

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 ۱۲ دی - شماره ۱۸۳

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



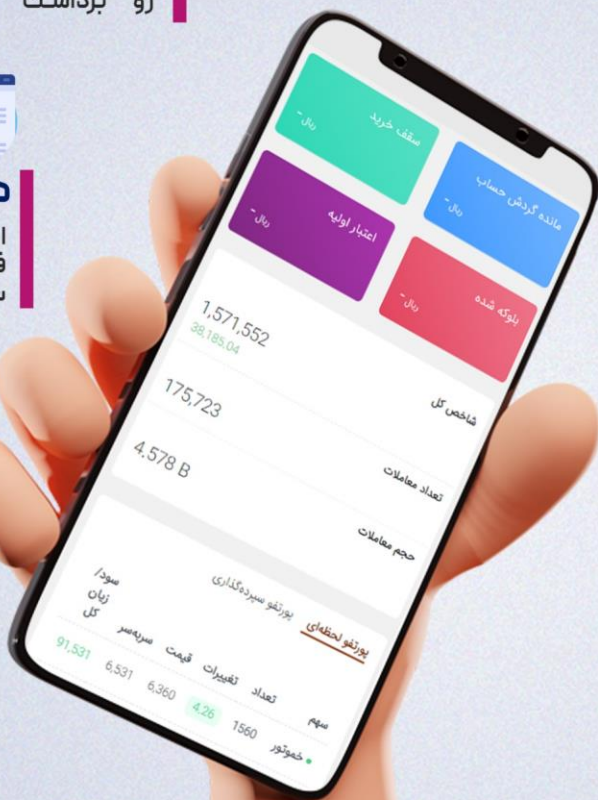
برداشت وجه آتی

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

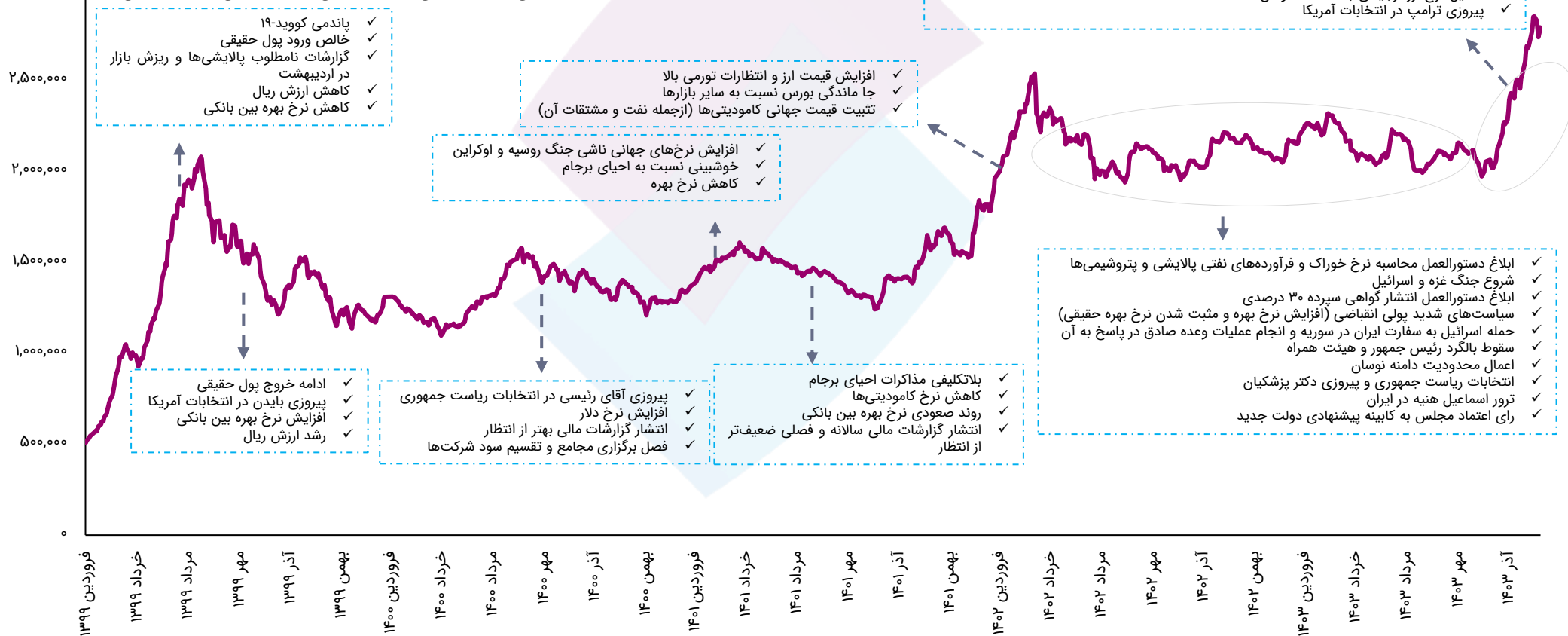
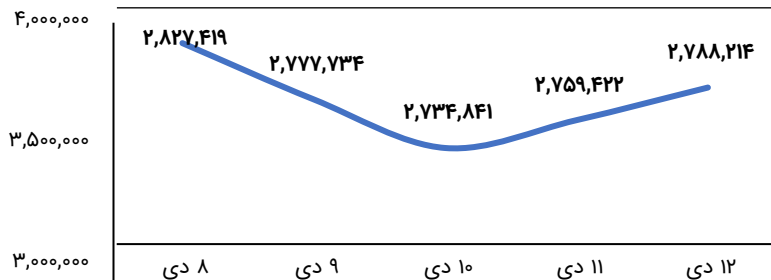
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

