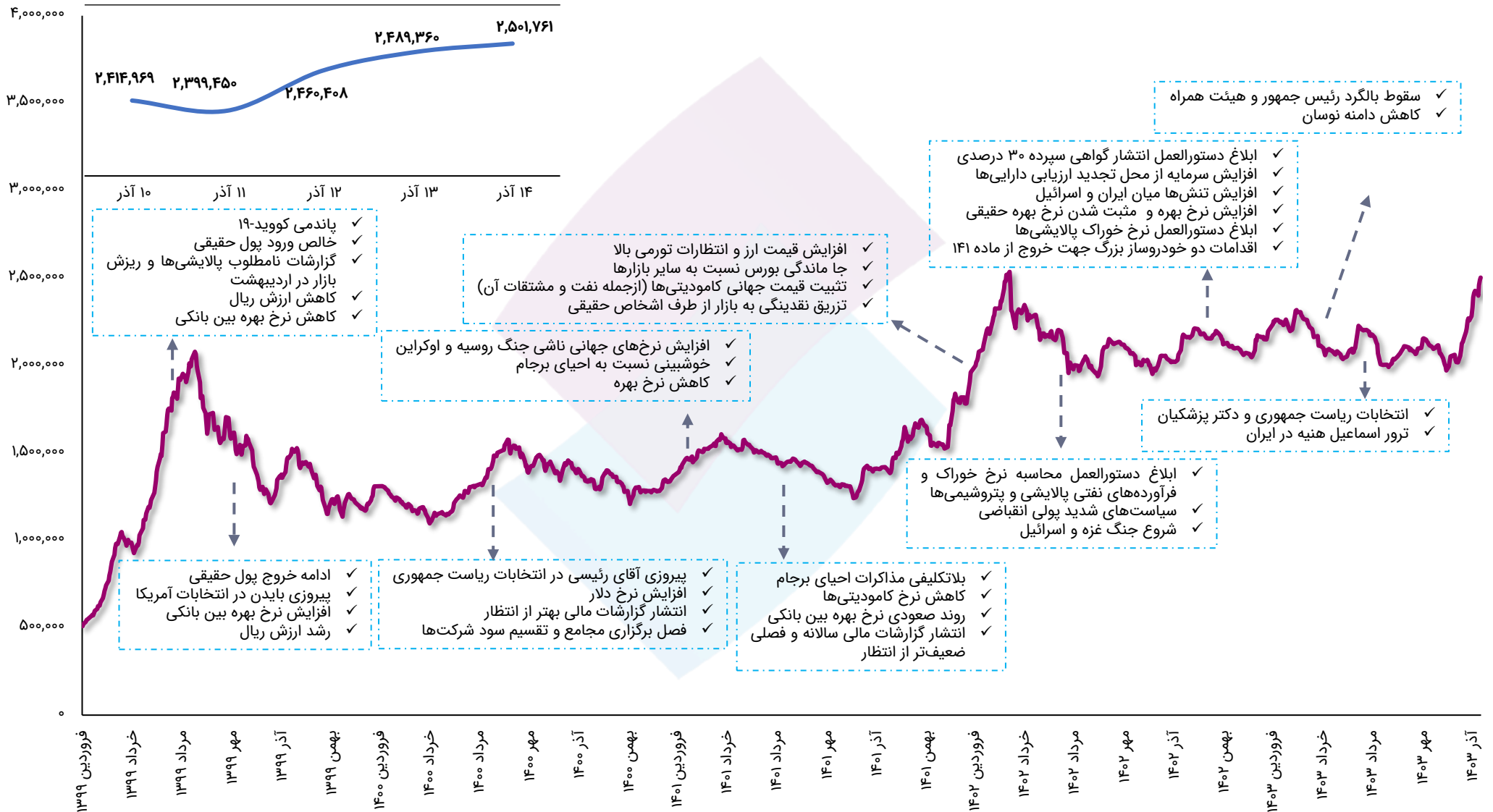
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



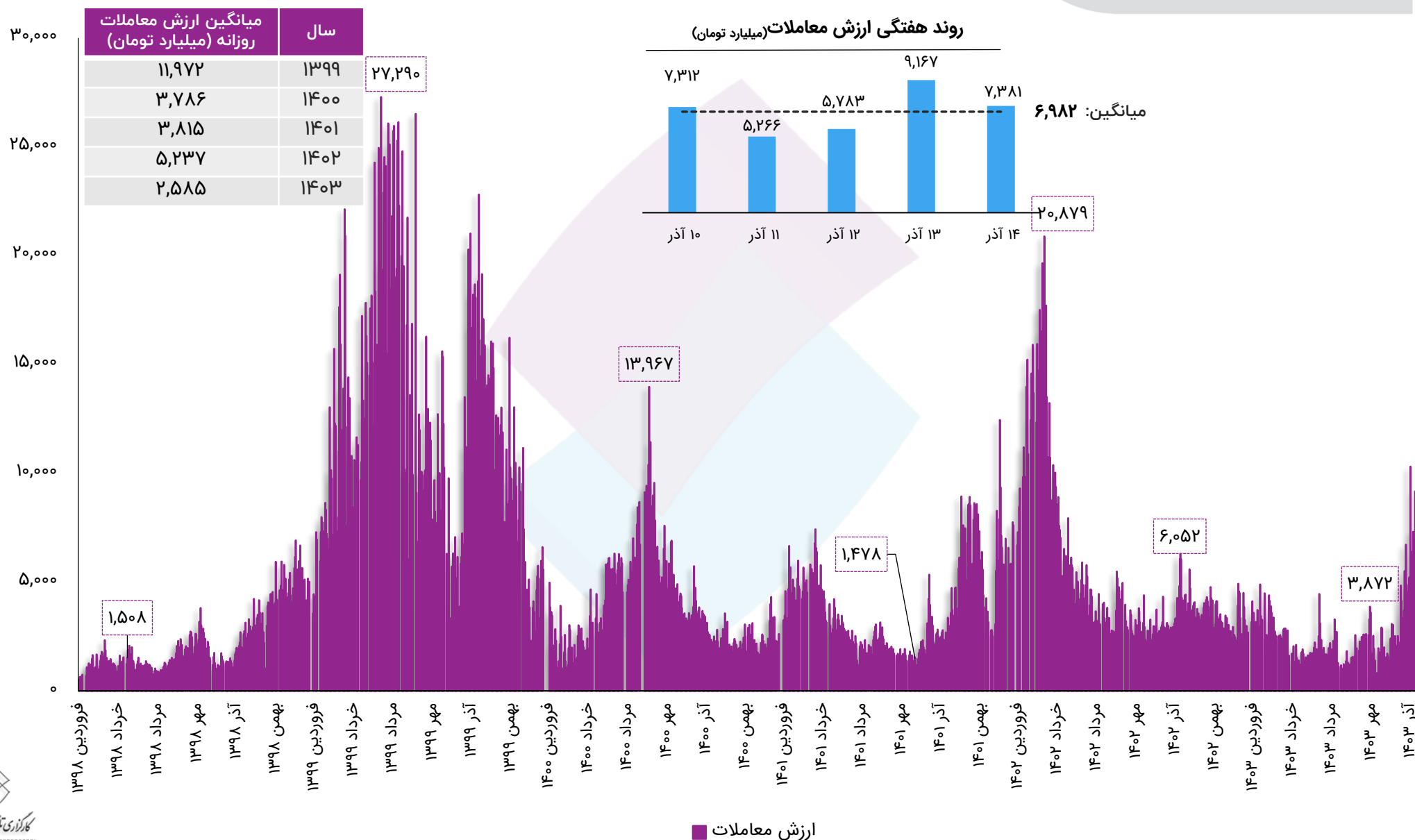
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

