

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 ۵ دی - شماره ۱۸۲

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



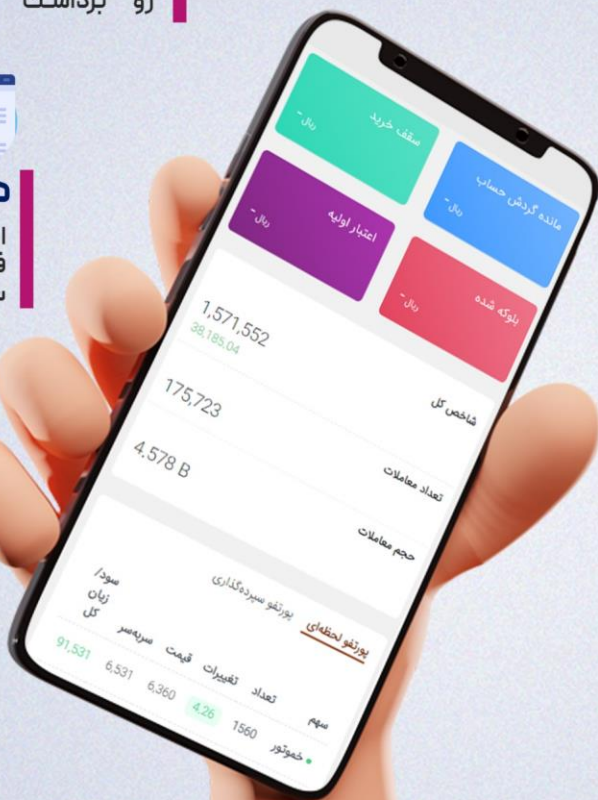
برداشت وجه آتی

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

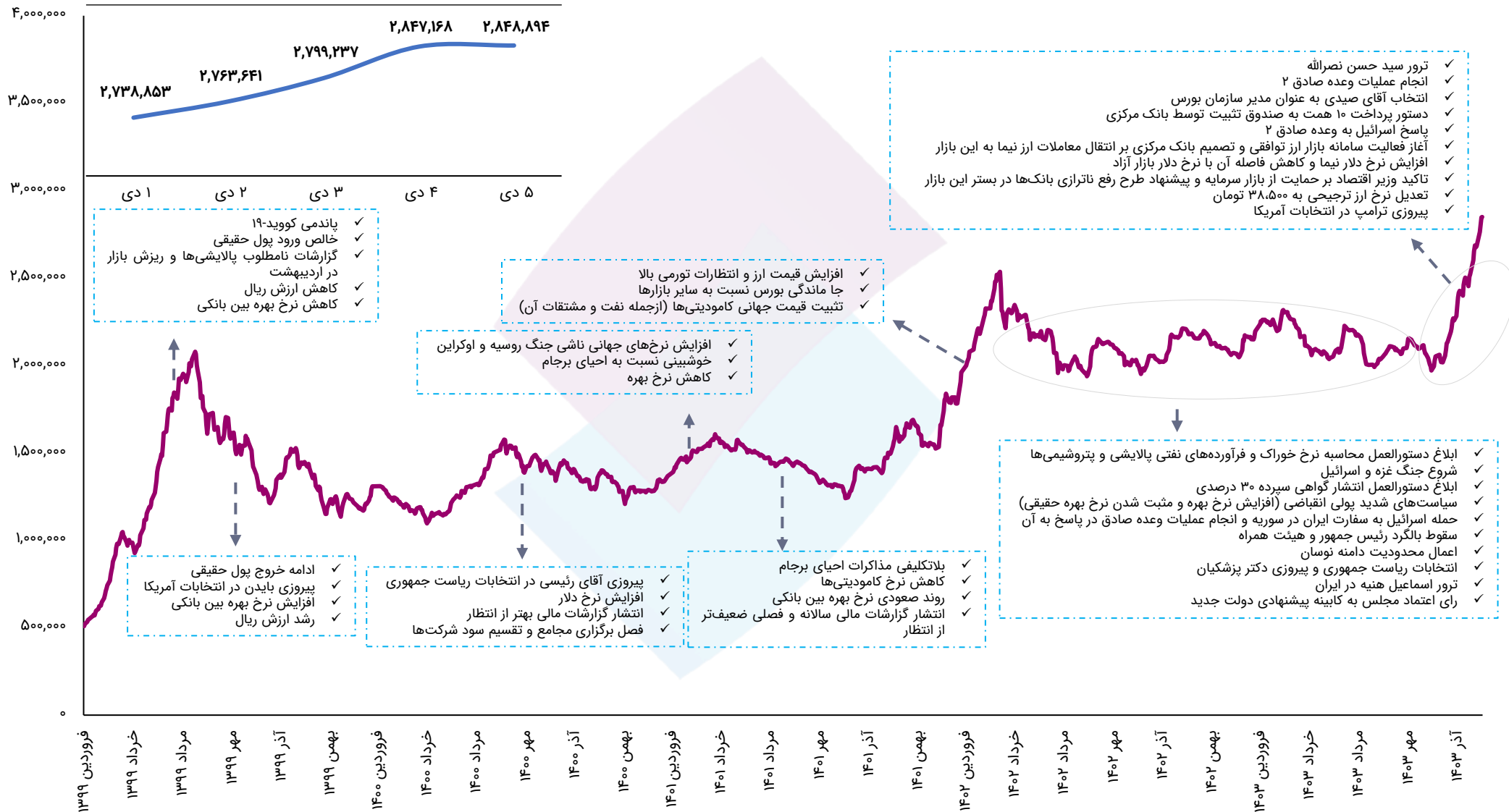
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

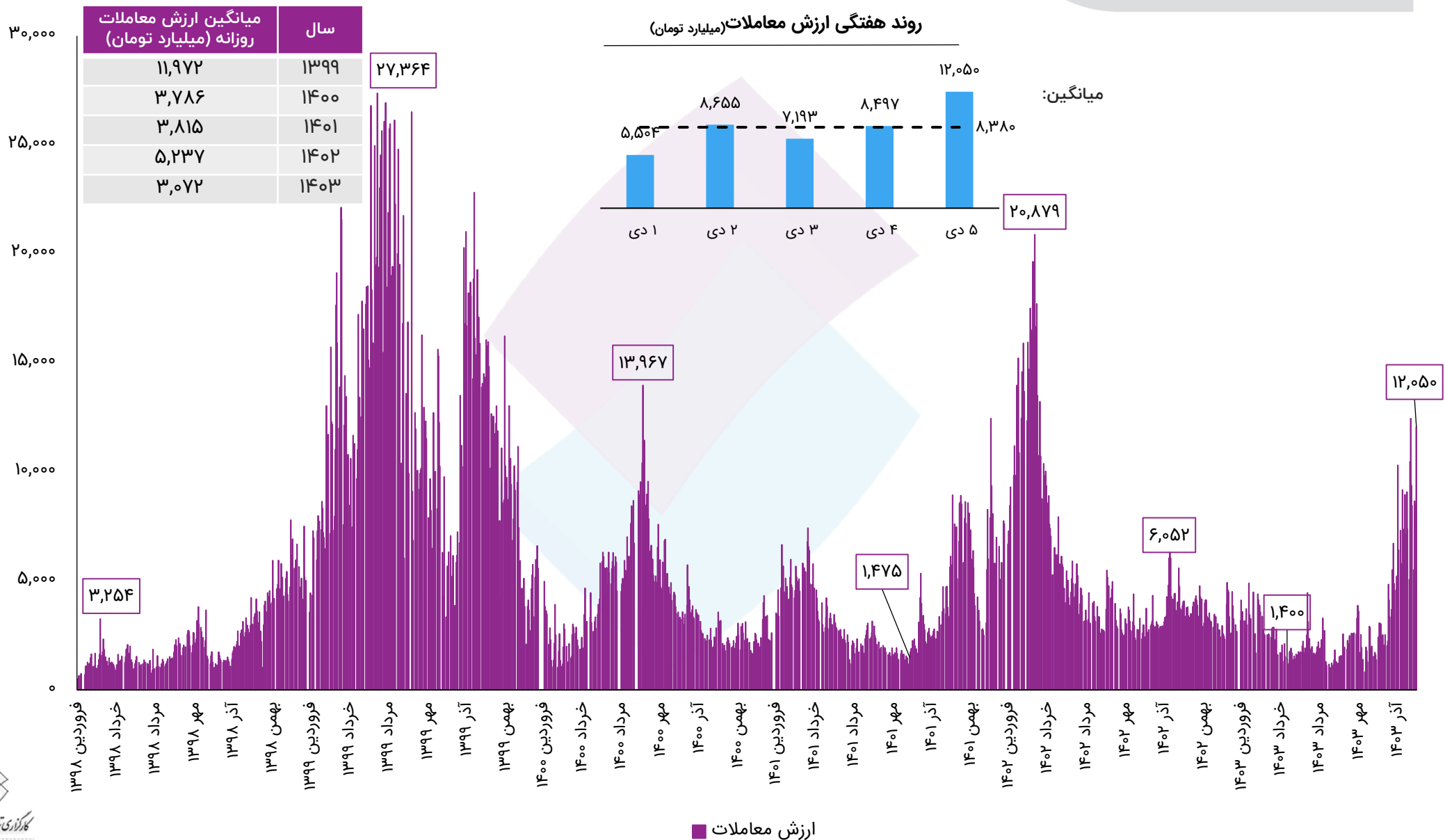
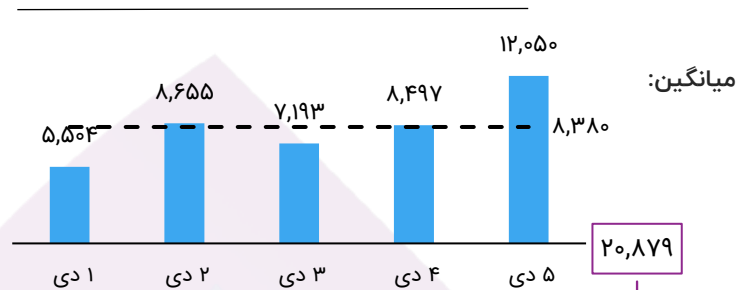
رشد ۶.۳ درصدی شاخص کل در هفته جاری