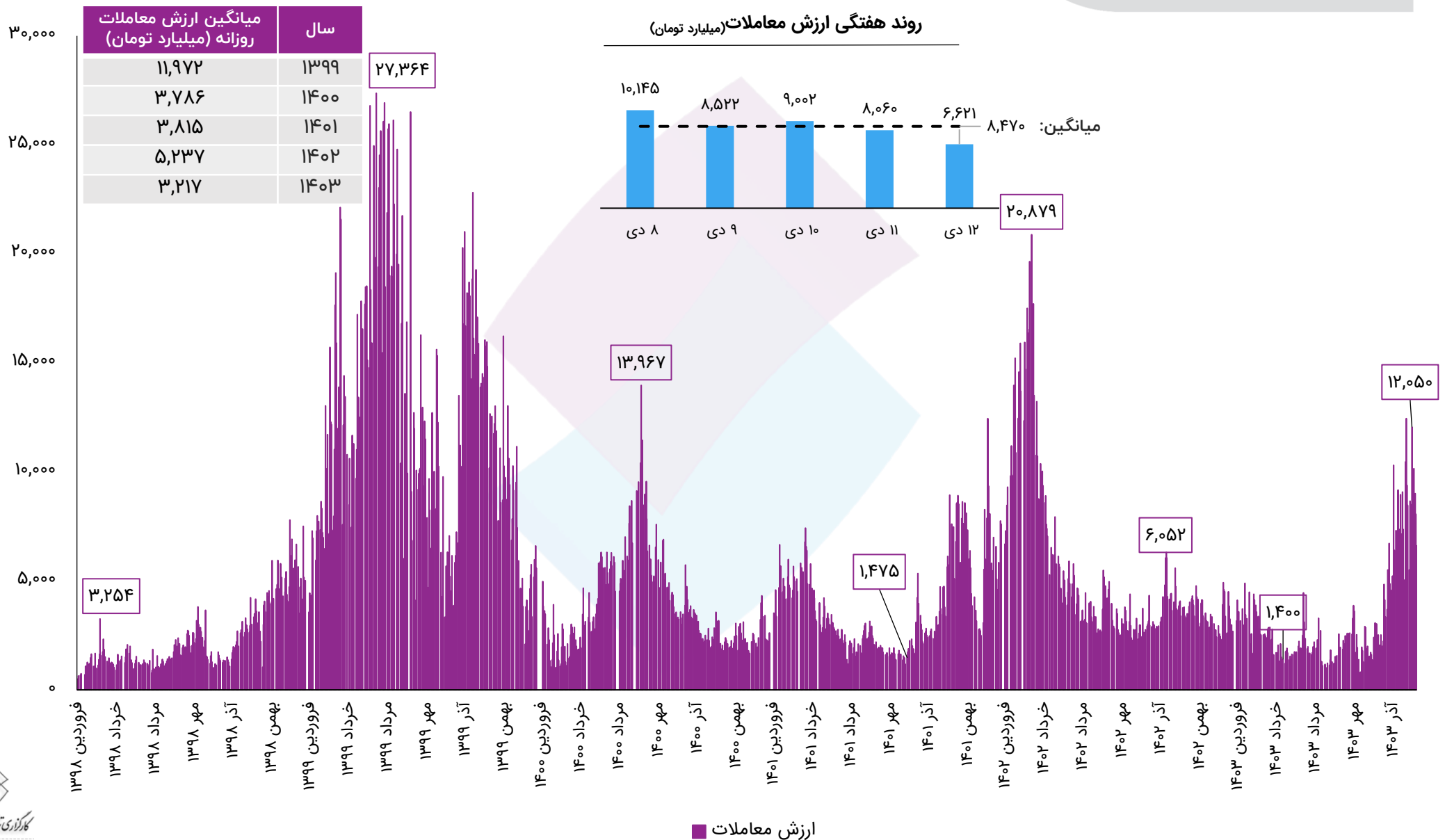
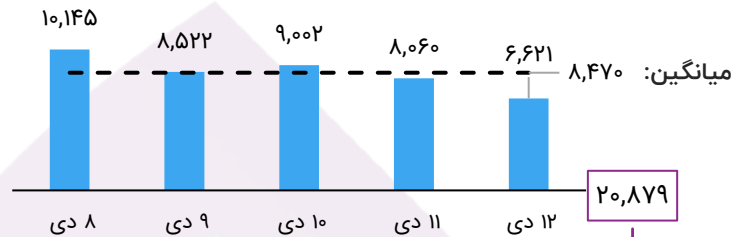
کاهش ۲.۱ درصدی شاخص کل در هفته جاری