رشد ۳.۱ درصدی شاخص کل در هفته جاری

رشد هفتگی شاخص کل

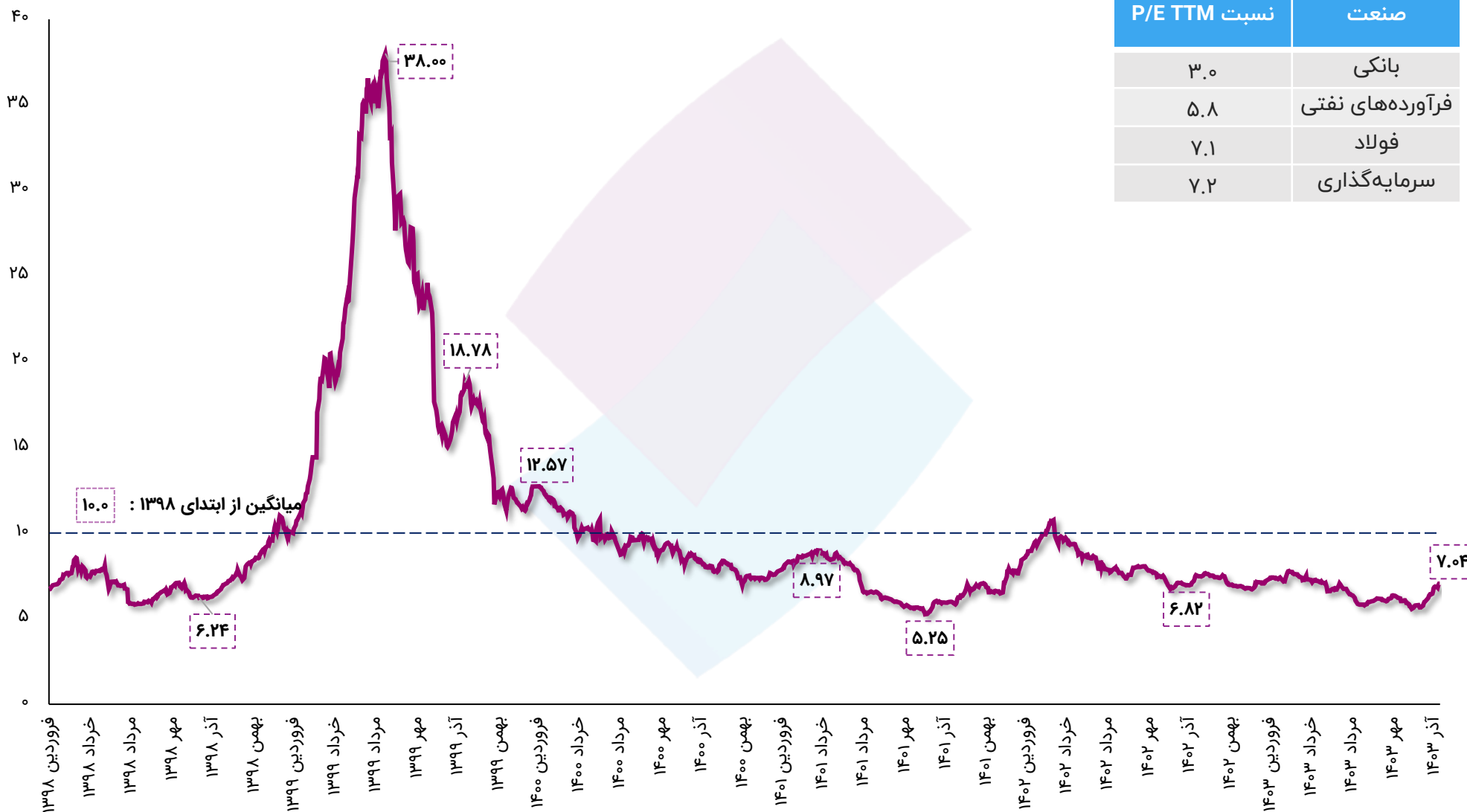


ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران

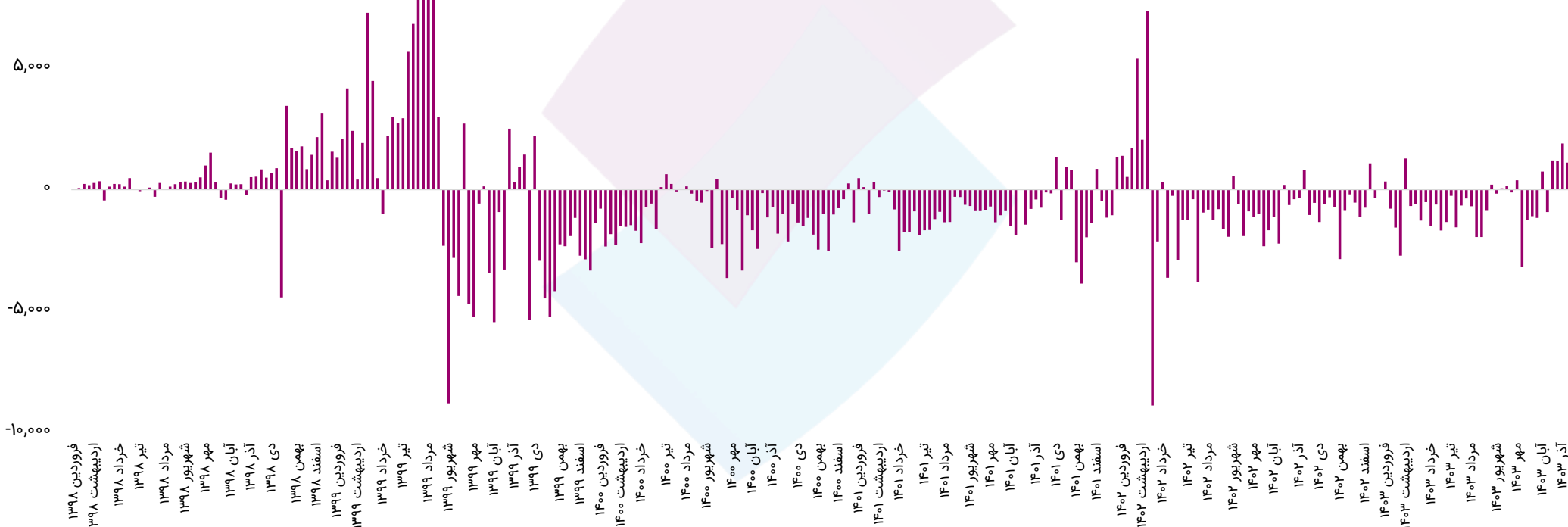
نسبت P/E TTM	صنعت
۳.۰	بانکی
۵.۸	فرآورده‌های نفتی
۷.۱	فولاد
۷.۲	سرمایه‌گذاری



۱،۱۰۶ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با ورود ۱،۸۸۷ میلیارد تومان هفتگی گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)

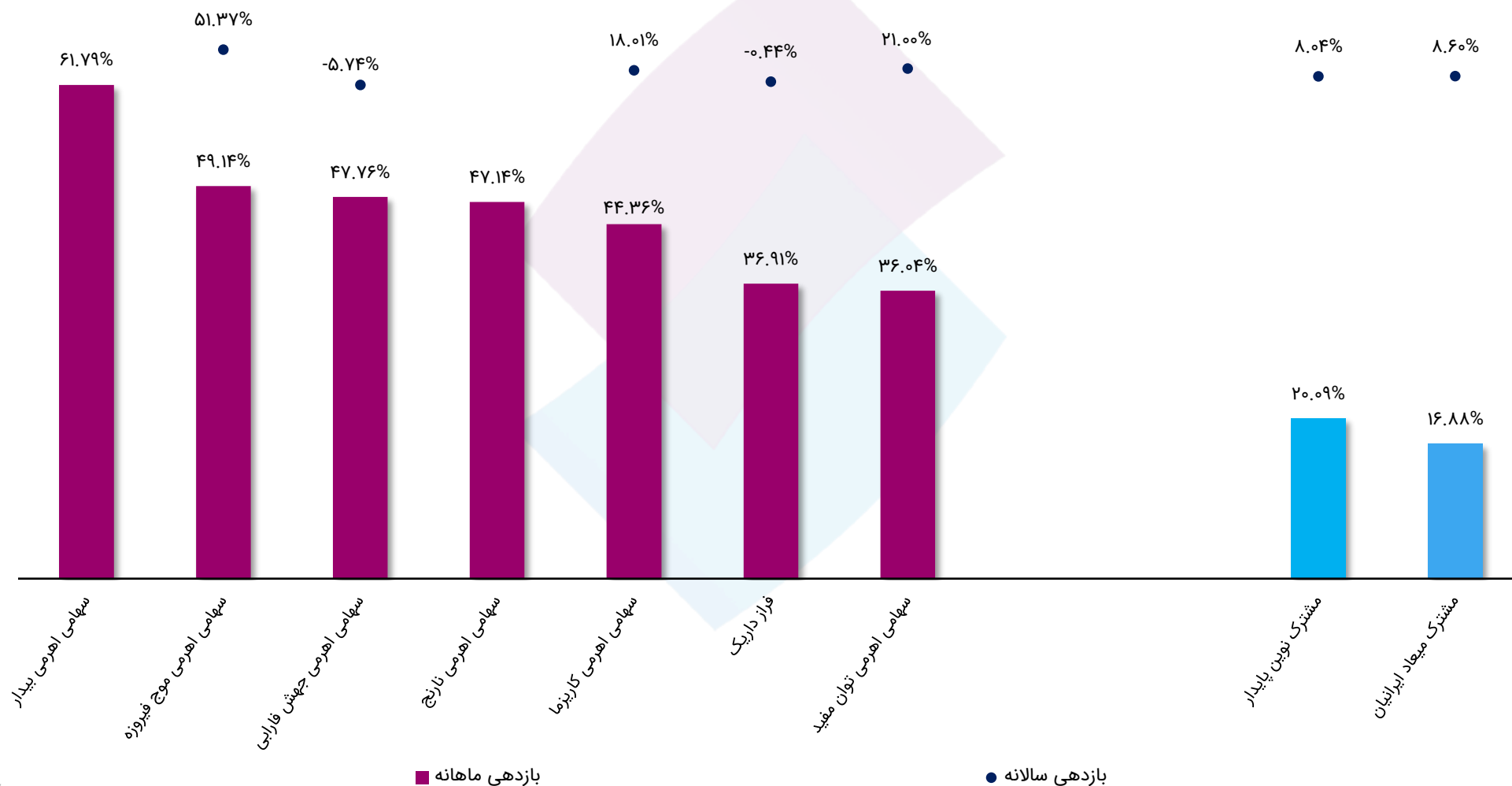
خالص ورود حقیقی (همت)	سال
۲۱.۷	۱۳۹۹
(۵۸.۹)	۱۴۰۰
(۴۲.۸)	۱۴۰۱
(۳۶.۳)	۱۴۰۲
(۲۱.۱)	۱۴۰۳



خالص ورود و خروج هفتگی

صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

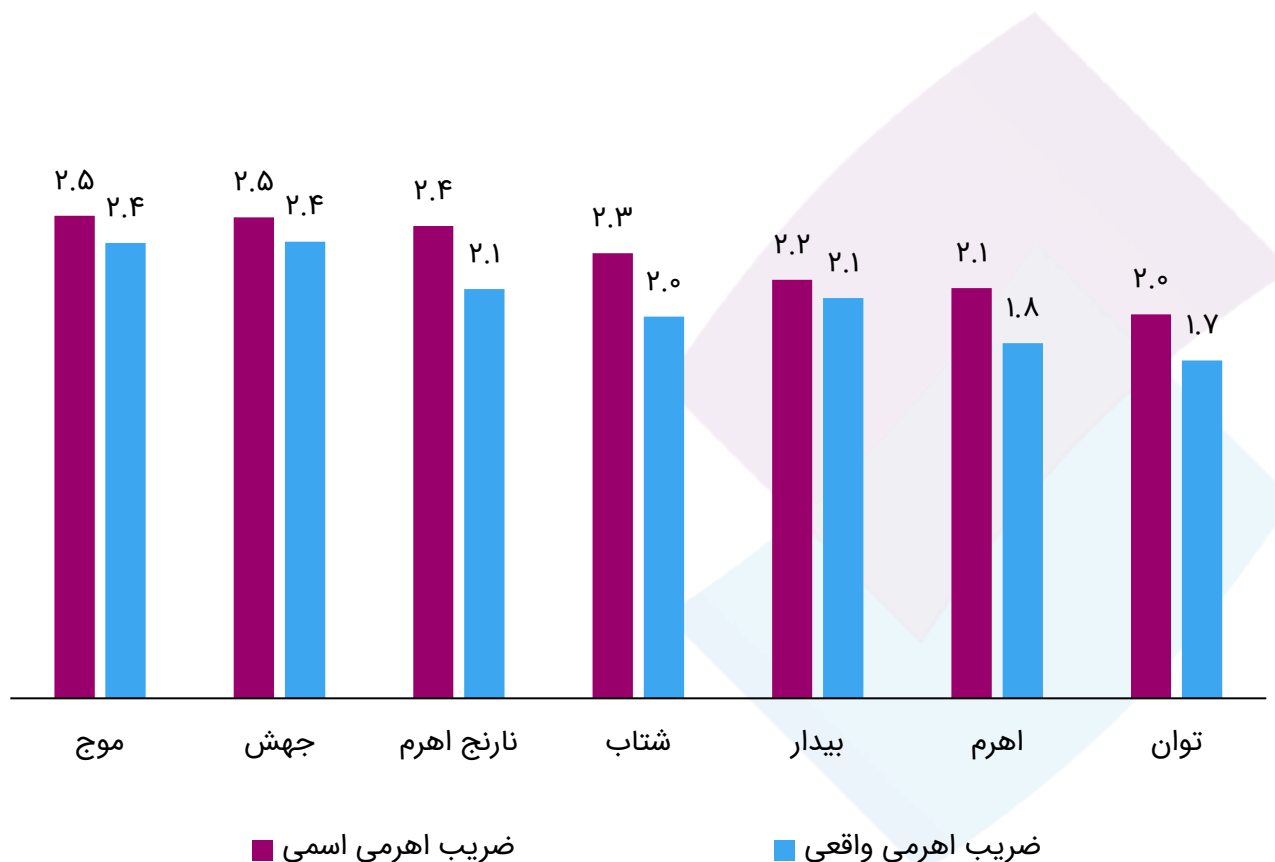
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بازدهی ماهانه