رشد هفتگی شاخص کل

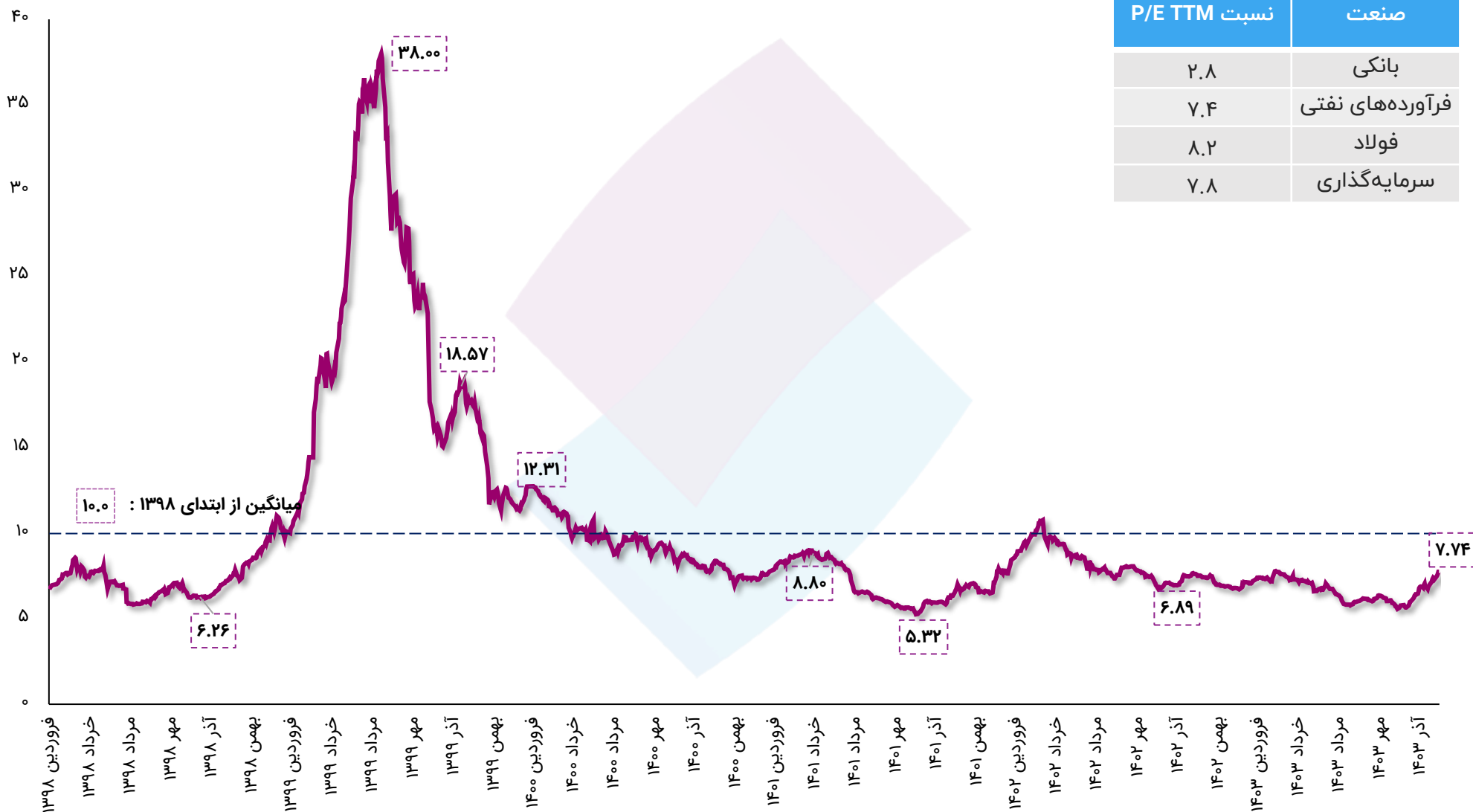


ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

رشد هفتگی ارزش معاملات (میلیارد تومان)



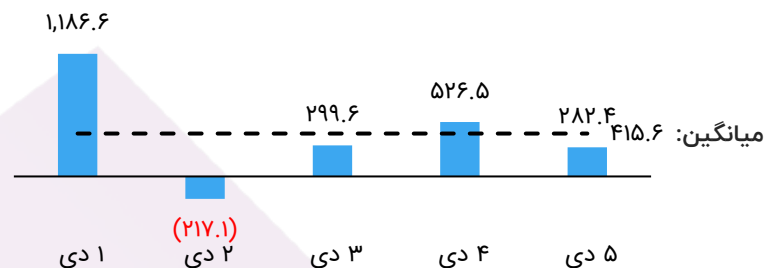
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



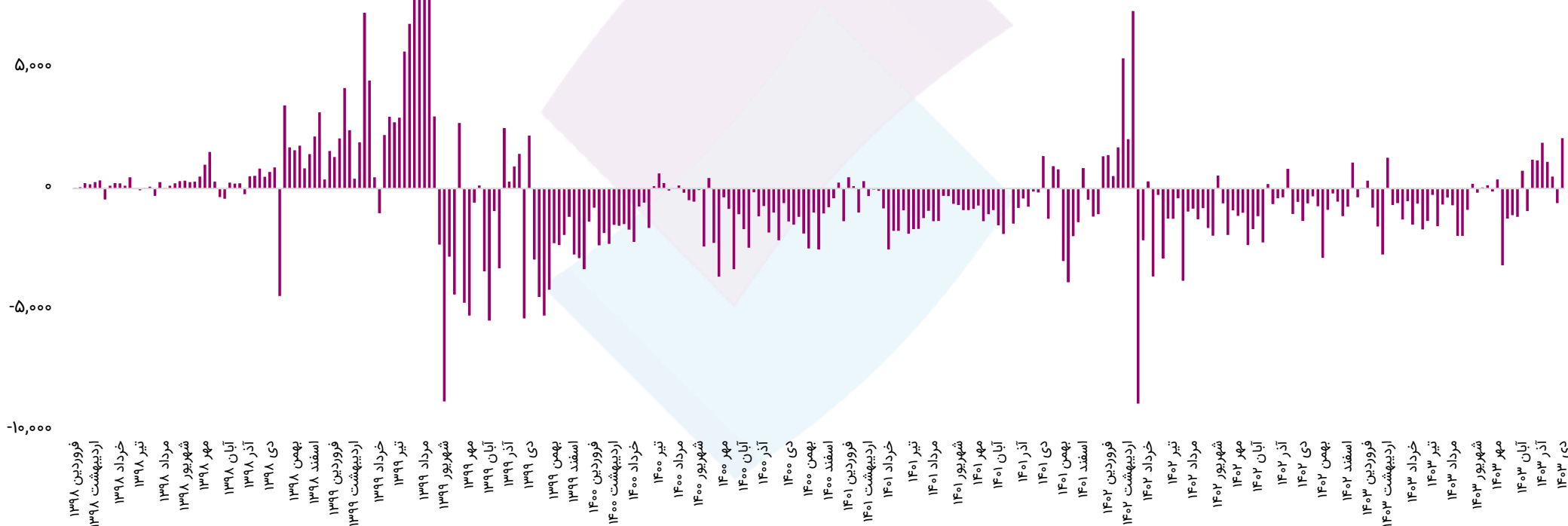
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۸	بانکی
۷.۴	فرآورده های نفتی
۸.۲	فولاد
۷.۸	سرمایه گذاری

۲,۰۷۸ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۶۰۲ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)



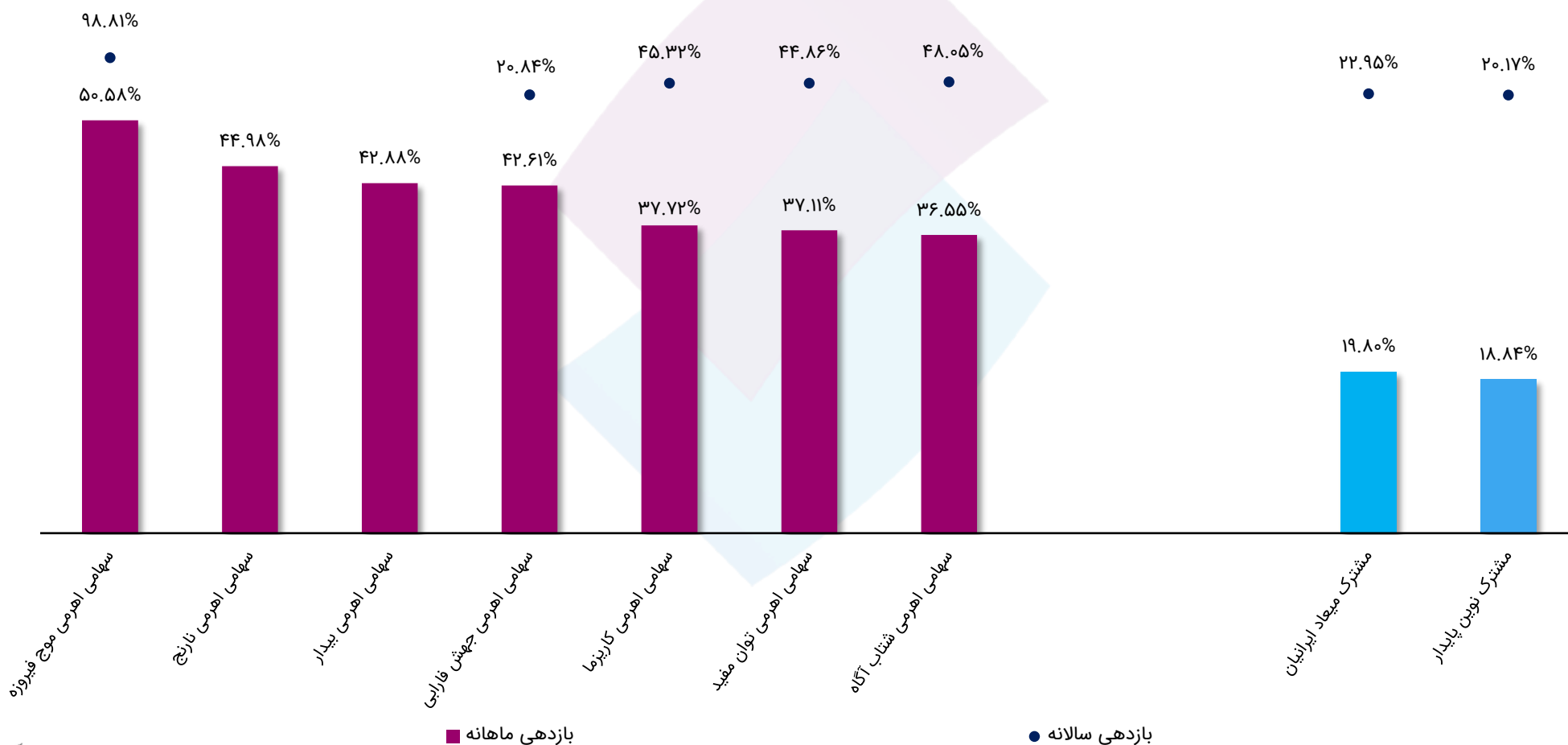
سال	خالص ورود حقیقی (همت)
۱۳۹۹	۲۱.۷
۱۴۰۰	(۵۸.۹)
۱۴۰۱	(۴۲.۸)
۱۴۰۲	(۳۶.۳)
۱۴۰۳	(۱۹.۱)