رند هفتگی شاخص کل



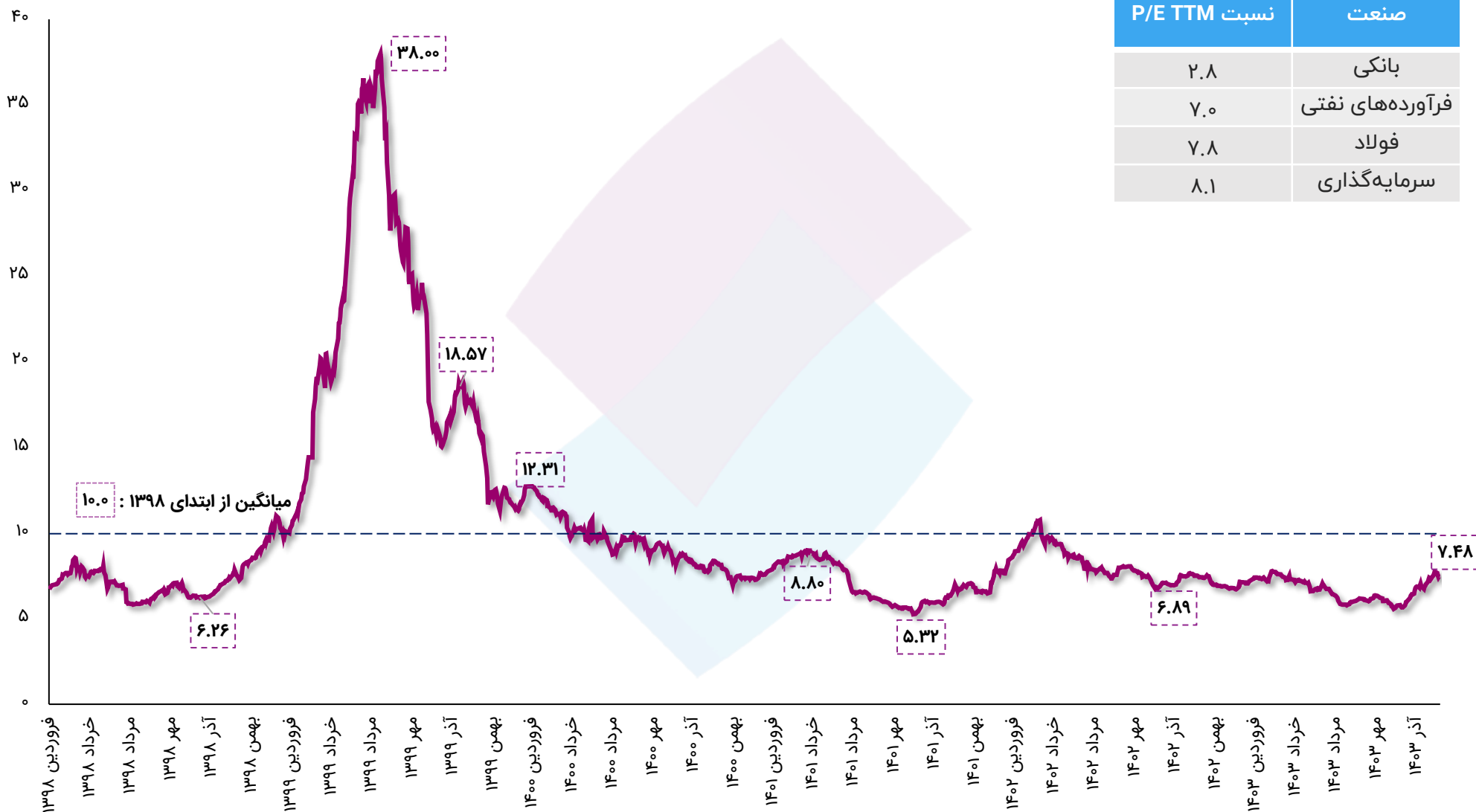
ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

رشد هفتگی ارزش معاملات (میلیارد تومان)



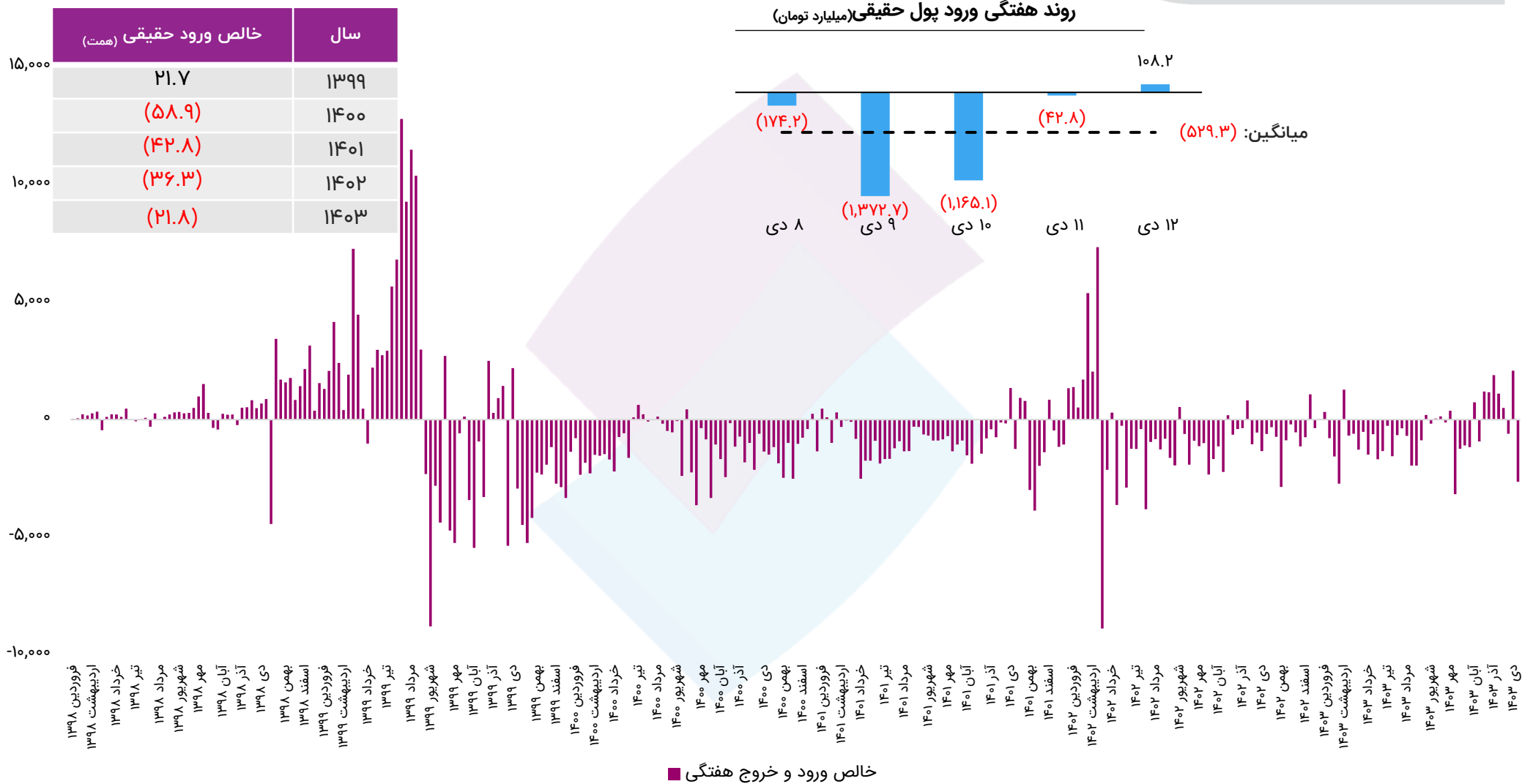
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران

نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۸	بانکی
۷.۰	فرآورده‌های نفتی
۷.۸	فولاد
۸.۱	سرمایه‌گذاری



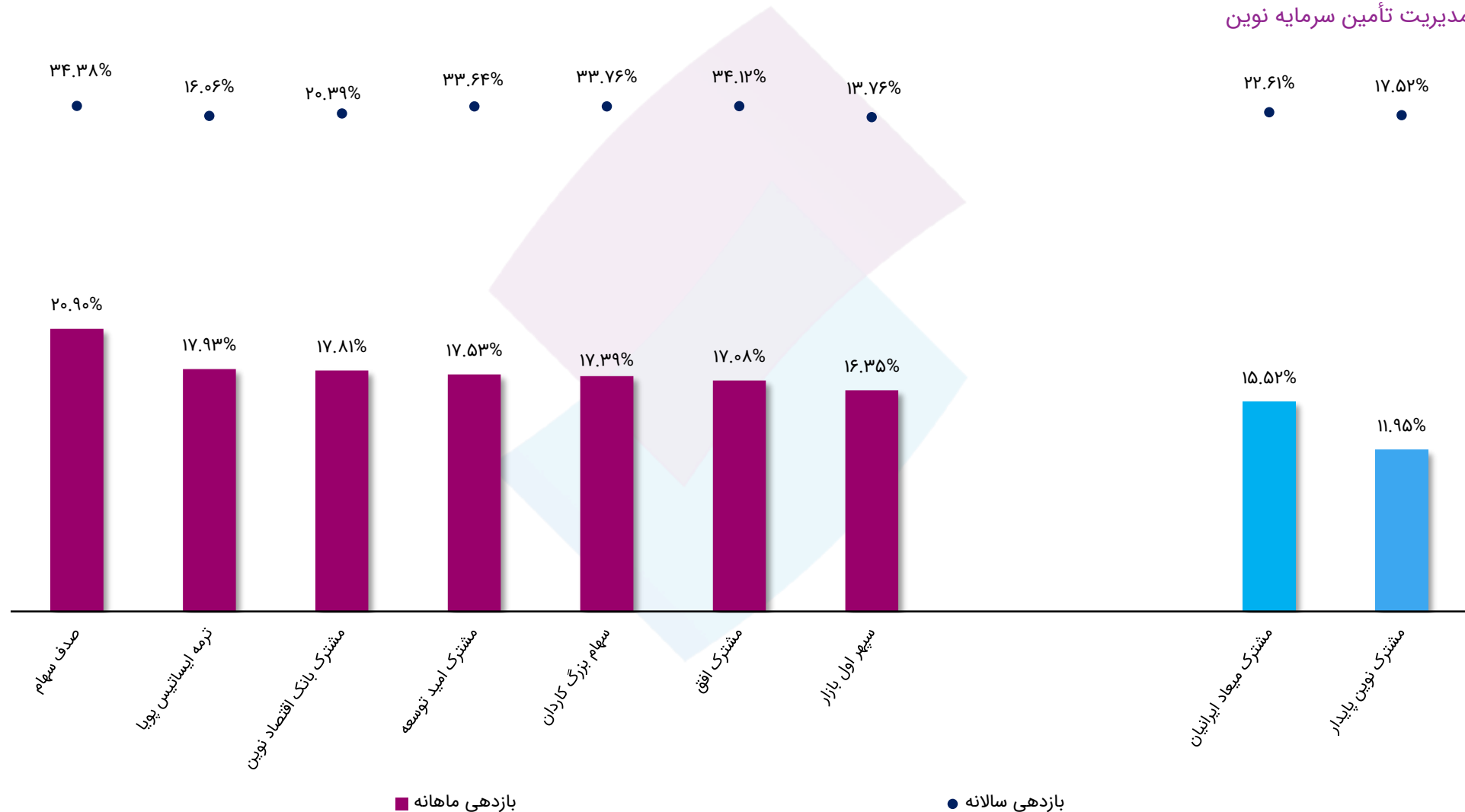
۲,۶۴۶ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با ورود ۲,۰۷۸ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)



صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

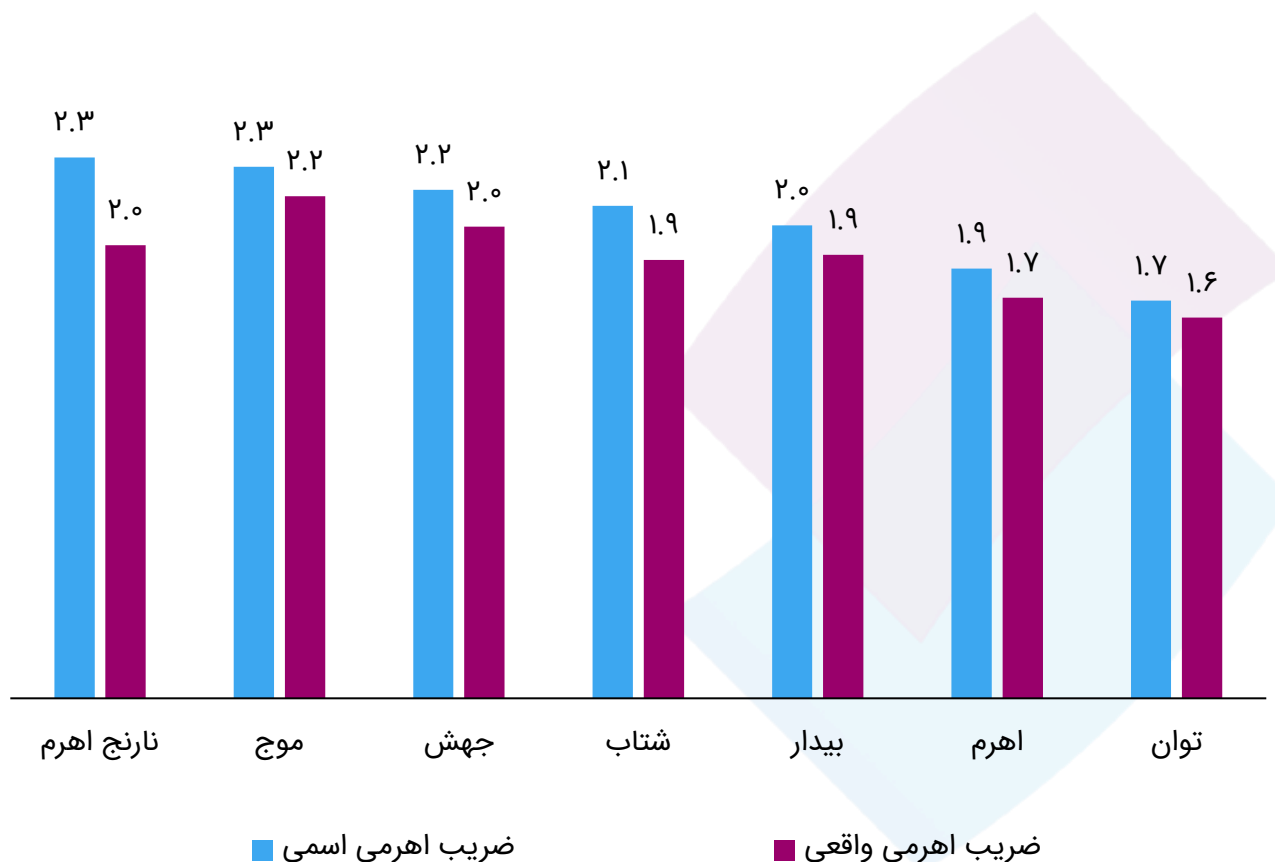
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بازدهی ماهانه

بازدهی سالانه

صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
شتاب	-۶.۳%	۱.۶
توان	-۶.۳%	۱.۶
جهش	-۵.۷%	۱.۸
نارنج اهرم	-۵.۲%	۱.۸
اهرم	-۴.۷%	۱.۷
بیدار	-۴.۳%	۱.۸
موج	-۲.۴%	۱.۷

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۳۵.۰%	۲.۵۴%
نارنج اهرم	۲۸.۳%	۲.۵۴%
جهش	۲۶.۴%	۲.۵۴%
شتاب	۲۶.۳%	۲.۳۷%
بیدار	۲۲.۵%	۲.۵۴%
توان	۲۱.۹%	۲.۲۵%
اهرم	۲۱.۶%	۲.۵۴%

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 ۳ ماهه استفاده شده است.

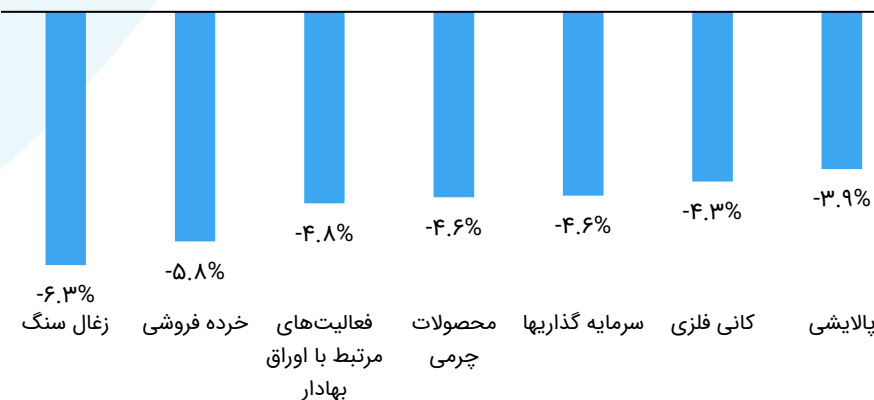
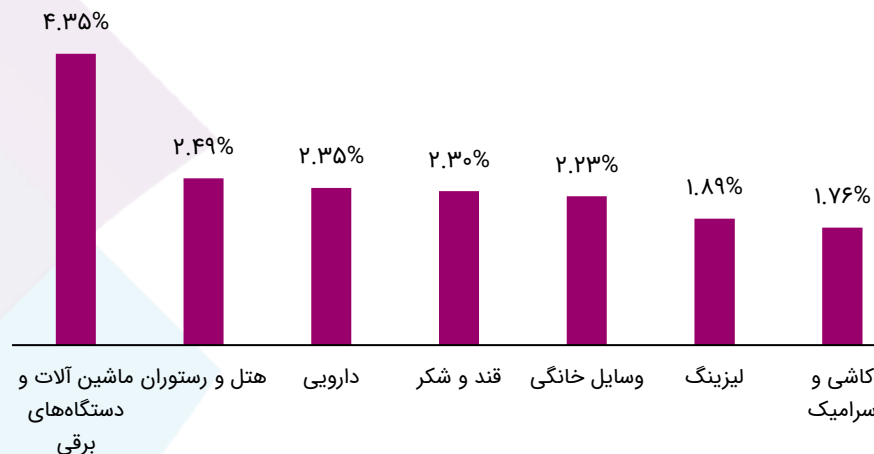
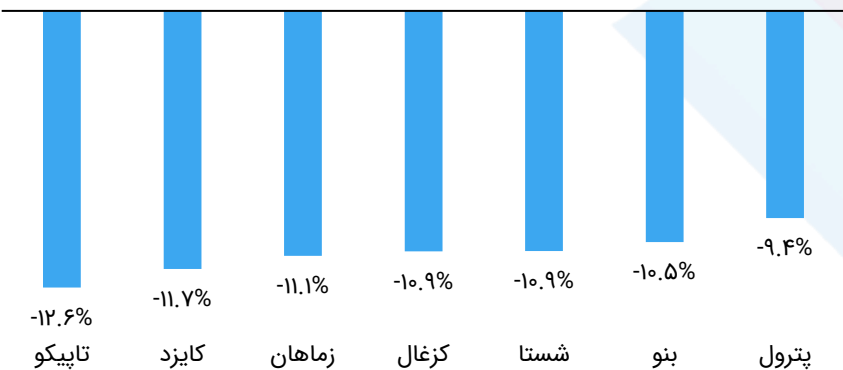
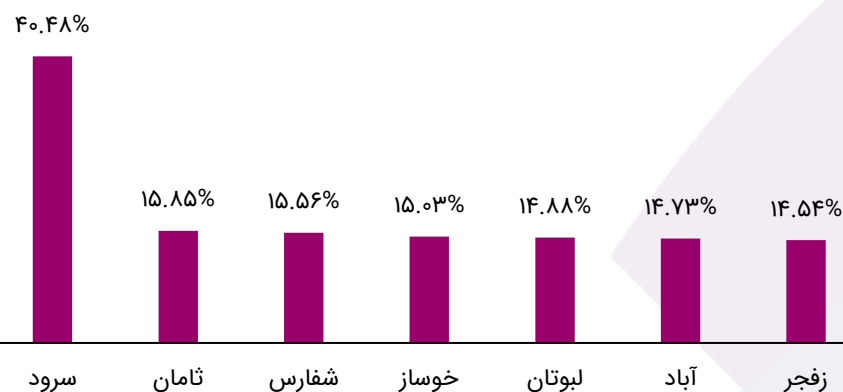
نماد