بازدهی سالانه

صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
شتاب	-۴.۶%	۲.۱
نارنج اهرم	-۳.۹%	۲.۲
جهش	-۳.۷%	۲.۴
توان	-۳.۱%	۲.۰
بیدار	-۲.۴%	۲.۲
اهرم	-۲.۲%	۲.۱
موج	-۱.۳%	۲.۴

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
بیدار	۶۹.۲%	۲.۵۵%
موج	۵۵.۴%	۲.۵۴%
جهش	۵۳.۱%	۲.۵۴%
نارنج اهرم	۴۹.۸%	۲.۵۵%
اهرم	۴۸.۷%	۲.۵۵%
توان	۴۰.۴%	۲.۲۵%
شتاب	۳۶.۰%	۲.۳۹%

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

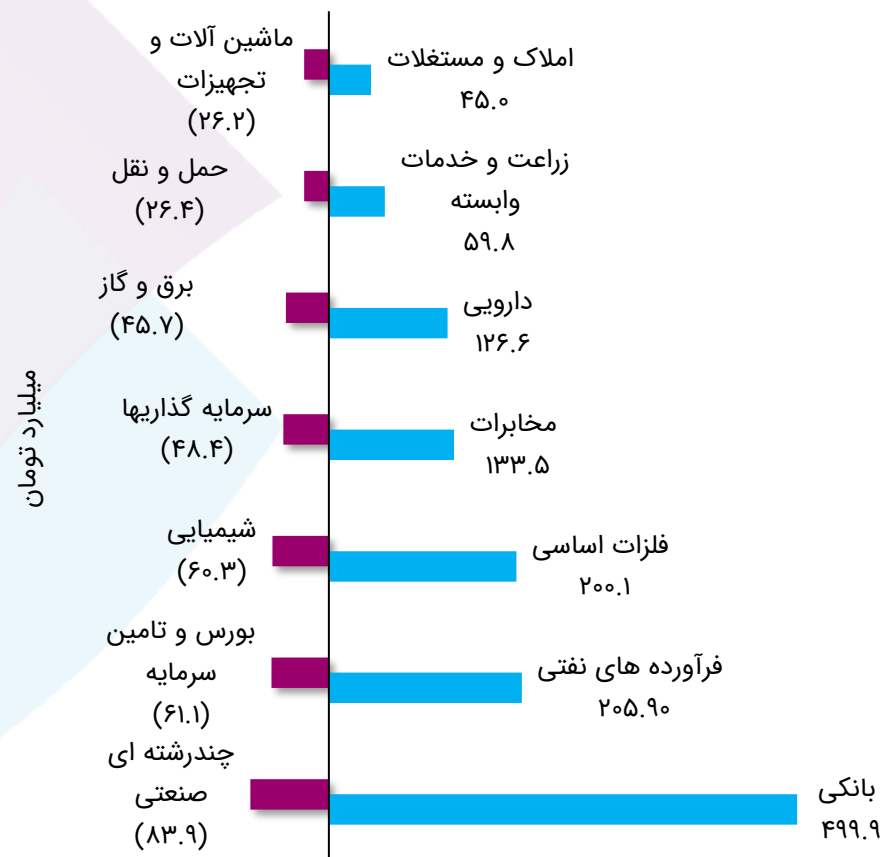
ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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

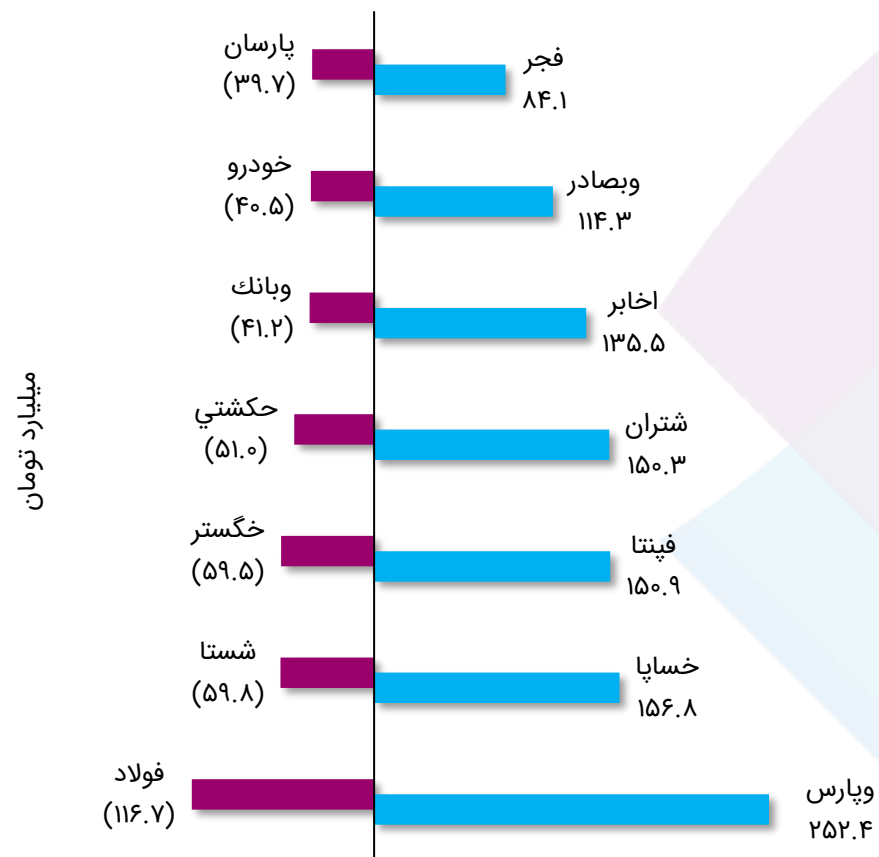
در محاسبه ضریب بتا از بازده قیمت پایانی و شاخص هموزن طی ۲۴۵ روز گذشته استفاده شده است.

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

صنعت

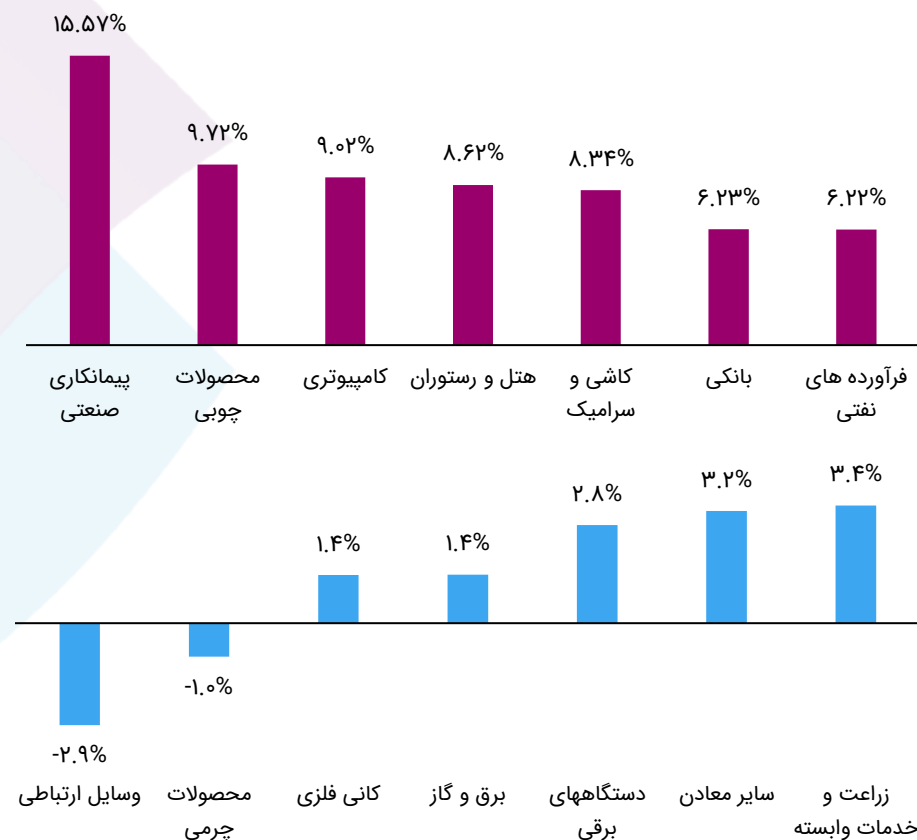
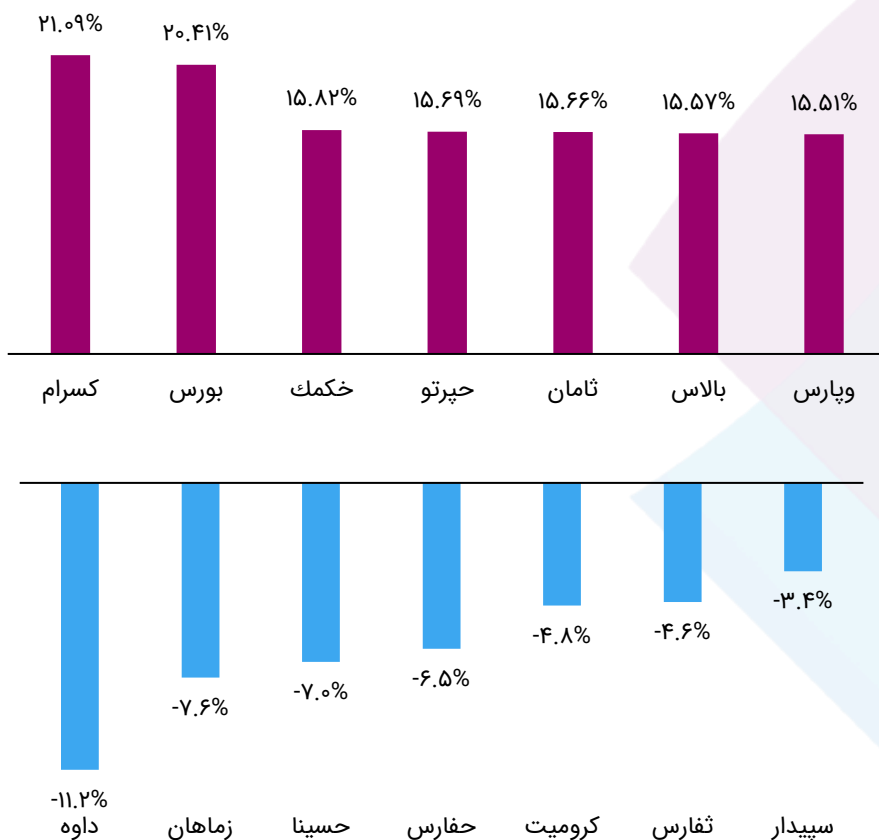