خالص ورود و خروج هفتگی

صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

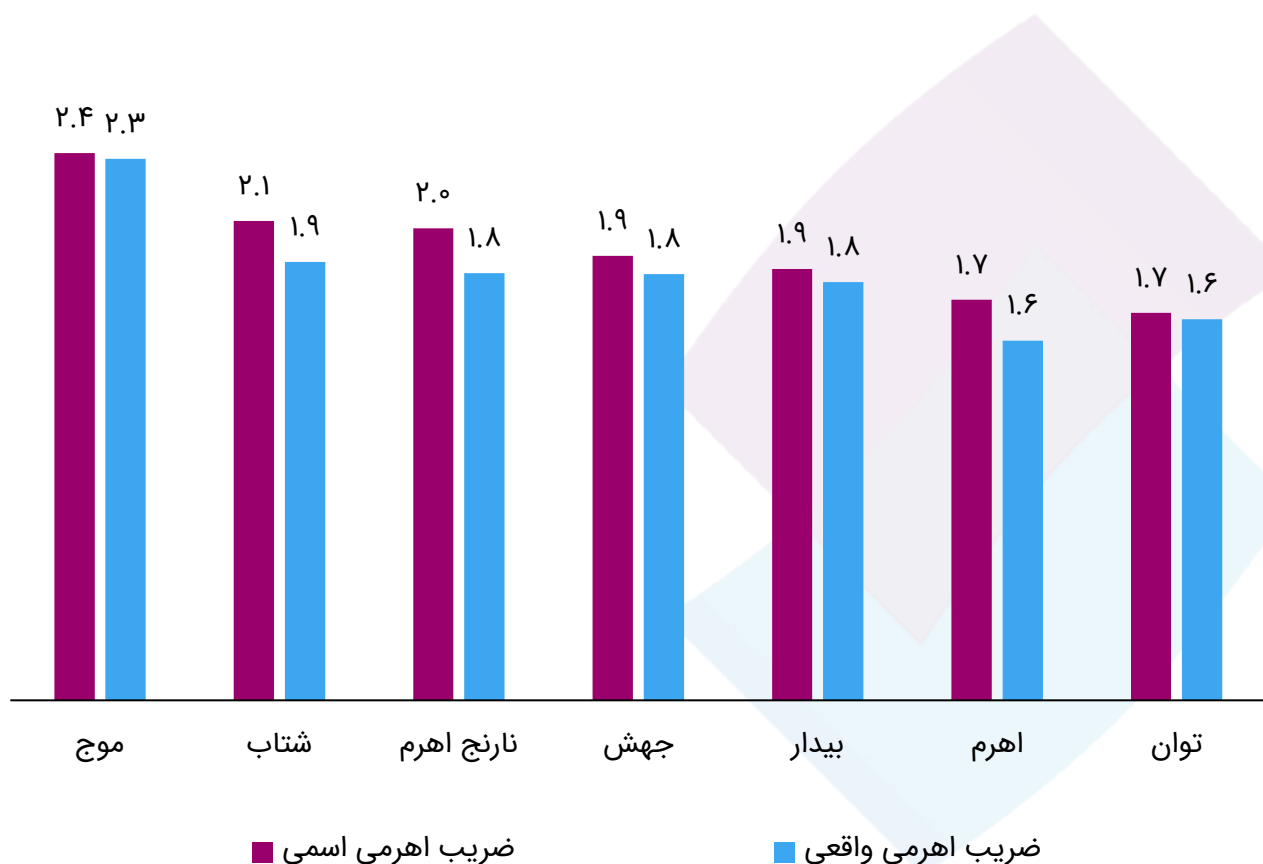
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بازدهی ماهانه

بازدهی سالانه

صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
موج	۰.۲%	۱.۶
اهرم	۱.۱%	۱.۷
شتاب	۲.۶%	۱.۶
جهش	۳.۲%	۱.۸
نارنج اهرم	۳.۳%	۱.۸
بیدار	۳.۷%	۱.۸
توان	۳.۸%	۱.۶

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
بیدار	۵۴.۹%	۲.۵۴%
جهش	۵۳.۹%	۲.۵۴%
نارنج اهرم	۵۲.۴%	۲.۵۵%
موج	۵۲.۳%	۲.۵۴%
توان	۴۵.۴%	۲.۲۶%
اهرم	۴۳.۶%	۲.۵۵%
شتاب	۴۲.۸%	۲.۳۸%

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

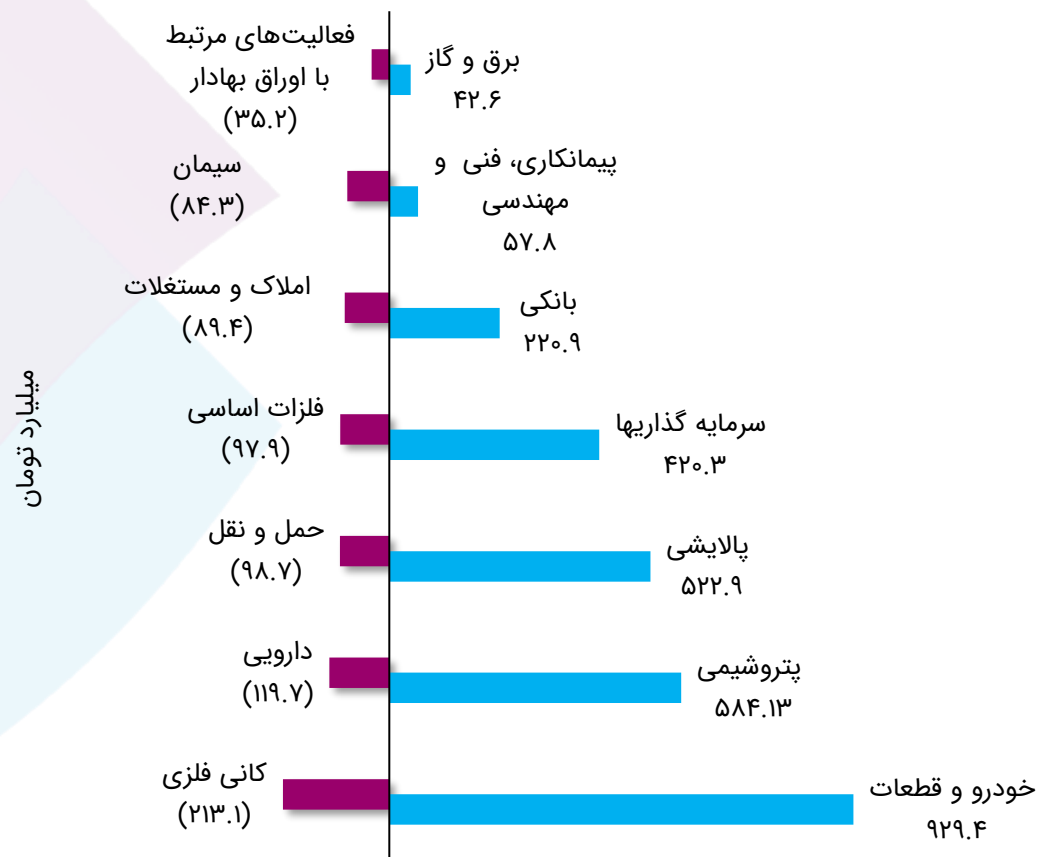
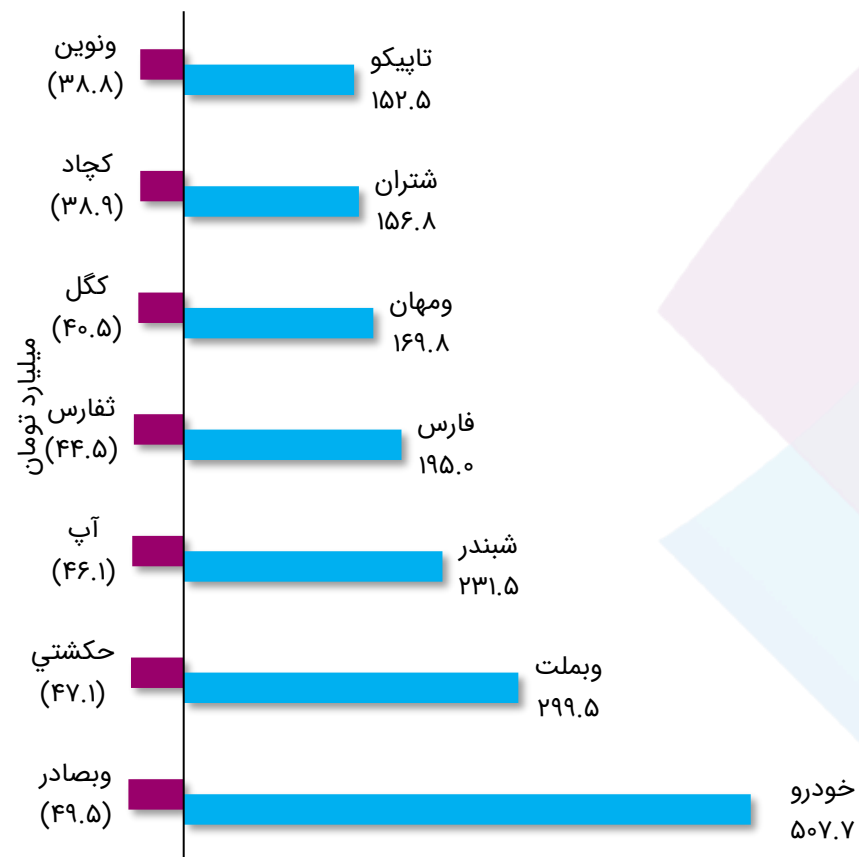
ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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 ۹۰ روز گذشته استفاده شده است.

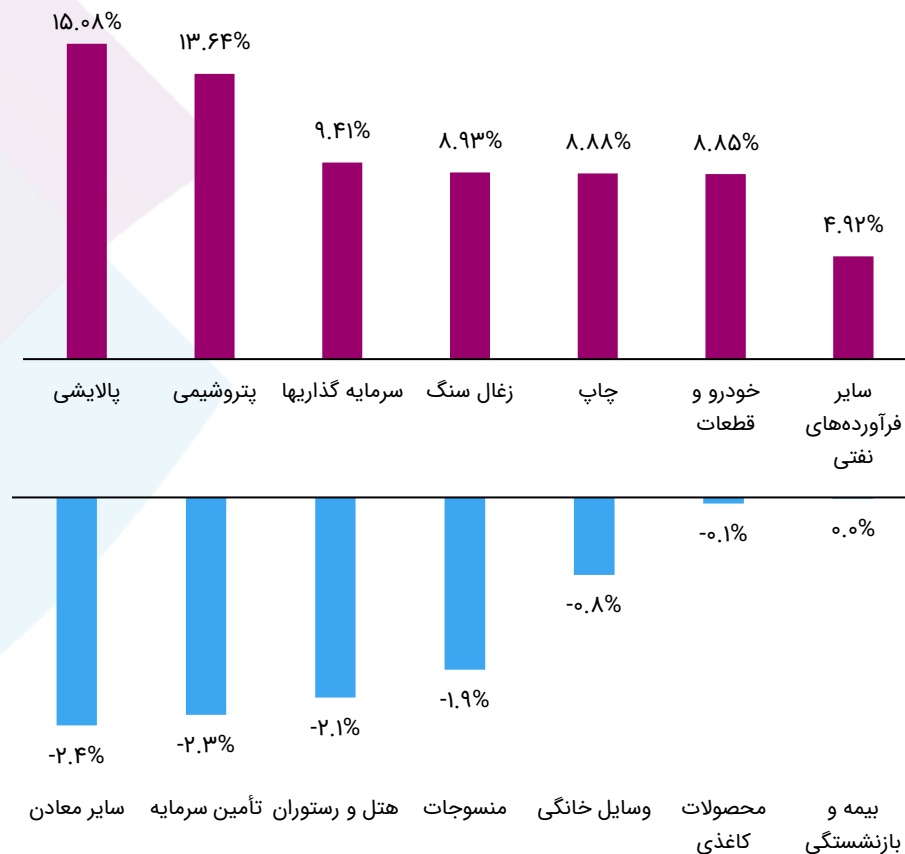
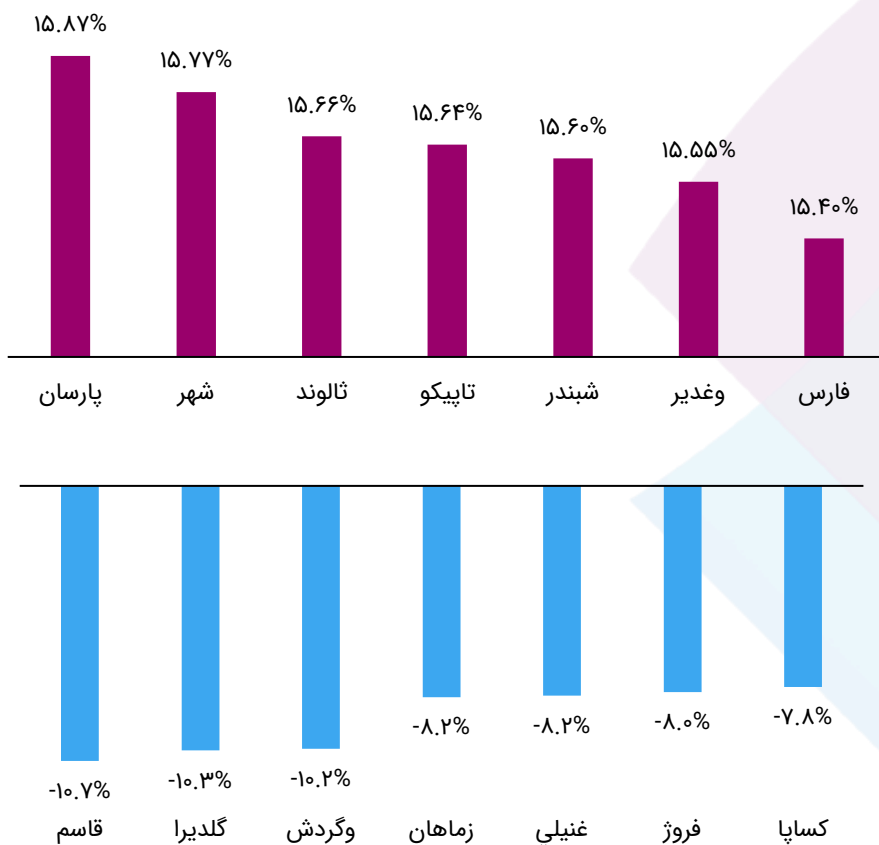
نماد