صنعت



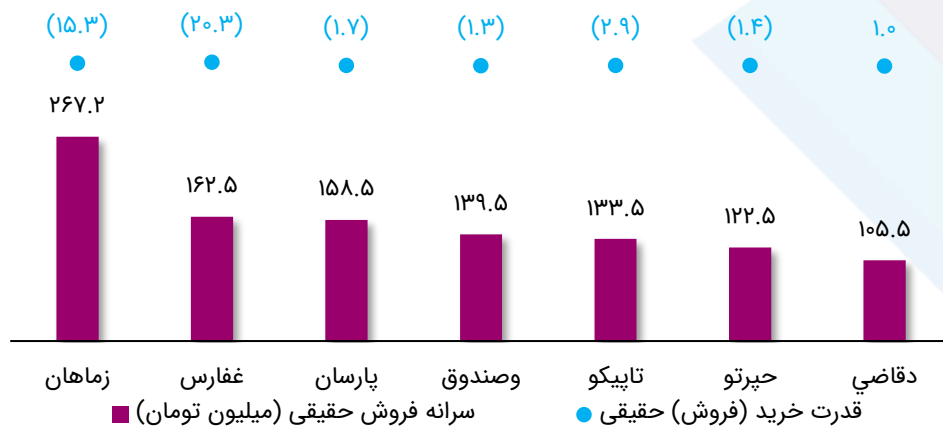
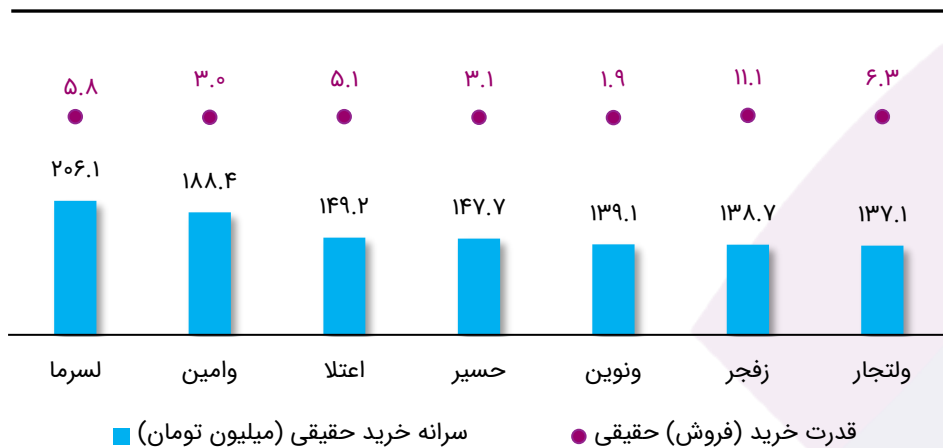
نماد

صنعت

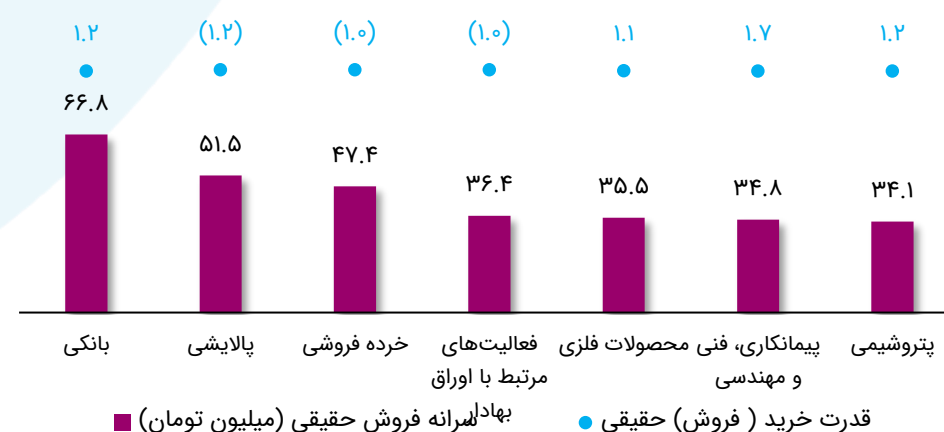
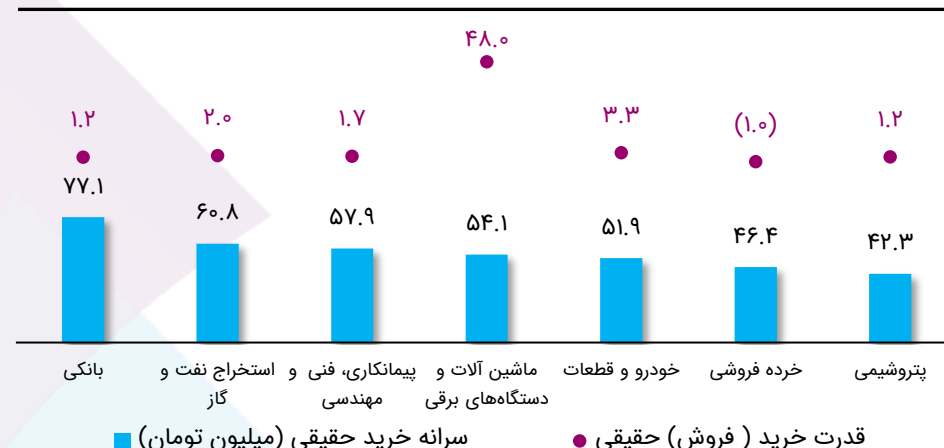