نماد



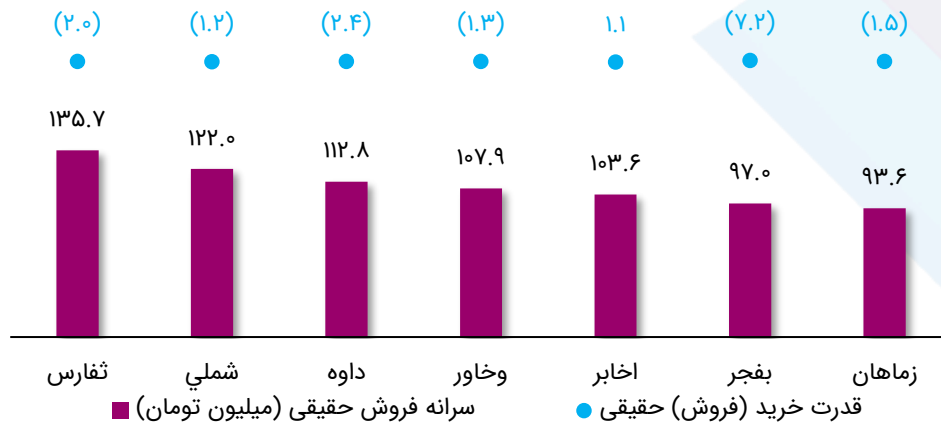
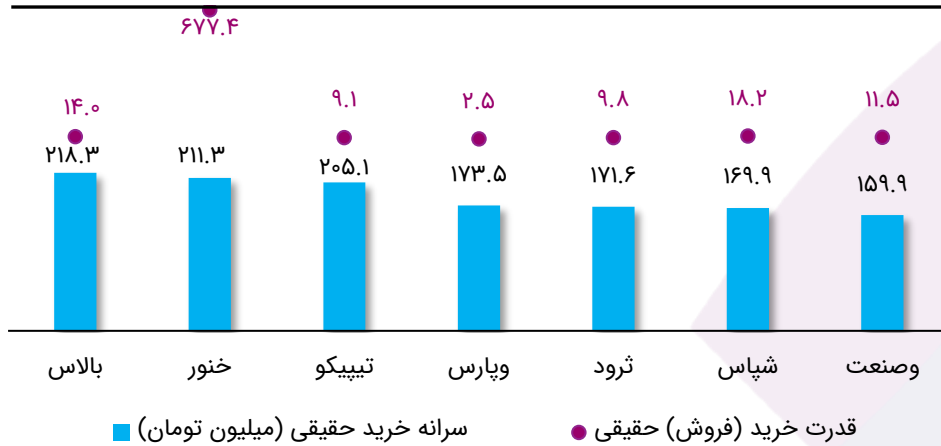
نماد

صنعت

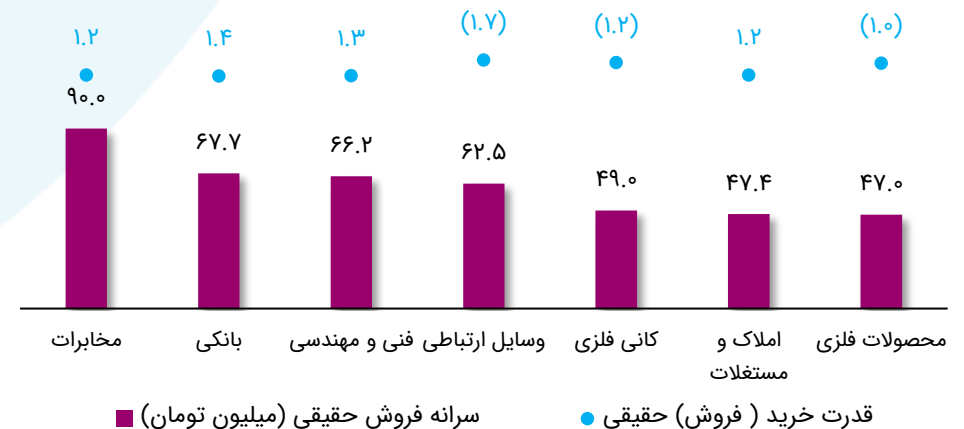
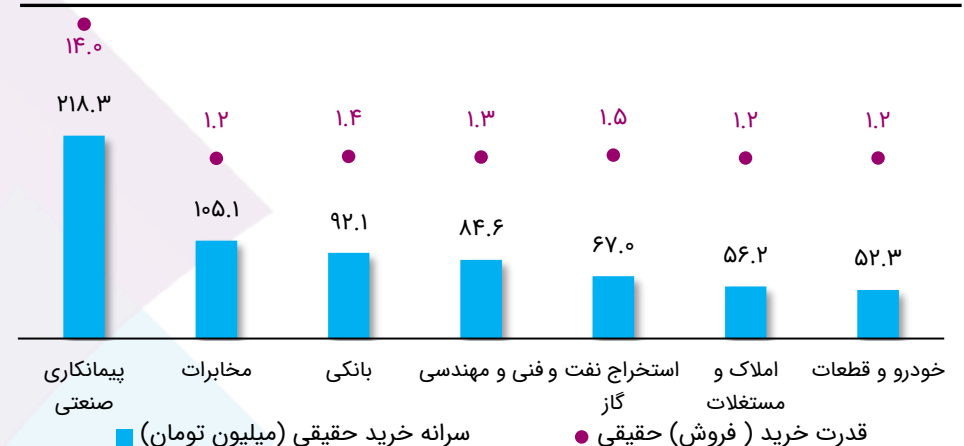


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



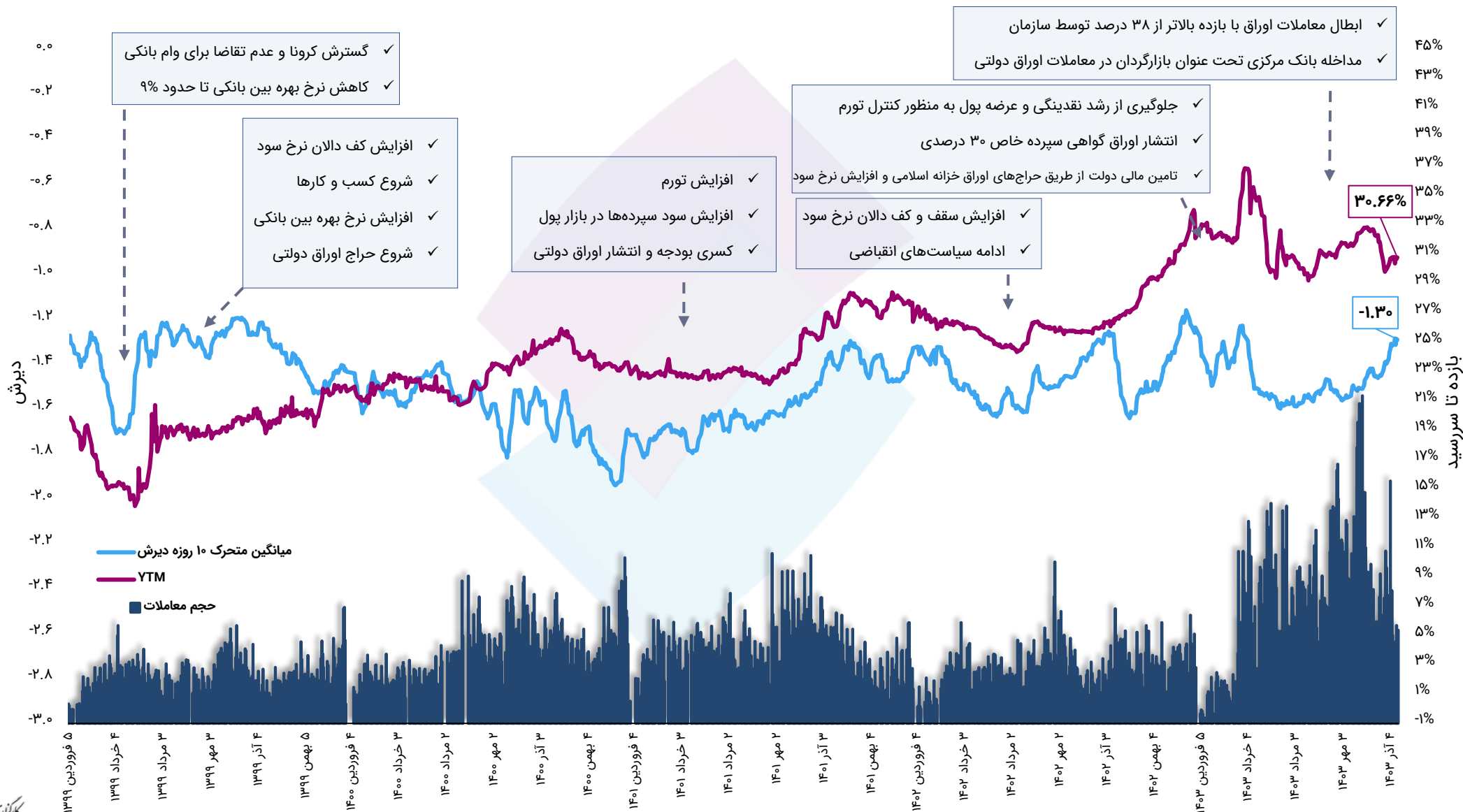
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات محل افزایش سرمایه (درصد)	موضوع افزایش سرمایه
پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه				
فاما	۵۵۰	۸۷۰	۵۸%	اصلاح ساختار مالی و استفاده از معافیت مالیاتی
سفارس	۵۶۳	۲,۰۰۰	۲۵۶%	اصلاح ساختار مالی، جبران مخارج سرمایه ای انجام شده، تحصیل سهام و مشارکت در طرح های توسعه ای و افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر
خفولا	۲۹	۱,۹۰۳	۶۴۶۳%	اصلاح ساختار مالی
غسالم	۴۴۸	۶۰۰	۳۴%	جلوگیری از خروج نقدینگی و اصلاح ساختار و اجرای دستور العمل جدید پذیرش اوراق بهادار در بازار بورس و اوراق بهادار تهران در خصوص سرمایه ثبتی ناشران
لسرما	۲۲	۱۴۲	۵۵۰%	اصلاح ساختار مالی
صدور مجوز افزایش سرمایه				
شبصیر	۴۵۰	۶۵۰	۴۴%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی
ولغدر	۱۵۰	۲۴۰	۶۰%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی و استفاده از مزایای معافیت مالیاتی
آریان	۵,۹۰۰	۱۱,۸۰۰	۱۰۰%	مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر و بازپرداخت تسهیلات دریافتی
دفرا	۱۴۰	۲۸۰	۱۰۰%	اصلاح ساختار مالی
کیمیای	۶۰۰	۱,۰۰۰	۶۷%	اصلاح ساختار مالی و تامین سرمایه در گردش
سامان	۸,۰۰۰	۱۱,۰۰۰	۳۸%	اصلاح ساختار مالی