صنعت



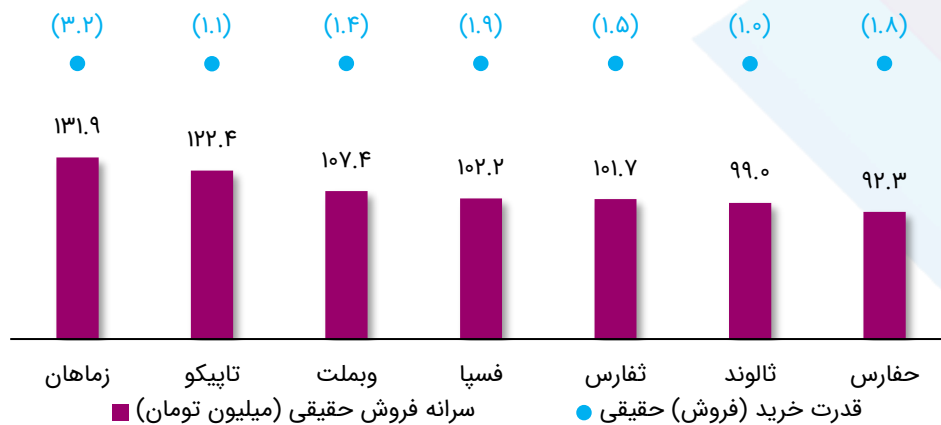
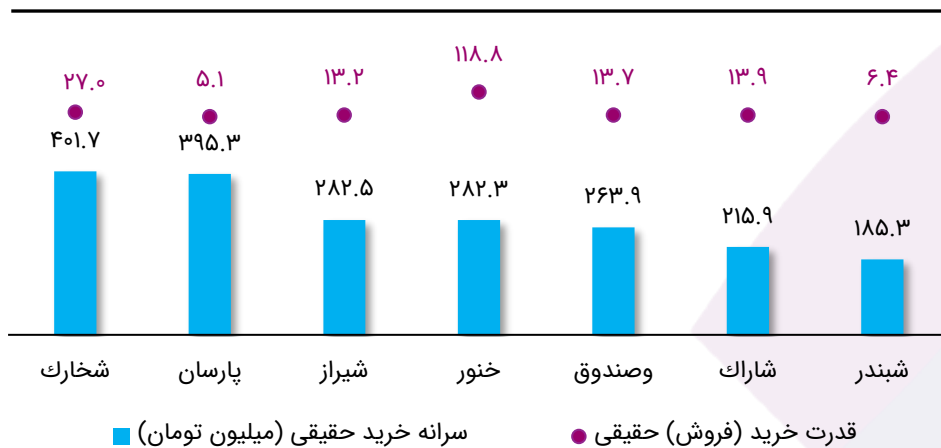
نماد

صنعت

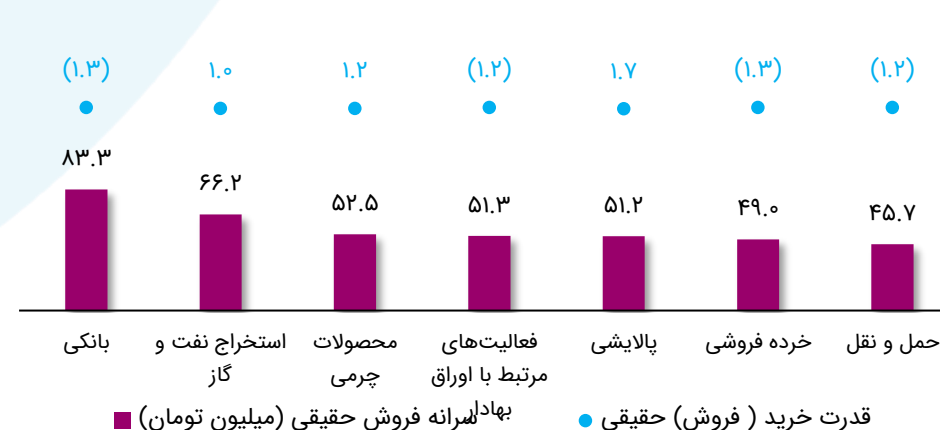
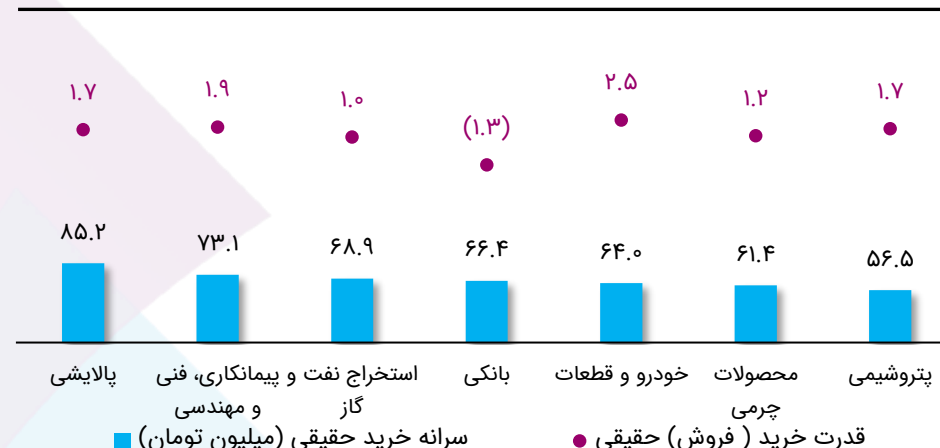


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



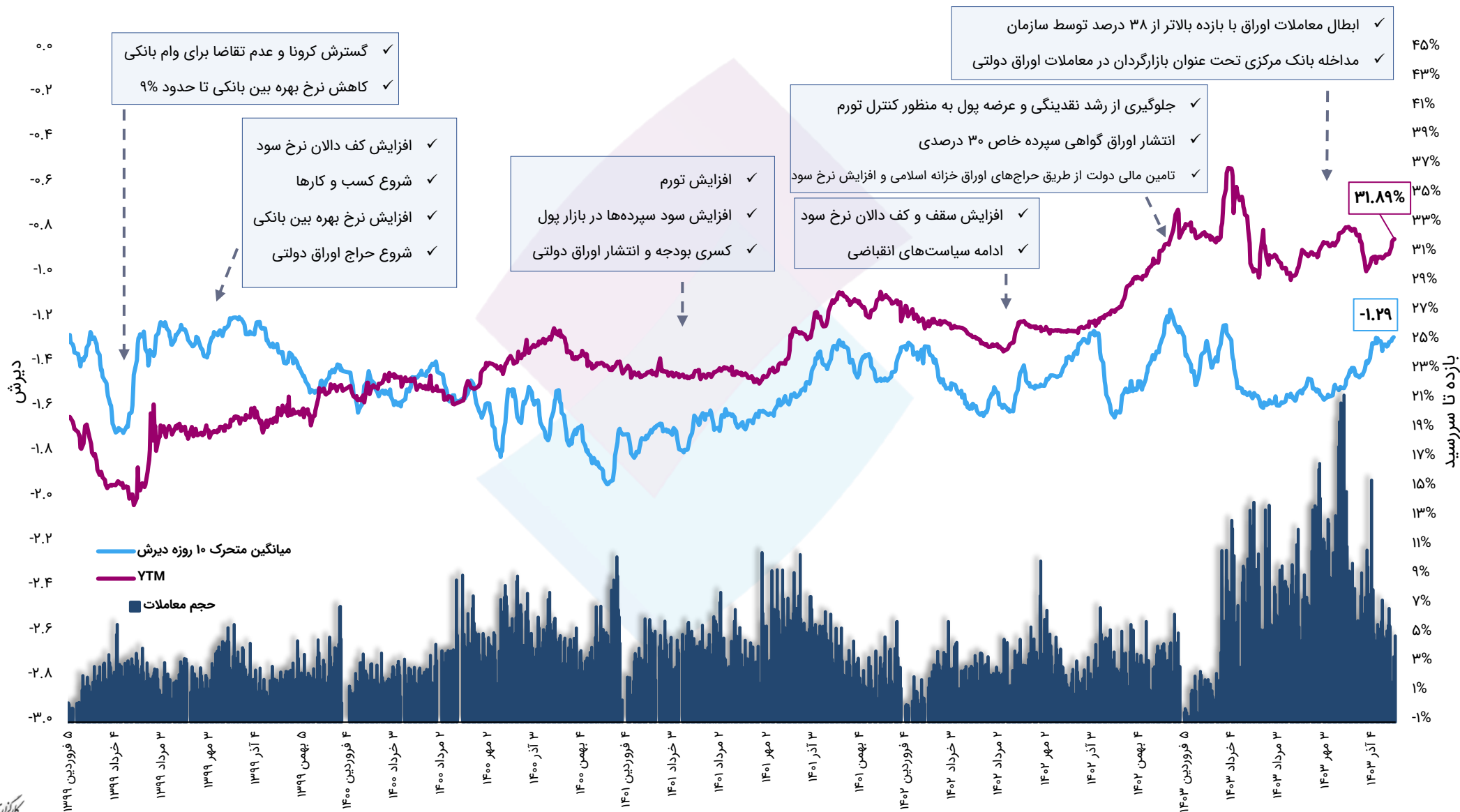
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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				
کپارس	۱۶۴	۲۵۱	۵۳%	ه منظور اصلاح ساختار مالی ، جبران مخارج سرمایه گذاری انجام شده و جلوگیری از خروج نقدینگی
دزهرای	۳۲۰	۱,۰۶۳	۲۳۲%	اصلاح ساختار مالی
وپاسار	۳۲,۲۹۶	۱۴۰,۰۰۰	۳۳۳%	نظور بهبود نسبت کفایت سرمایه، افزایش سقف اعطای تسهیلات و بهبود سایر شاخص های مالی
وتوسم	۱,۳۰۰	۲,۶۰۰	۱۰۰%	منظور جبران مخارج سرمایه ای مشارکت در افزایش سرمایه های در جریان شرکت های سرمایه پذیر و انجام سرمایه گذاری های جدید
قچار	۴۵۰	۷۰۰	۵۶%	جلوگیری از خروج نقدینگی از شرکت به منظور حفظ وضعیت سرمایه در گردش و اصلاح ساختار مالی
نتوس	۲۸	۵۱	۸۵%	صلاح ساختار مالی و به جهت ادامه روند روبه رشد تولید و فروش شرکت
وکادو	۳۹۸	۷۹۷	۱۰۰%	اصلاح ساختار مالی و افزایش سودآوری
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه				
قشرین	۶۸۰	۱,۰۳۳	۵۲%	بهبود ساختار مالی، بازپرداخت بدهی حق تقدیمی به آستان قدس، عدم اخذ تسهیلات مالی و کاهش هزینه های مالی

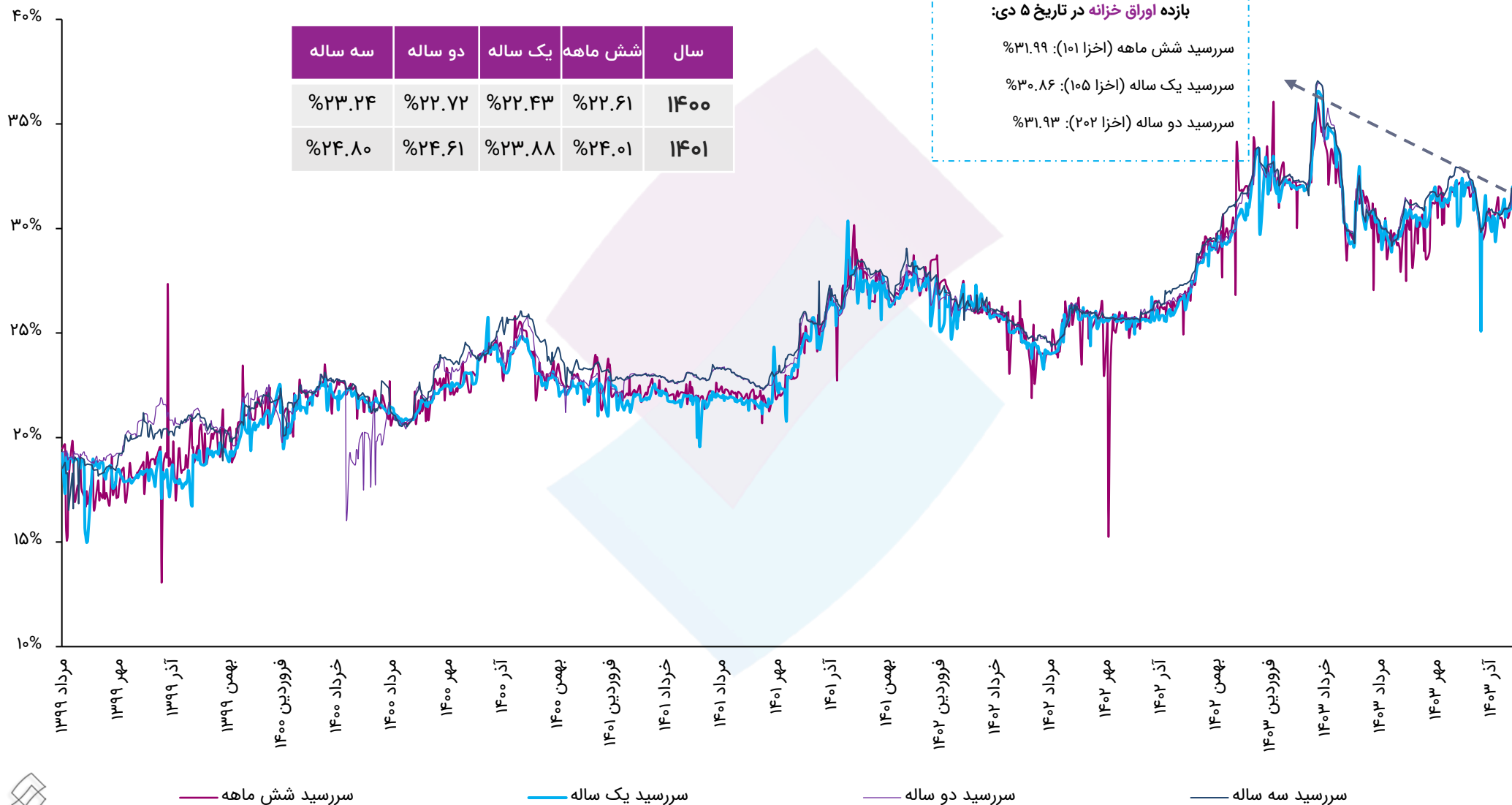
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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					
توسن	۳۰۰	۵۰۰	۶۷%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج وجه نقد و استفاده از معافیت مالیاتی
وصنا	۸۱۵	۱,۱۶۵	۴۳%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
دسبحان	۵۳۳	۱۴۹	۲۸%	سود انباشته	خرید و جایگزینی ماشین آلات و تجهیزات تولیدی و ایجاد سایت سرم سازی
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
ددانا	۲۴۰	۷۲۰	۲۰۰%	سود انباشته	جلوگیری از خروج وجه نقد و تامین منابع مالی جهت اجرای طرح های توسعه ای
وکار	۵,۰۰۰	۶,۰۰۰	۲۰%	اندوخته (۲۹%) سود انباشته (۷۱%)	استفاده از معافیت مالیاتی مبلغ افزایش سرمایه از محل سود تقسیم نشده
دعبید	۲,۵۰۰	۴,۱۰۰	۶۴%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و تامین بخشی از سرمایه در گردش مورد نیاز
تک نیرو	۲۵	۷۶	۲۰۴%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد
سرود	۸۱	۹۶۰	۱۰۸۵%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی
ثرو	۵۰	۷۵	۵۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

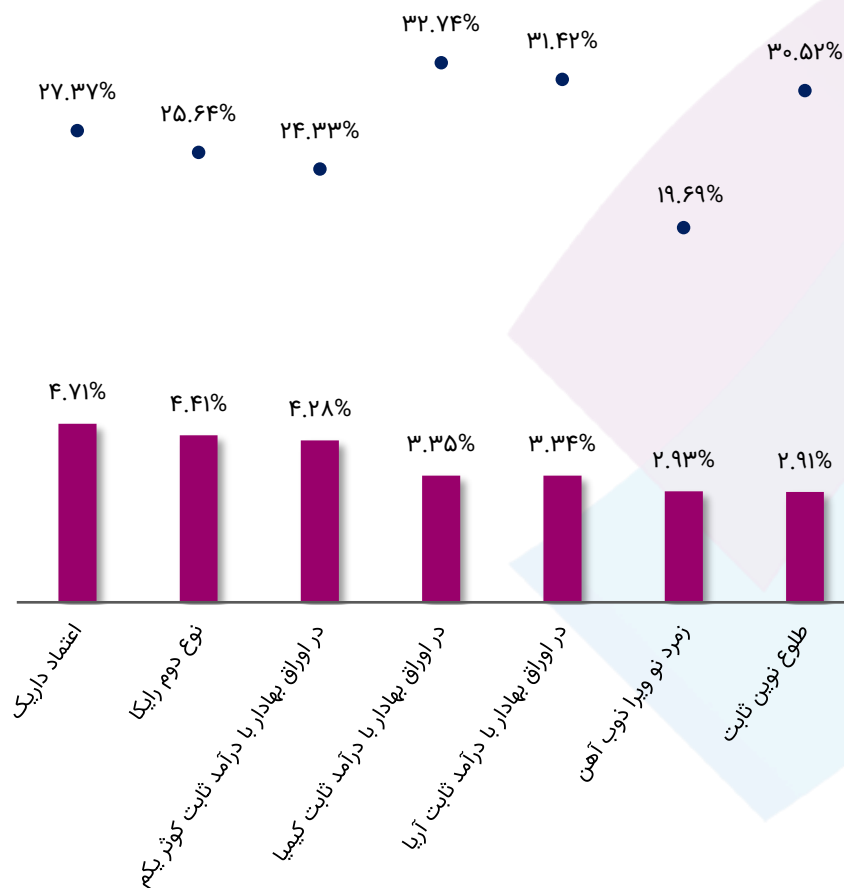
افزایش ۱.۰۳ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۱.۸۹ درصد



بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

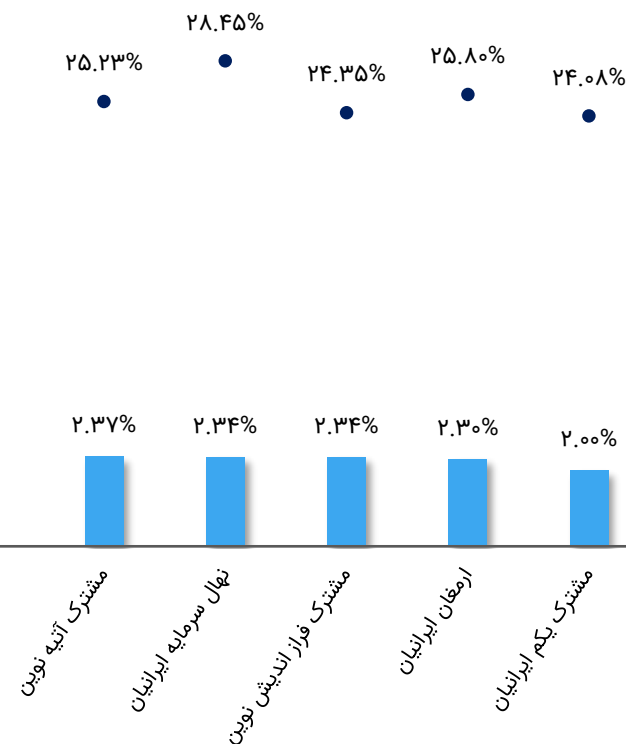


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



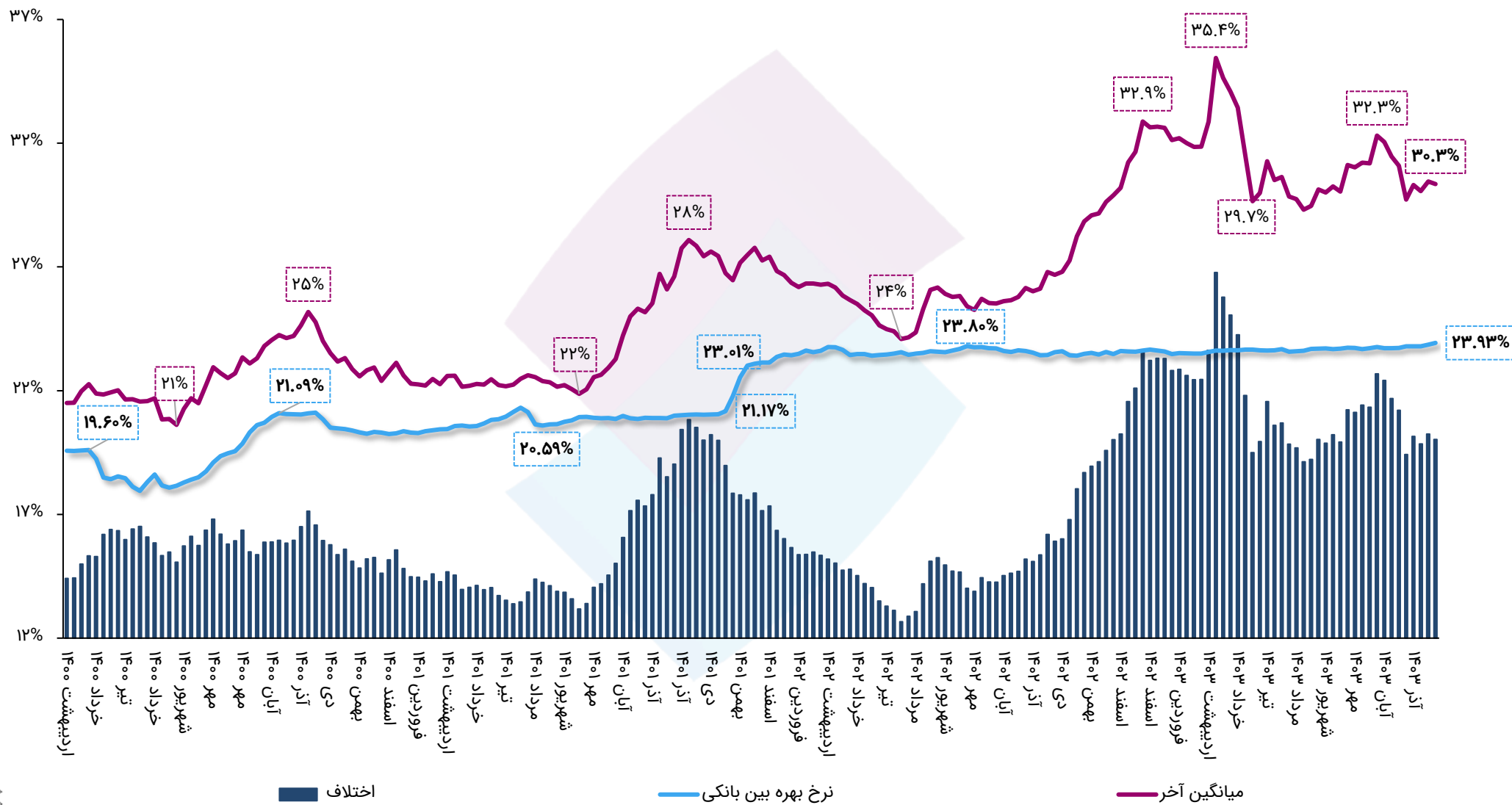
■ بازدهی ماهانه

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



● بازدهی سالانه

رشد نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۹۳ درصد و اجرای سی و یکمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به مبلغ ۲۴ همت



معامله ۵۸۱ هزار و ۴۱۸ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

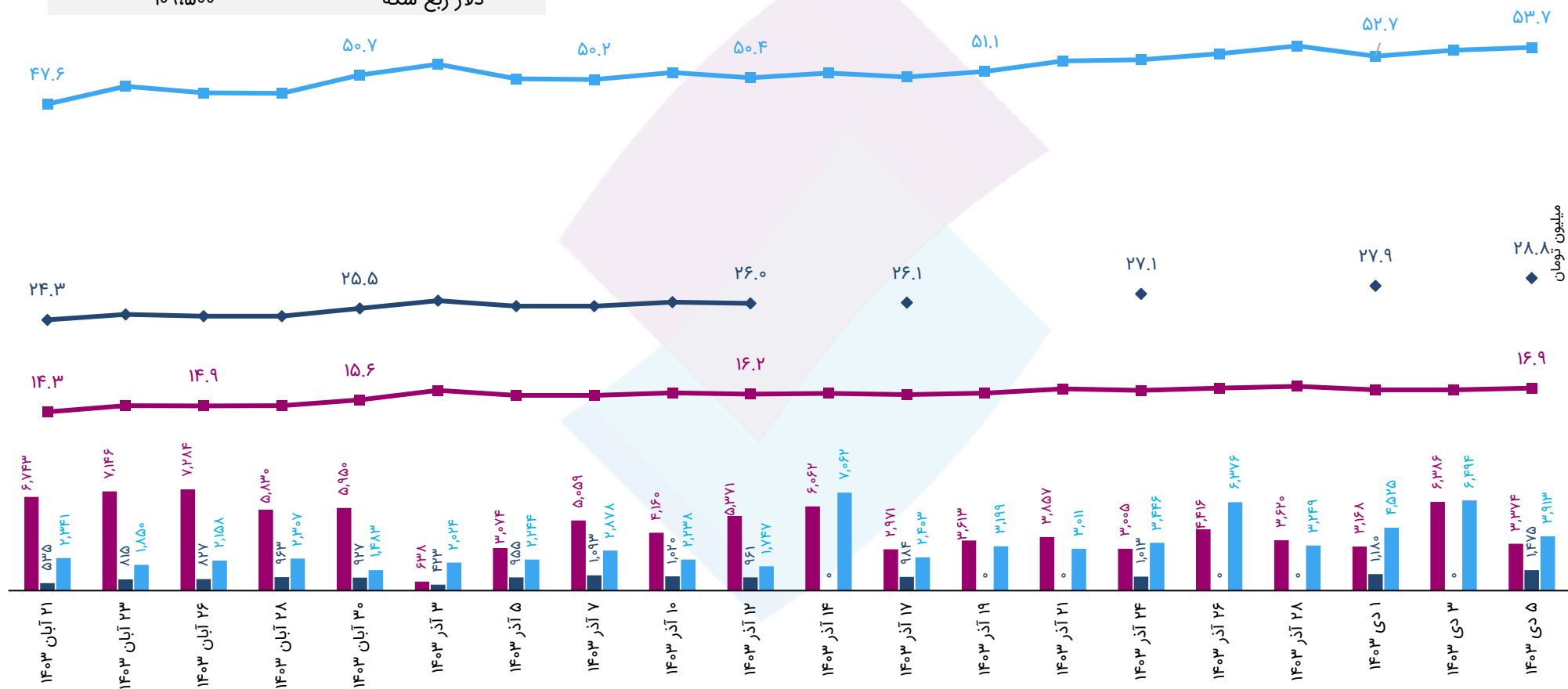
آخرین نرخ
مبلغ (تومان)

۶۶،۱۴۱ دلار مرکز مبادله

۸۷،۱۰۰ دلار سکه تمام

۹۳،۳۰۰ دلار نیم سکه

۱۰۹،۵۰۰ دلار ربع سکه



میلیون تومان

معامله ۱۳ هزار و ۴۵۲ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

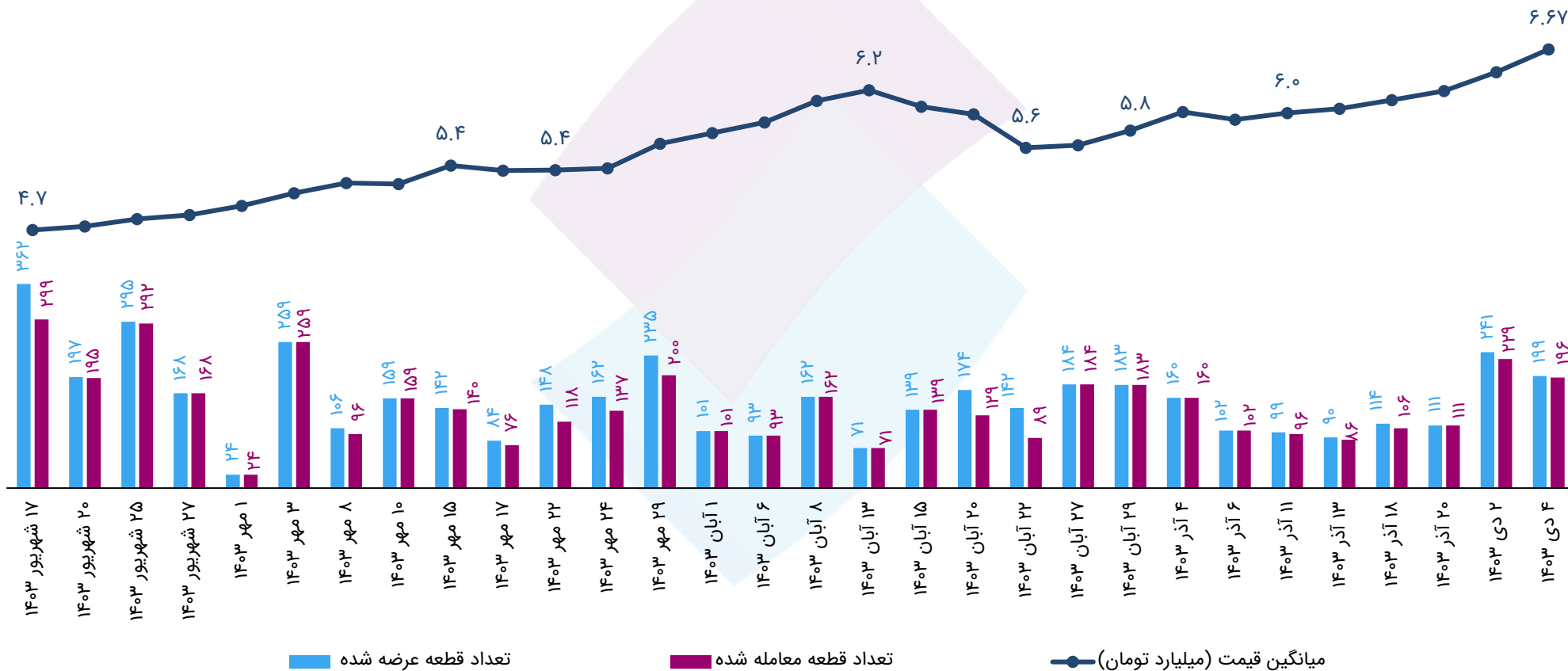
آخرین نرخ

مبلغ (تومان)