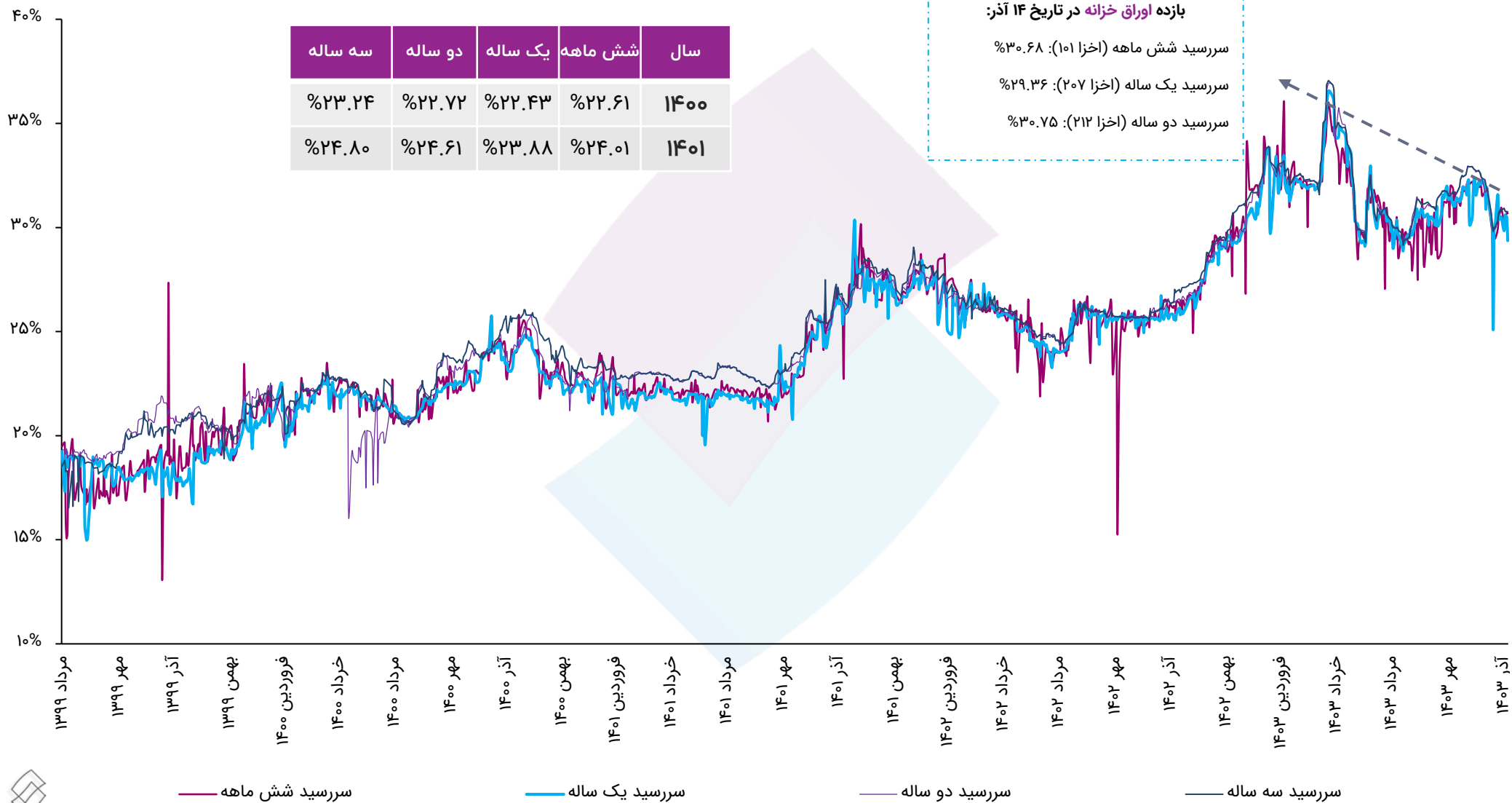
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه					
بورس	۱,۸۲۰	۲,۴۰۰	۳۲%	سود انباشته (۷۴%) اندوخته (۲۶%)	تعیین حداقل سرمایه مطلوب بورس‌ها" و تقویت ساختار مالی شرکت
خکار	۵۰۰	۸۰۰	۶۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
ثیردیس	۲۰۰	۳۵۰	۷۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
ولپارس	۲۰۰	۲۸۰	۴۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و تقویت سطح اعتباری
مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام					
شفام	۱۰۰	۵۰۰	۴۰۰%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد مهلت استفاده از حق تقدم سهام از تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۱۴ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۱۳ است.
حکهر	۱,۰۵۴	۱,۵۶۶	۴۹%	آورده نقدی	خرید ۲۰۰ دستگاه واگن مهلت استفاده از حق تقدم سهام از تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۱۴ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۱۳ است.
اعلامیه پذیره نویسی عمومی					
خبازرس	۱۵	۳۰	۱۰۰%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج وجه نقد و حفظ و تقویت سرمایه در گردش مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۱۲ تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۲۶ است.
وپست	۱,۶۳۹	۳,۶۰۰	۱۲۰%	آورده نقدی	بهبود نسبت کفایت سرمایه و افزایش قدرت اعطای تسهیلات مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۱۳ تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۲۷ است.
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
شگستر	۵۰۰	۲,۰۹۸	۳۲۰%	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)»

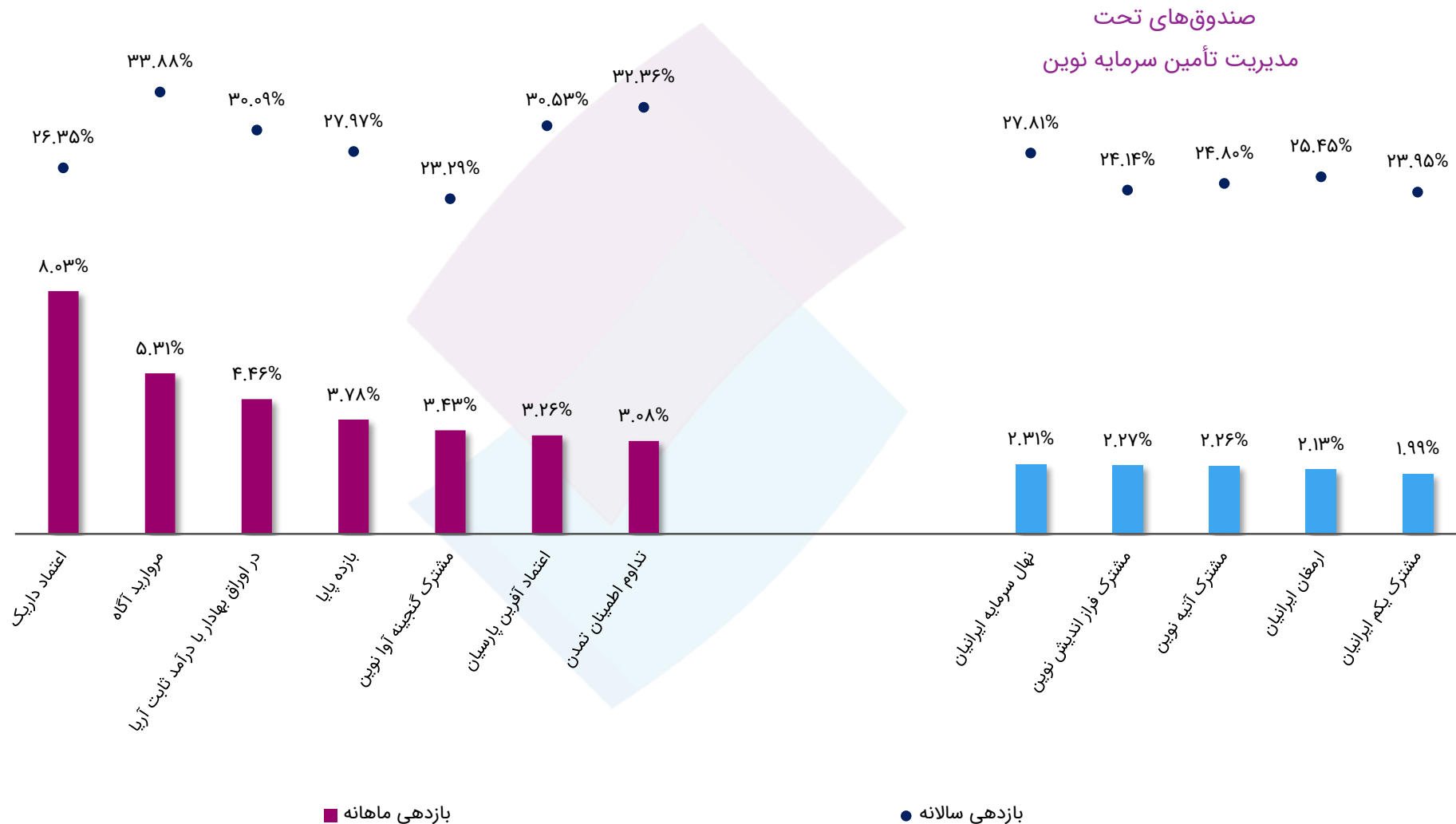
ثبات نرخ بهره بدون ریسک در سطح ۳۰.۶۶ درصد