در تاریخ آخرین حراج

دلار مرکز مبادله

دلار شمش طلا مرکز مبادله



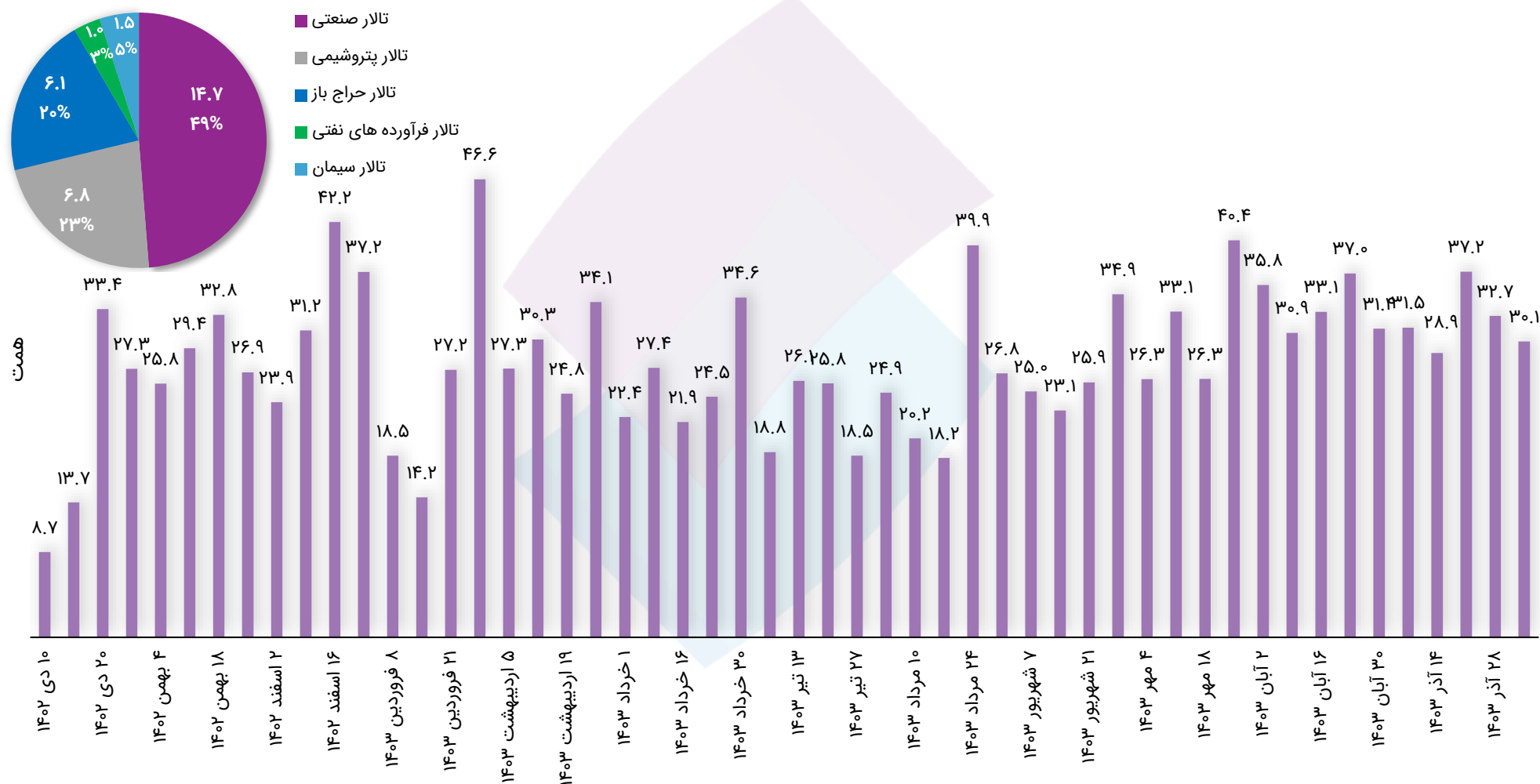
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۲۶.۸%	۲,۰۶۴	-۰.۳%	۲,۶۲۶	۰.۶%	۲,۶۰۱	۲,۶۱۷	طلا (دلار/انس)
۸۷.۸%	۲۹۴,۱۰۰	۶.۸%	۵۱۷,۲۰۰	۰.۴%	۵۵۰,۴۰۰	۵۵۲,۴۰۰	سکه (هزار ریال)
۵۴.۰%	۴۲۹,۳۶۰	۲۴.۶%	۵۳۰,۸۷۱	۳.۷%	۶۳۷,۸۳۰	۶۶۱,۴۱۸	دلار اسکناس (ریال)
۶۴.۸%	۳۹۰,۴۳۴	۲۴.۶%	۵۱۶,۴۱۱	۳.۷%	۶۲۰,۴۵۷	۶۴۳,۴۰۳	دلار حواله (ریال)
-۹.۱%	۸۱	۰.۸%	۷۳	۰.۹%	۷۳	۷۴	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۳۰.۴%	۴۲,۵۲۰	۵.۲%	۹۳,۱۰۲	-۲.۱%	۱۰۰,۰۴۲	۹۷,۹۶۷	بیت کوین (دلار)
۴.۱%	۸,۴۹۹	-۰.۸%	۸,۹۱۷	-۰.۷%	۸,۹۰۵	۸,۸۴۷	مس LME (دلار/تن)
۱۷.۳%	۲,۵۷۵	۰.۴%	۳,۰۱۰	۱.۲%	۲,۹۸۷	۳,۰۲۲	روی LME (دلار/تن)
-۱۲.۹%	۵۰۹	-۳.۲%	۴۵۸	۰.۹%	۴۳۹	۴۴۳	بیلت CIS (دلار/تن)
-۲.۴%	۴۶۶	-۲.۴%	۴۶۶	۰.۰%	۴۵۵	۴۵۵	بیلت ایران (دلار/تن)
۳.۴%	۲۹۴	۲.۰%	۲۹۸	۱.۳%	۳۰۰	۳۰۴	متانول CFR (\$/mt)
۱۲.۰%	۳۱۲	۵.۶%	۳۳۱	۲.۸%	۳۴۰	۳۵۰	سبذ اوره (mt/\$)
۵۰.۲%	۲.۶۳	۴۲.۱%	۲.۷۸	۳۱.۲%	۳.۰۱	۳.۹۵	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