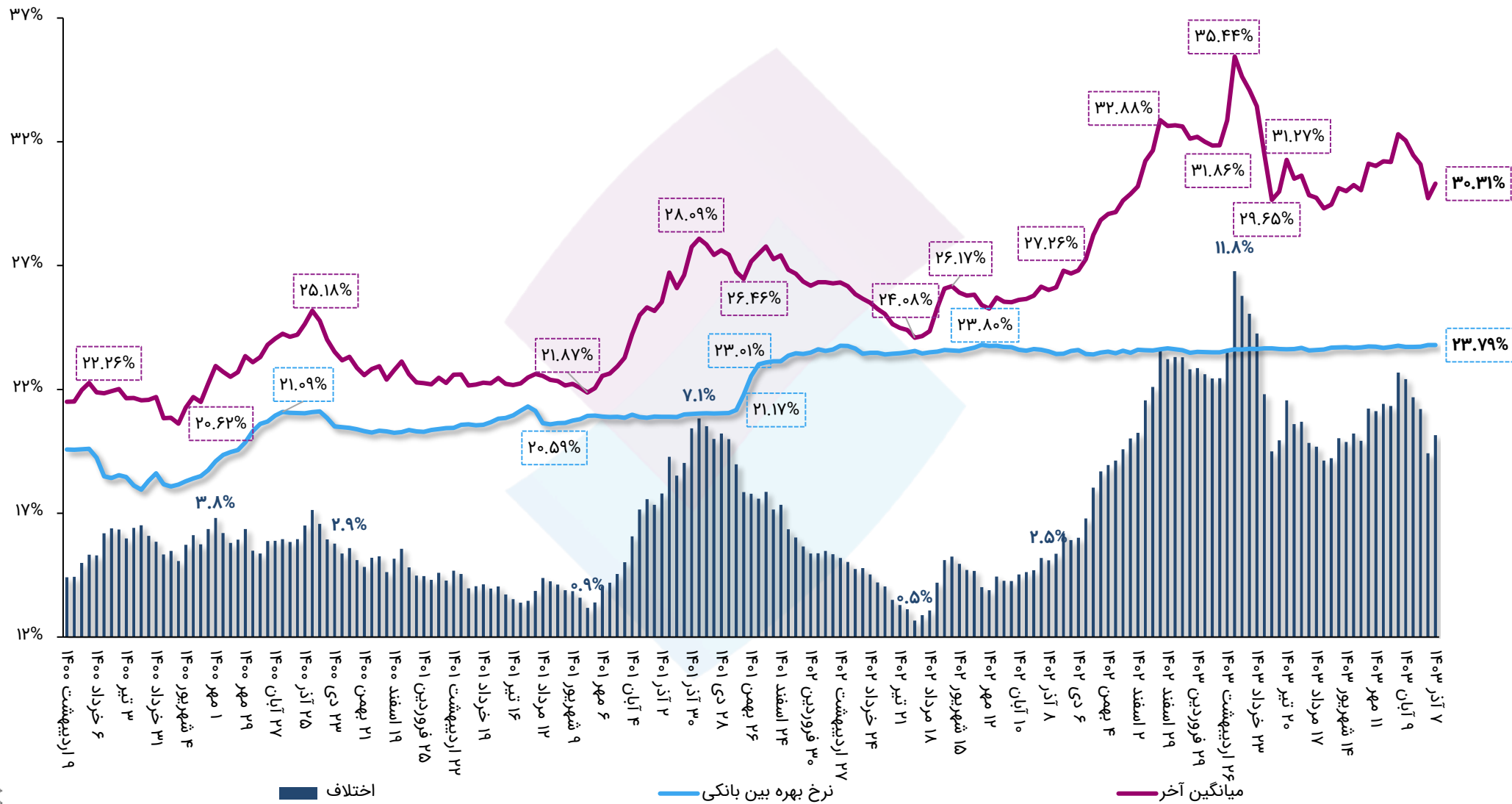
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

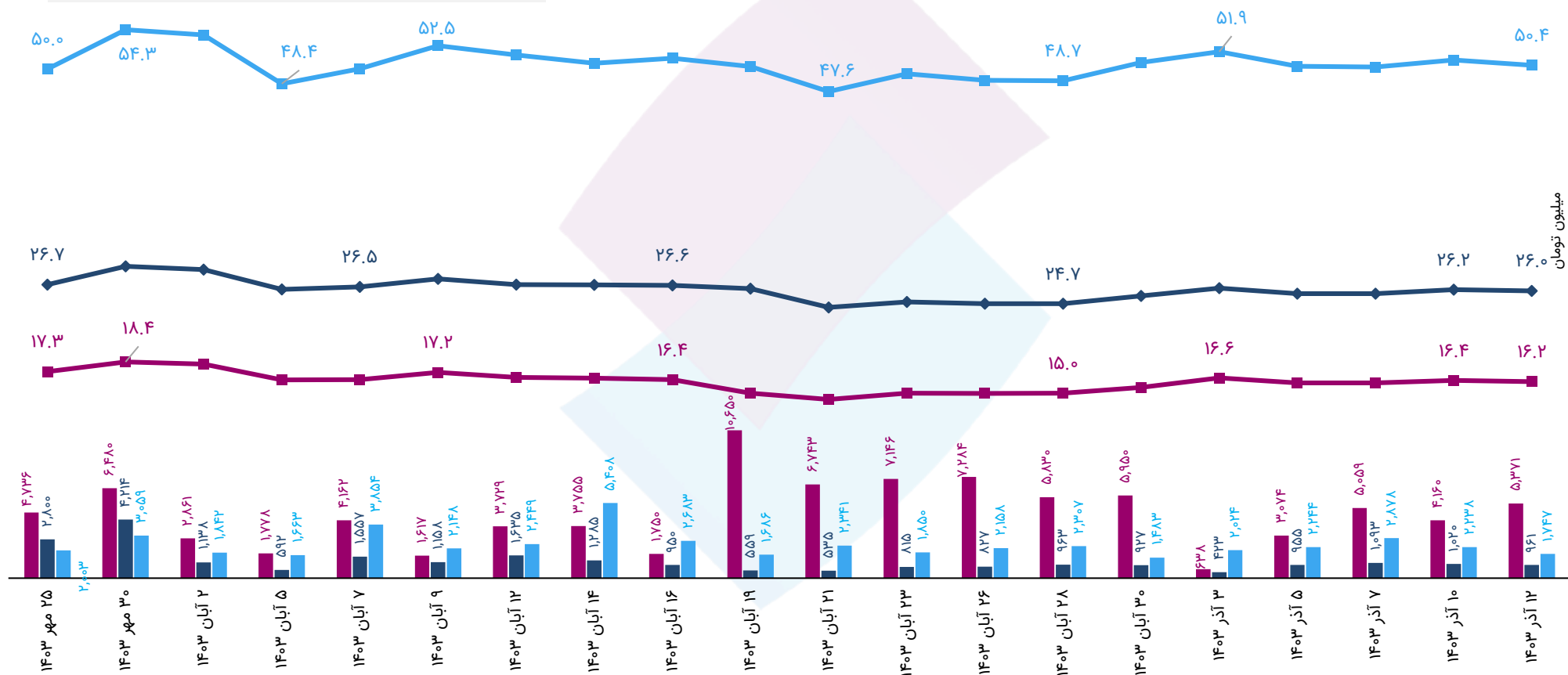


ثبات نرخ بهره بین بانکی در رقم ۲۳.۷۹ درصد و سی امین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی به مبلغ ۴.۳۴ همت



معامله ۵۳۰ هزار قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۵۳,۷۹۳	
دلار سکه تمام	۸۱,۱۰۰	
دلار نیم سکه	۸۳,۶۰۰	
دلار ربع سکه	۱۰۴,۳۰۰	



معامله ۱۲ هزار و ۷۲۴ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ

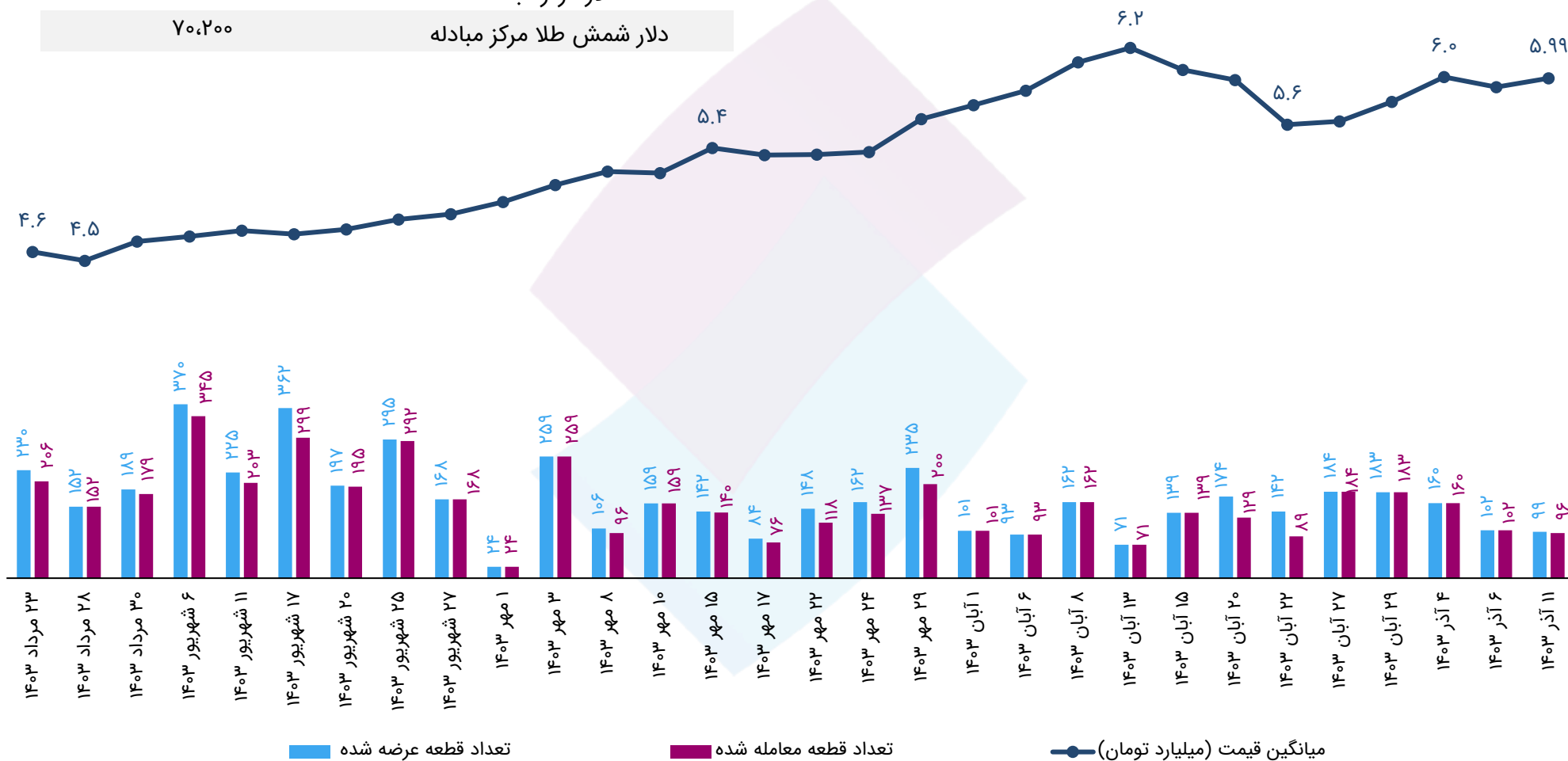
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

۵۳،۴۸۷

دلار مرکز مبادله

دلار شمش طلا مرکز مبادله

۷۰،۲۰۰



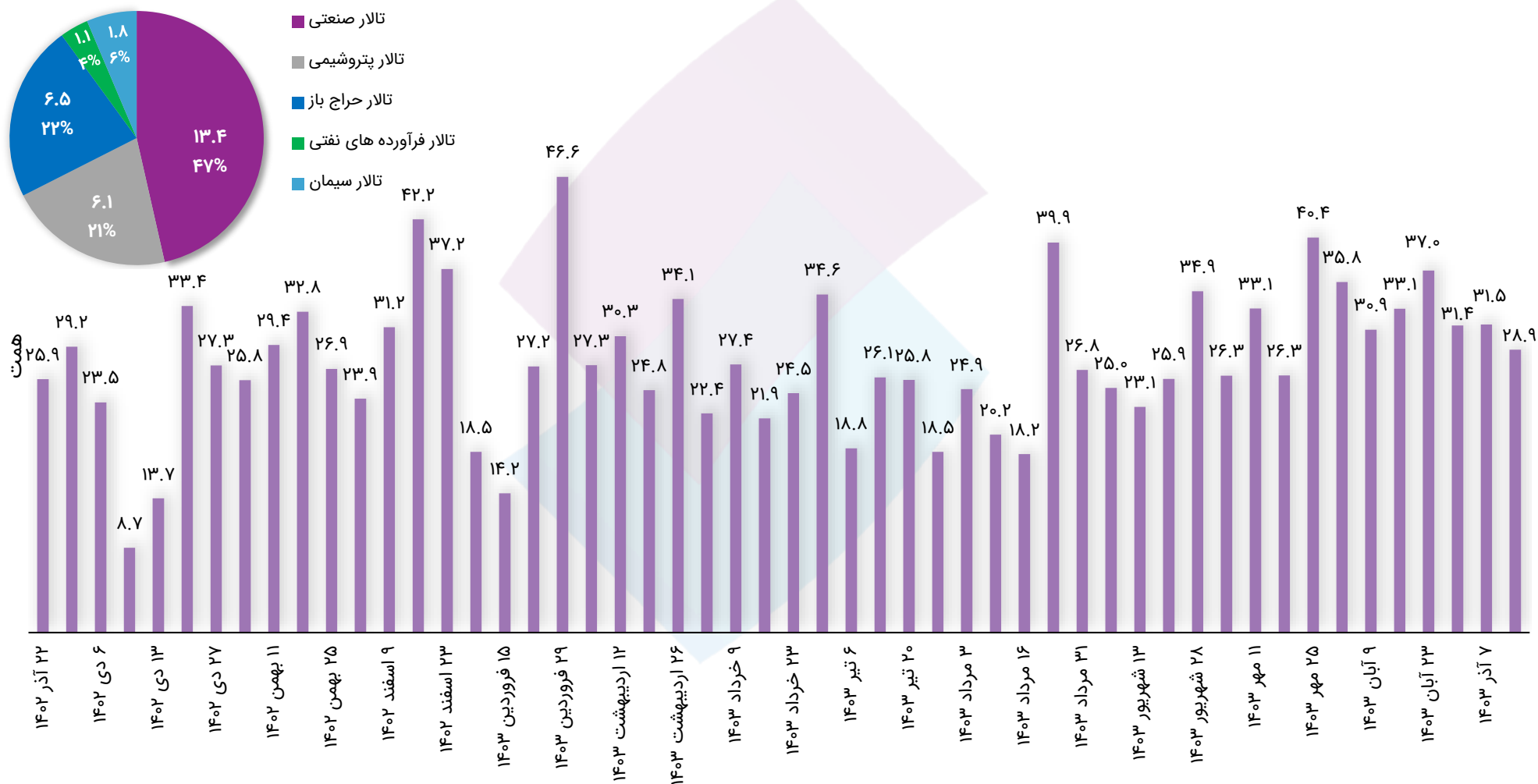
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

کاهش ۴.۷ درصدی قیمت گاز طبیعی تحت تاثیر پیش‌بینی‌های آب و هوا

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۰.۷%	۲,۰۱۹	-۳.۶%	۲,۷۳۷	۰.۱%	۲,۶۳۸	۲,۶۴۰	طلا (دلار/انس)
۷۸.۴%	۲۹۲,۱۳۰	-۰.۶%	۵۲۴,۲۵۰	۱.۳%	۵۱۴,۲۰۰	۵۲۱,۰۵۰	سکه (هزار ریال)
۲۸.۶%	۴۲۲,۵۷۷	۷.۱%	۵۰۷,۳۷۹	۲.۱%	۵۳۲,۰۴۷	۵۴۳,۲۹۰	دلار اسکناس (ریال)
۳۷.۶%	۳۸۴,۱۶۱	۷.۱%	۴۹۳,۵۵۹	۲.۱%	۵۱۷,۵۵۵	۵۲۸,۴۹۲	دلار حواله (ریال)
-۳.۸%	۷۷	-۱.۵%	۷۵	۱.۵%	۷۳	۷۴	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۱۹.۵%	۴۴,۰۸۱	۴۲.۷%	۶۷,۸۱۲	۰.۸%	۹۵,۹۶۳	۹۶,۷۶۸	بیت‌کوین (دلار)
۸.۳%	۸,۲۵۸	-۵.۹%	۹,۵۰۴	۰.۵%	۸,۸۹۷	۸,۹۴۱	مس LME (دلار/تن)
۲۷.۲%	۲,۴۲۰	۱.۷%	۳,۰۲۸	-۰.۹%	۳,۱۰۷	۳,۰۷۹	روی LME (دلار/تن)
-۱۱.۳%	۴۹۶	-۸.۱%	۴۷۹	-۳.۸%	۴۵۸	۴۴۰	بیلت CIS (دلار/تن)
-۳.۵%	۴۶۶	-۳.۵%	۴۶۶	۲.۲%	۴۴۰	۴۵۰	بیلت ایران (دلار/تن)
۲.۴%	۲۸۶	۱.۰%	۲۹۰	-۱.۷%	۲۹۸	۲۹۳	متانول CFR (\$/mt)
۳.۷%	۳۱۷	-۵.۶%	۳۴۸	-۰.۷%	۳۳۱	۳۲۹	سبب اوره (mt/\$)
۱۲.۱%	۲.۷۲	۱۲۵.۹%	۱.۳۵	-۴.۷%	۳.۲	۳.۰۵	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

رشد ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



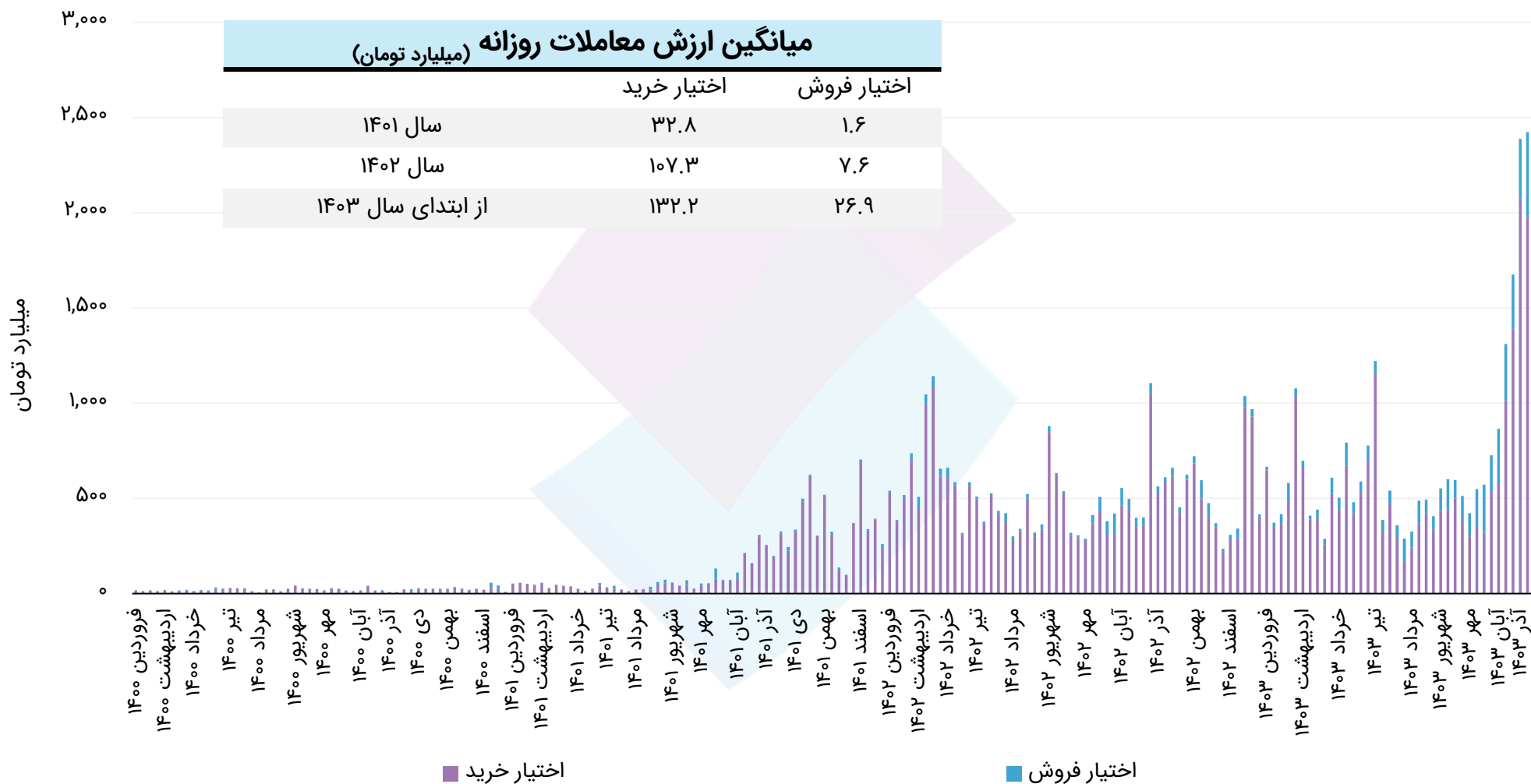
ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