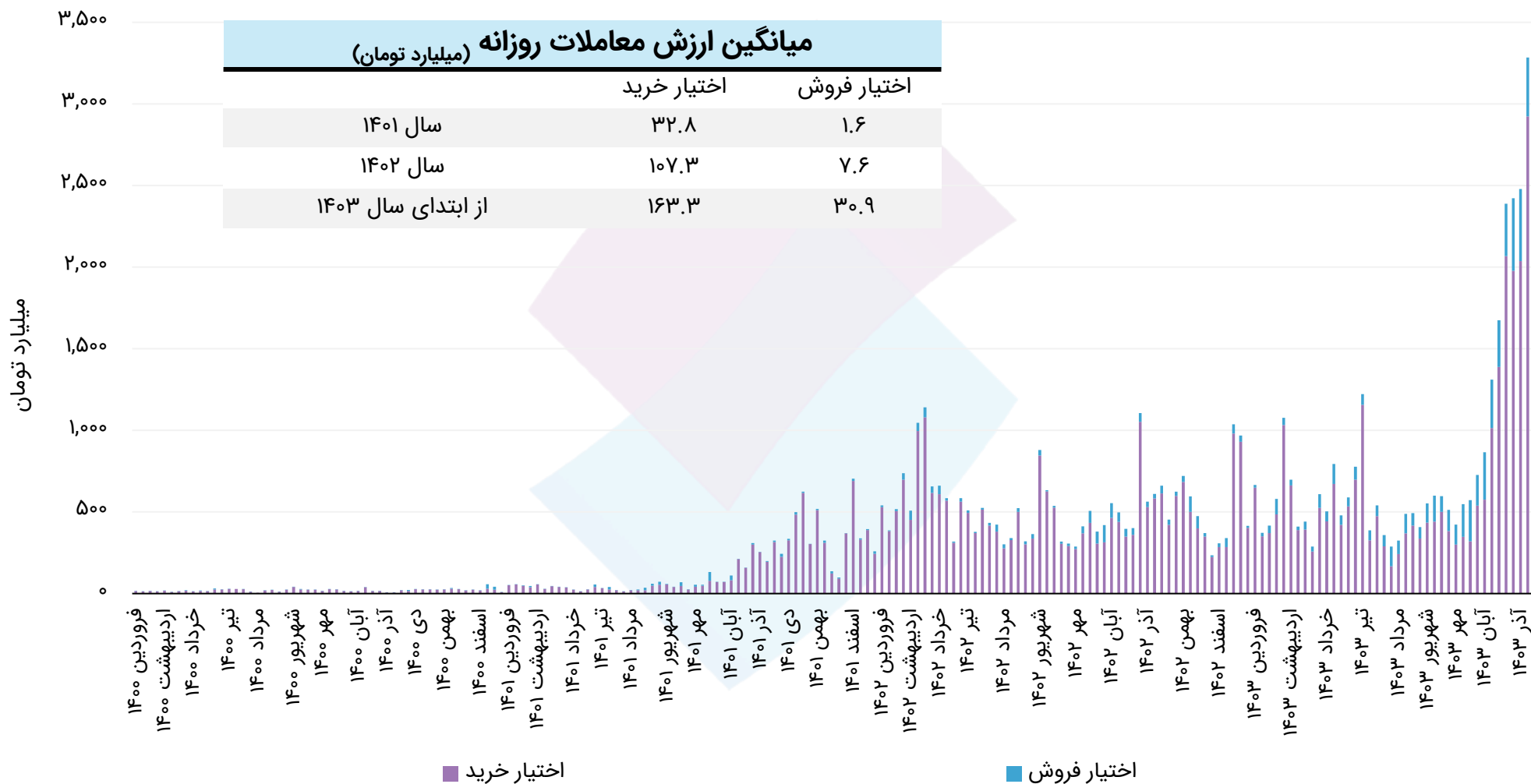


ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

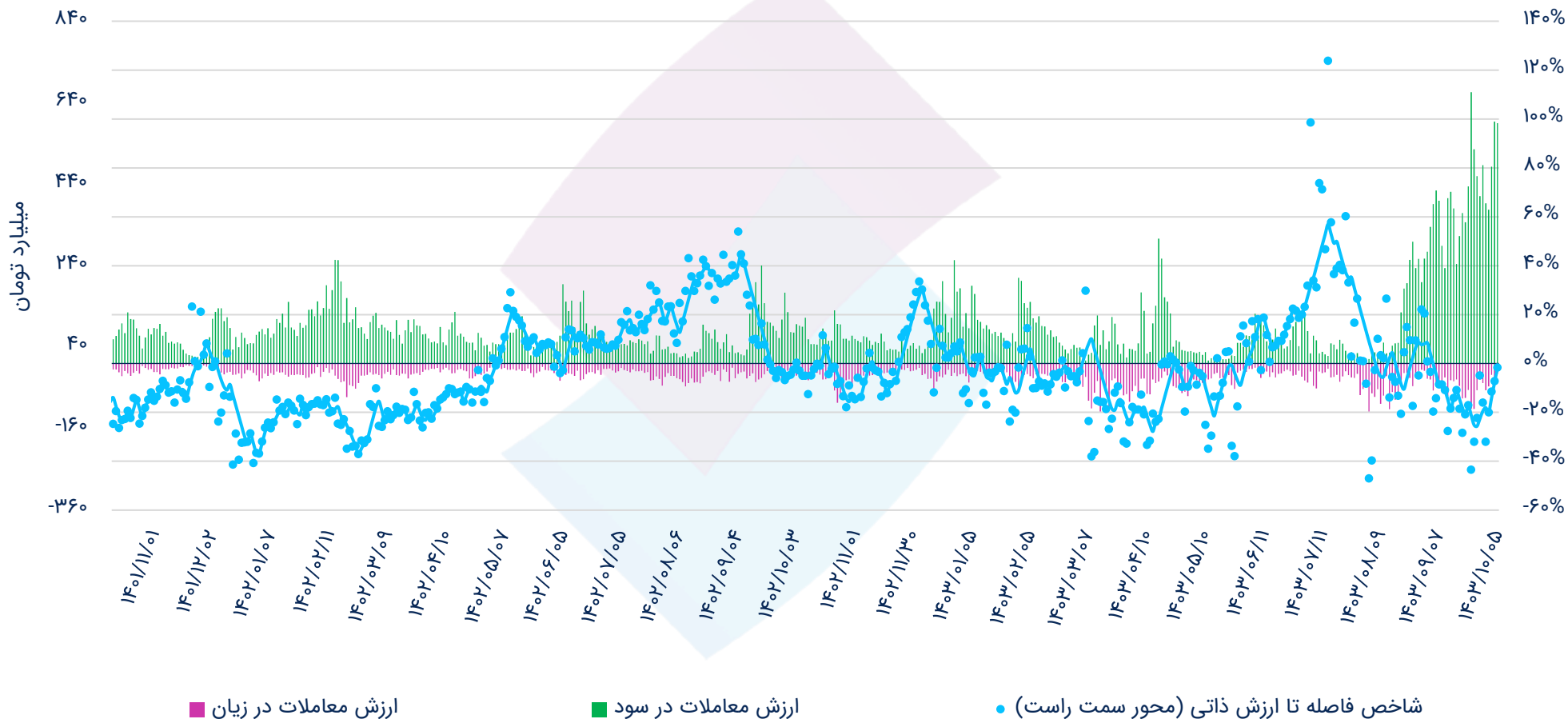
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۱	۵۳,۰۰۰	پارس فولاد سبزواری، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد غدیر نی ریز، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان
پلی اتیلن ترفتالات	۶۱.۷	۱۴,۷۴۰	پتروشیمی تندگویان
پلی اتیلن سبک خطی	۶۰.۴	۱۱,۳۴۴	پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی تبریز، پتروشیمی جم، پتروشیمی مهاباد
پلی اتیلن سبک فیلم	۶۴.۹	۱۰,۶۹۲	پتروشیمی آریا ساسول، پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی بندرامام، پتروشیمی کردستان، پتروشیمی لاله
پلی پروپیلن نساجی	۶۸.۴	۱۰,۶۴۴	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۴	۱,۰۳۷,۲۵۷	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
شمش آلومینیوم	۱۹۶.۲	۶,۹۷۵	آلومینای ایران، آلومینیوم مهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۵.۰	۱۵۶,۴۶۰	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، تولید فولاد تارا شمش یزد، فولاد کویر دامغان
کنسانتره سنگ آهن	۳.۹	۲۴۷,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، توسعه معدنی و صنعتی صابنور، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان
گندله سنگ آهن	۵.۶	۳۶۵,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
مس کاتد	۵۵۰.۶	۳,۵۴۰	ملی صنایع مس ایران، تماس
میلگرد	۲۸.۳	۵۲,۷۳۶	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرد ابرکوه، فولاد شاهرود، مجتمع فولاد خراسان، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، فولاد کاوه اروند، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب، فولاد آذربایجان، ذوب آهن آرمان آسیا، فولاد آلیاژی ایران
وکیوم باتوم	۲۱.۴	۹۲,۰۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز
مس مفتول	۵۹۶.۴	۲,۴۴۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، صنایع مس مفتولی ابهر
ورق سرد	۴۰.۴	۴۷,۱۵۰	فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

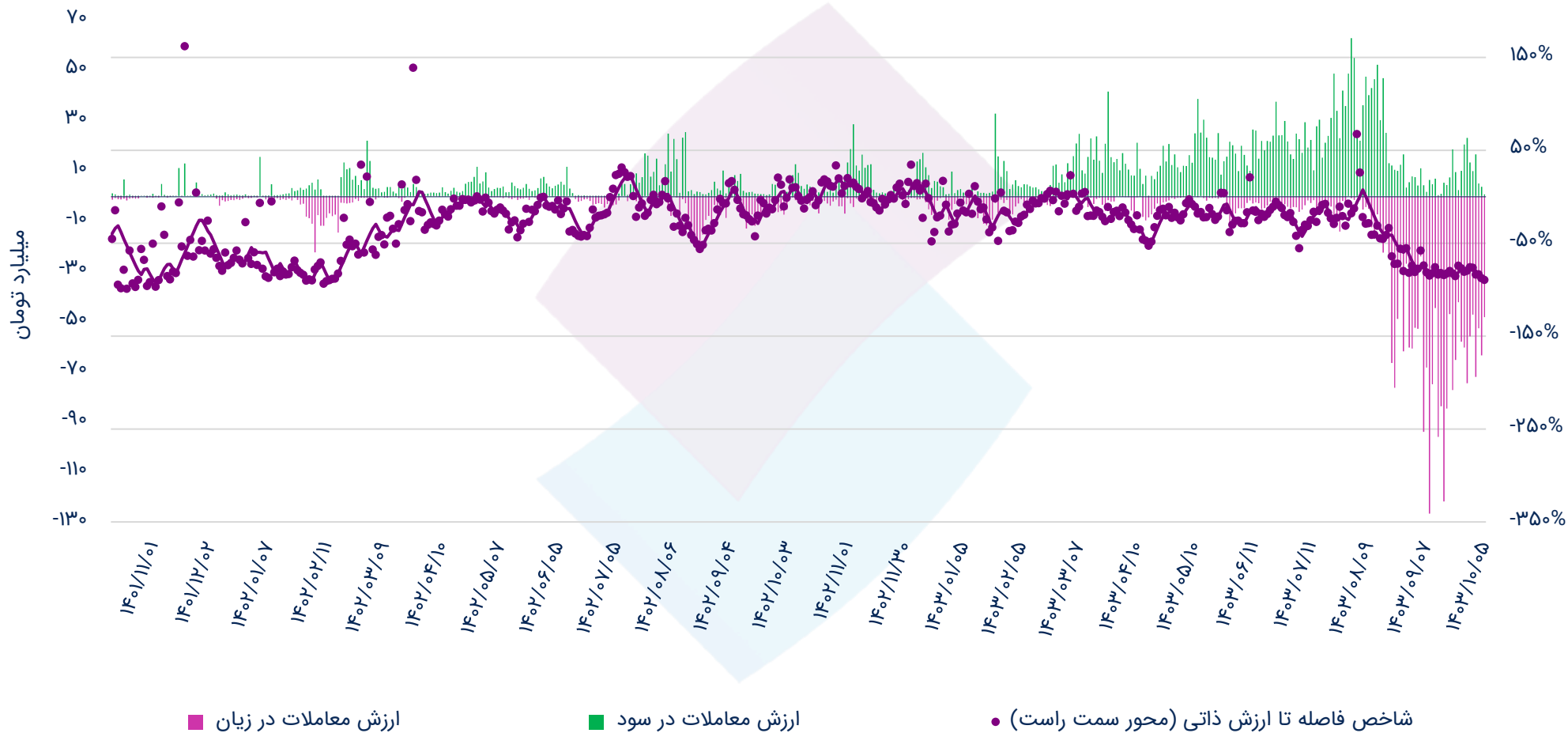


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

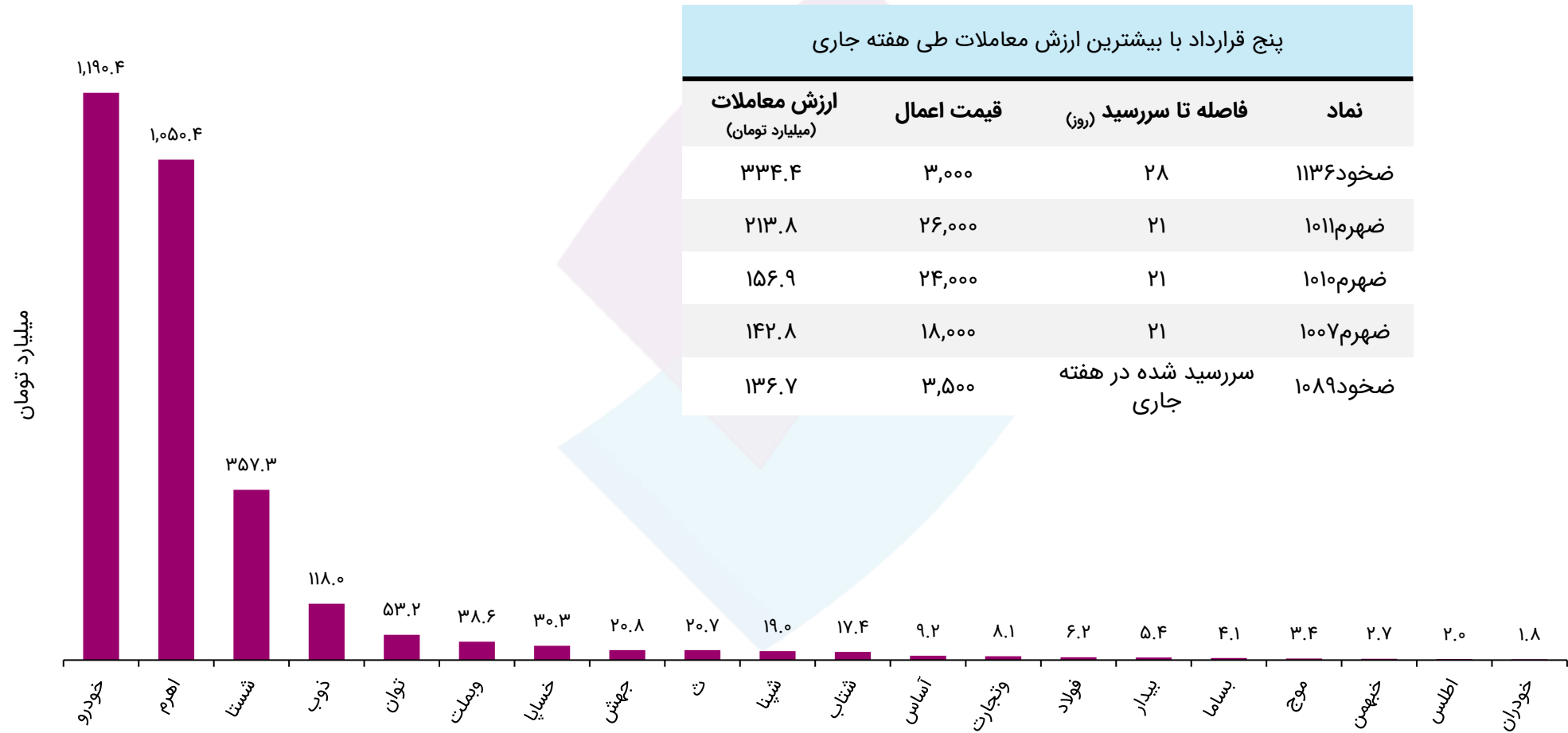
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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



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

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

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