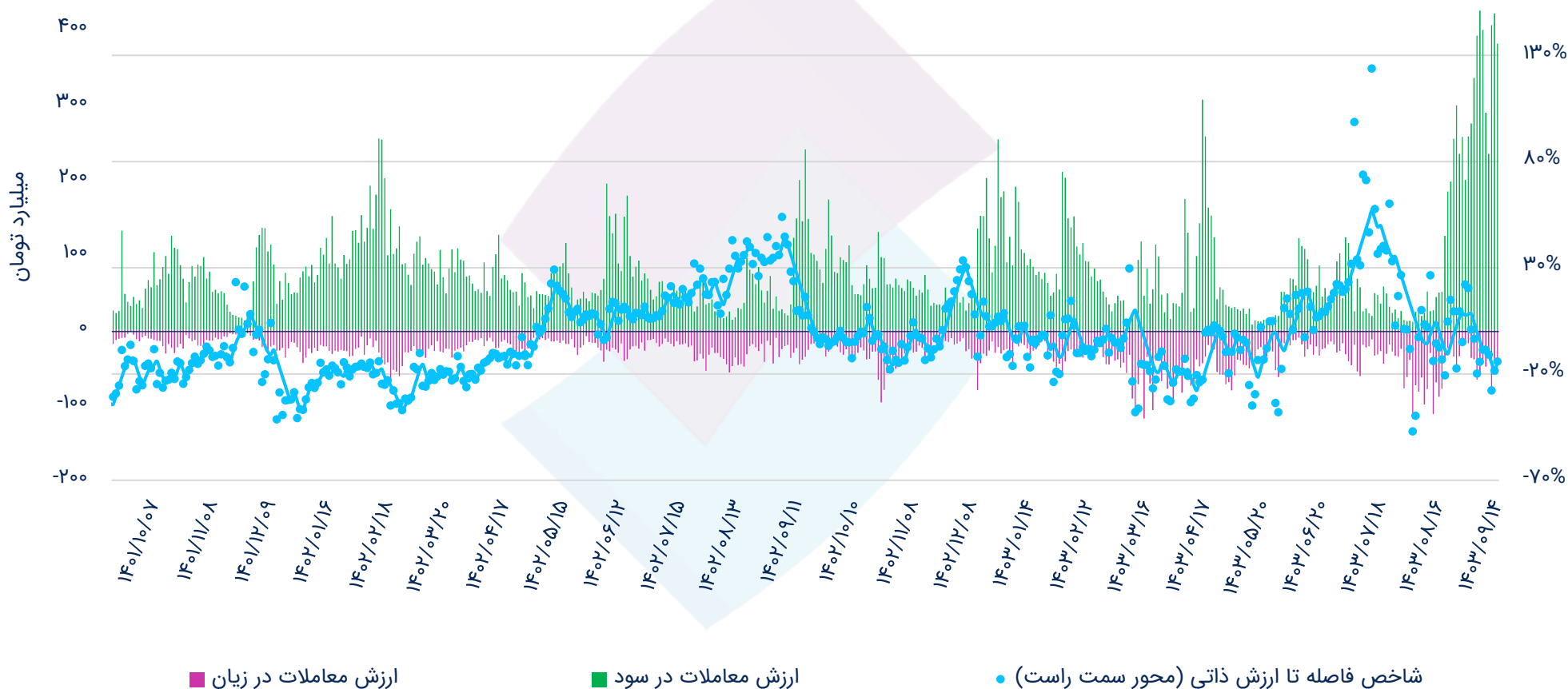
شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۱	۸۲,۰۰۰	آهن و فولاد ارفع، پارس فولاد سبزواری، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صنعت فولاد شادگان، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت
پلی اتیلن سبک خطی	۵۲.۴	۱۲,۳۴۸	پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی جم، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مهاباد
پلی پروپیلن نساجی	۵۷.۵	۱۳,۳۵۱	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۴	۱,۳۲۷,۵۰۲	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
شمش آلومینیوم	۱۸۶.۸	۵,۰۵۰	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۴.۱	۱۲۹,۵۱۰	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، شرکت معدنی و صنعتی چادرمو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، مجتمع فولاد خراسان، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان
کنسانتره سنگ آهن	۴.۰	۱۹۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرمو، بین‌المللی اسم ایران، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
گندله سنگ آهن	۵.۵	۲۴۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرمو، معدنی و صنعتی گل گهر، صنعتی و معدنی اپال پارسیان سنگان، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
لوب کات	۲۳.۷	۳۳,۵۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس کاتد	۵۲۴.۷	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۲۸.۰	۴۰,۵۰۲	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد البرز ایرانیان، فولاد سپهر ایرانیان، فولاد شاهرود، مجتمع فولاد خراسان، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، فولاد کاوه ارون، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب
وکیوم باتوم	۲۰.۷	۵۷,۰۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس مفتول	۵۶۳.۵	۱,۸۶۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، آریا کابل فدک، صنایع مس مفتولی ابهر
ورق سرد	۴۰.۳	۴۵,۱۵۰	فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
تختال	۲۴.۷	۷۵,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد مبارکه اصفهان، فولاد هرمزگان جنوب



روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

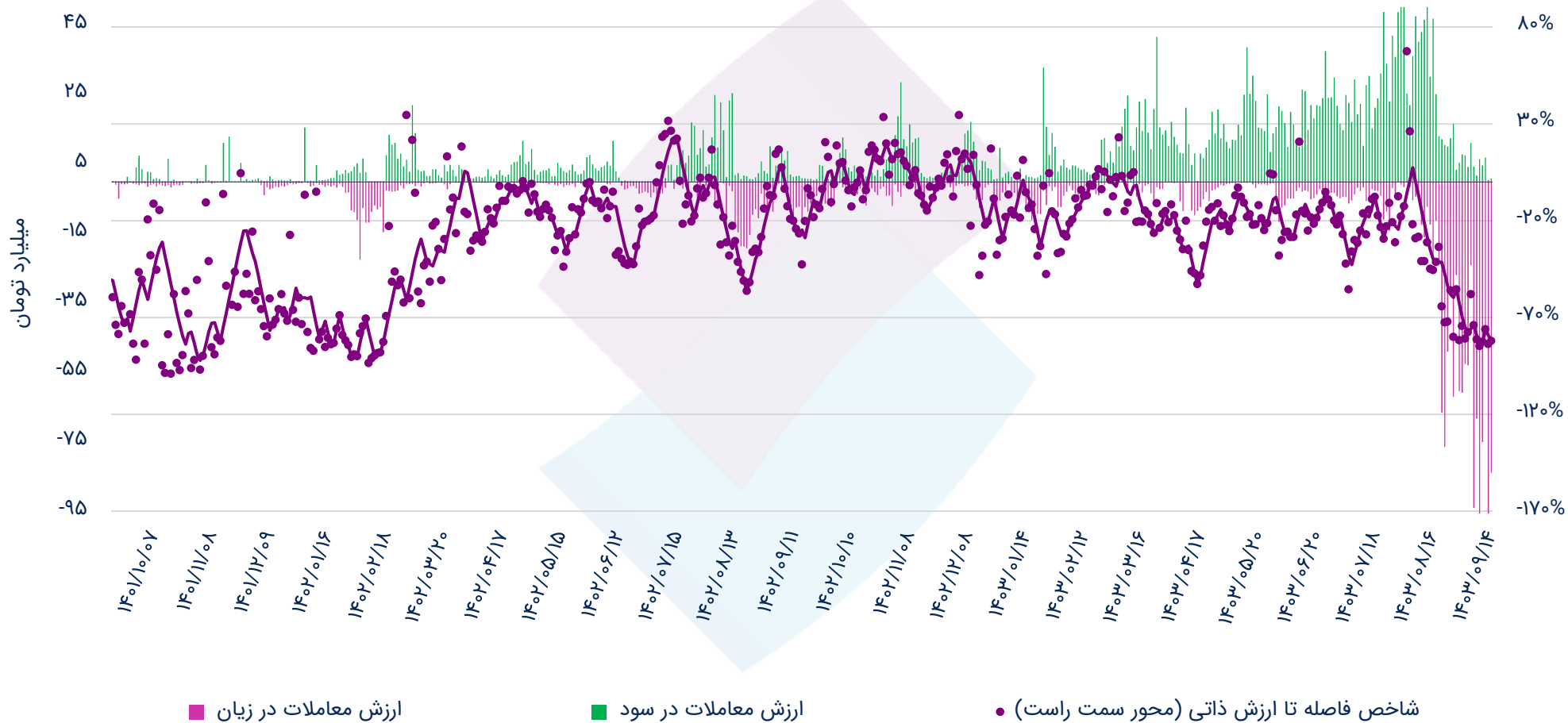


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

(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).

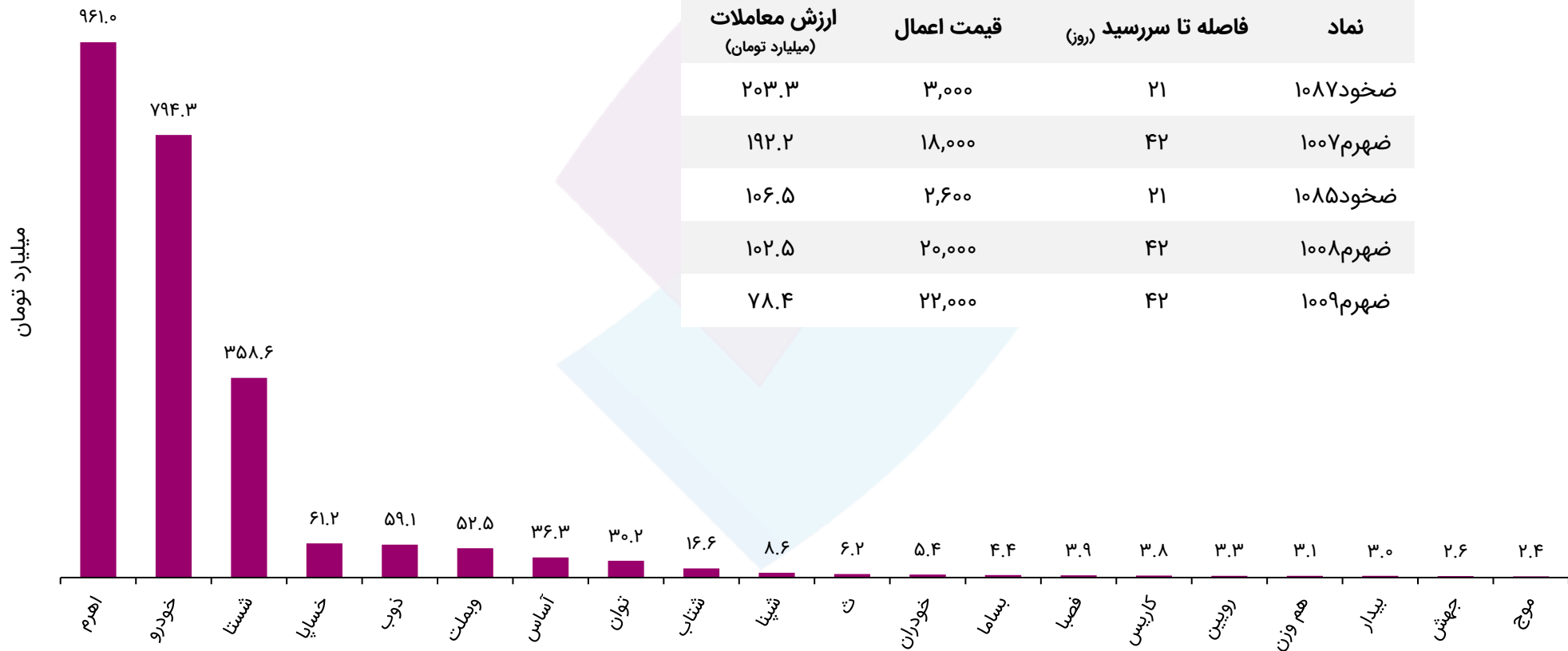
(۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

(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 ۱۰۸۷	۲۱	۳,۰۰۰	۲۰۳.۳
ضهرم ۱۰۰۷	۴۲	۱۸,۰۰۰	۱۹۲.۲
ضخود ۱۰۸۵	۲۱	۲,۶۰۰	۱۰۶.۵
ضهرم ۱۰۰۸	۴۲	۲۰,۰۰۰	۱۰۲.۵
ضهرم ۱۰۰۹	۴۲	۲۲,۰۰۰	۷۸.۴



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)