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

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				
تجارت	۳۳,۵۸۸	۱۵۱,۱۸۳	۳۵۰%	سود انباشته تجدید ارزیابی
حسینا	۲۵۰	۸۹۹	۲۶۰%	سود انباشته
سصفها	۲۰۰	۳۰۰	۵۰%	سود انباشته
زکشت	۶۰	۱۵۰	۱۵۰%	سود انباشته
سرچشمه	۱,۱۶۵	۱,۵۰۰	۲۹%	سود انباشته
فتر	۲۵۰	۸۵۰	۲۴۰%	آورده نقدی
وتوشه	۸۵۰	۱,۰۰۰	۱۸%	سود انباشته
رنیک	۳۲۵	۵۶۵	۷۴%	سود انباشته
فارس	۷۵,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰	۳۳%	سود انباشته
غگر	۳۹	۲۶۳	۵۷۴%	تجدید ارزیابی
پیزد	۷۸۹	۹۳۵	۱۹%	سود انباشته
تکنار	۶	۱۲	۱۰۰%	آورده نقدی
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه				
اعتلا	۴۰۰	۵۸۰	۴۵%	آورده نقدی
پاکشو	۴,۸۰۰	۶,۰۰۰	۲۵%	سود انباشته

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
------	-----------------------------	-----------------------------	----------------	-------------------	---------------------

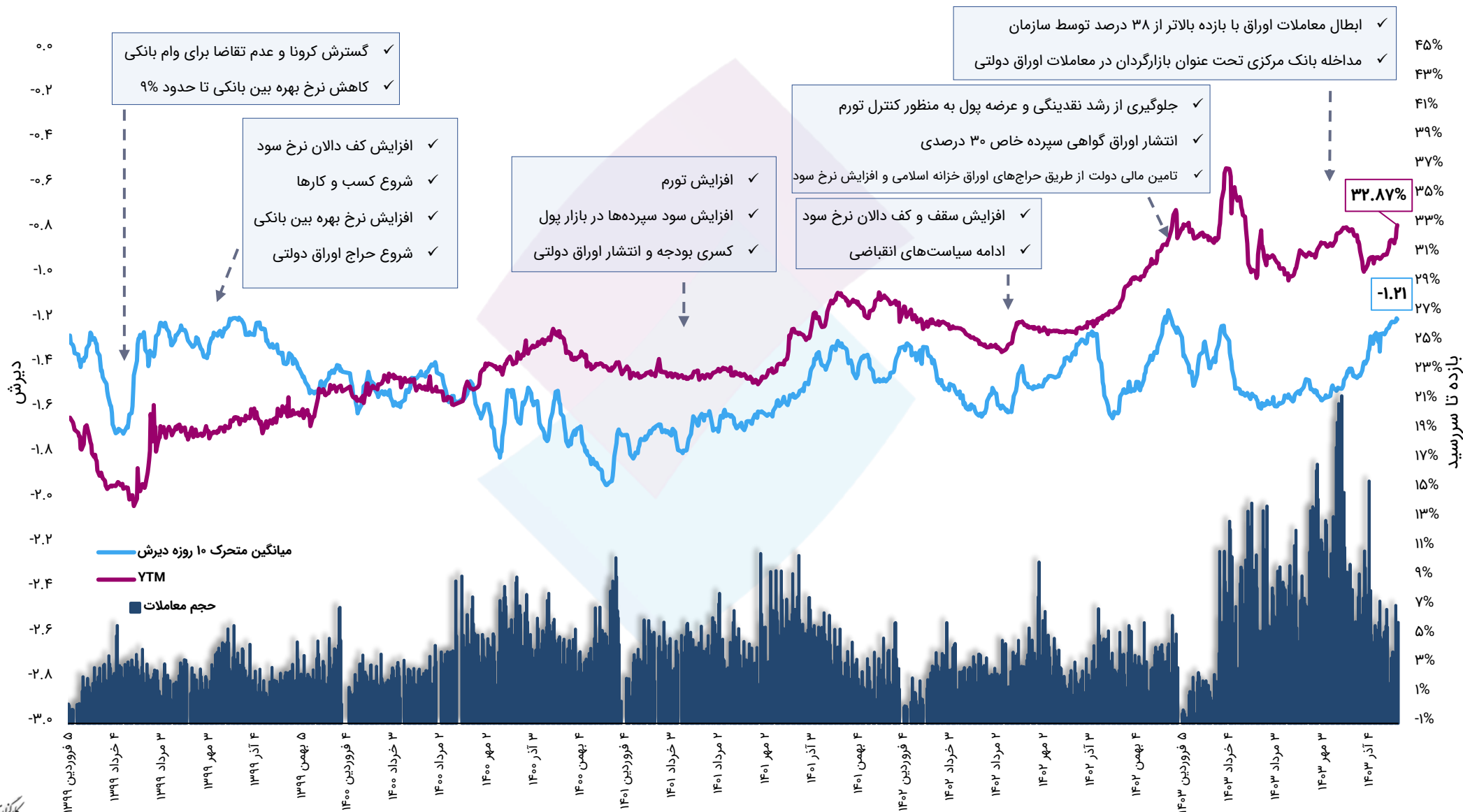
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه

بکابل	۲۰۴	۴۰۹	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار حقوق مالکانه شرکت
خنور	۱۰۰	۲۲۵	۱۲۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، حفظ نقدینگی شرکت و تقویت سرمایه در گردش و استفاده از معافیت های مالیاتی مربوطه
فسازان	۴۰۰	۵۰۰	۲۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، حفظ نقدینگی شرکت و تقویت سرمایه در گردش و استفاده از معافیت های مالیاتی مربوطه
کصدف	۳۶	۱۴۴	۳۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

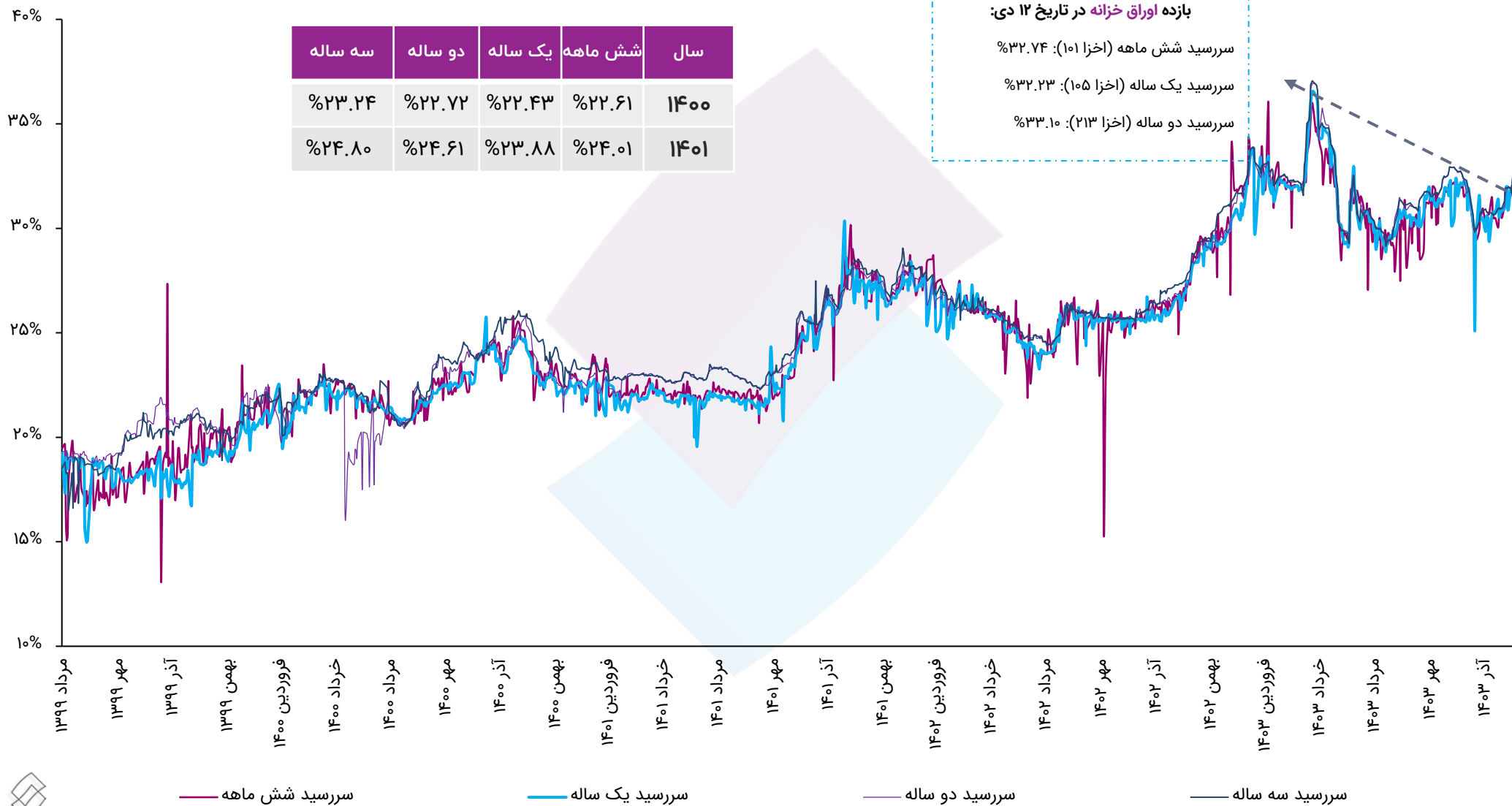
آگهی ثبت افزایش سرمایه

غمایه	۱۳۲	۲۵۷	۹۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
ثمسکن	۶۳۰	۱,۵۸۰	۱۵۱%	سایر اندوخته ها (۹۱%) سود انباشته (۹%)	مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر و جبران مخارج سرمایه ای انجام شده
فسوز	۶۰	۲۴۰	۳۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
وگردش	۱,۵۰۰	۳,۰۰۰	۱۰۰%	سود انباشته (۳۳%) آورده نقدی (۶۶%)	بهبود نسبت کفایت سرمایه
کرازلی	۳,۲۵۰	۳,۸۵۰	۱۸%	آورده نقدی با سلب حق تقدم	قویت بنیه مالی شرکت و جذب نقدینگی جهت تکمیل تأمین مخارج پروژه ۴۲۰ تنی
ثالوند	۸۰	۲۳۰	۱۸۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
خکار	۵۰۰	۸۰۰	۶۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
دالبر	۹۵۰	۱,۲۰۰	۲۶%	سود انباشته	تکمیل پروژه ها و توسعه تاسیسات و اصلاح ساختار مالی

افزایش ۱.۰۱ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۸۷ درصد

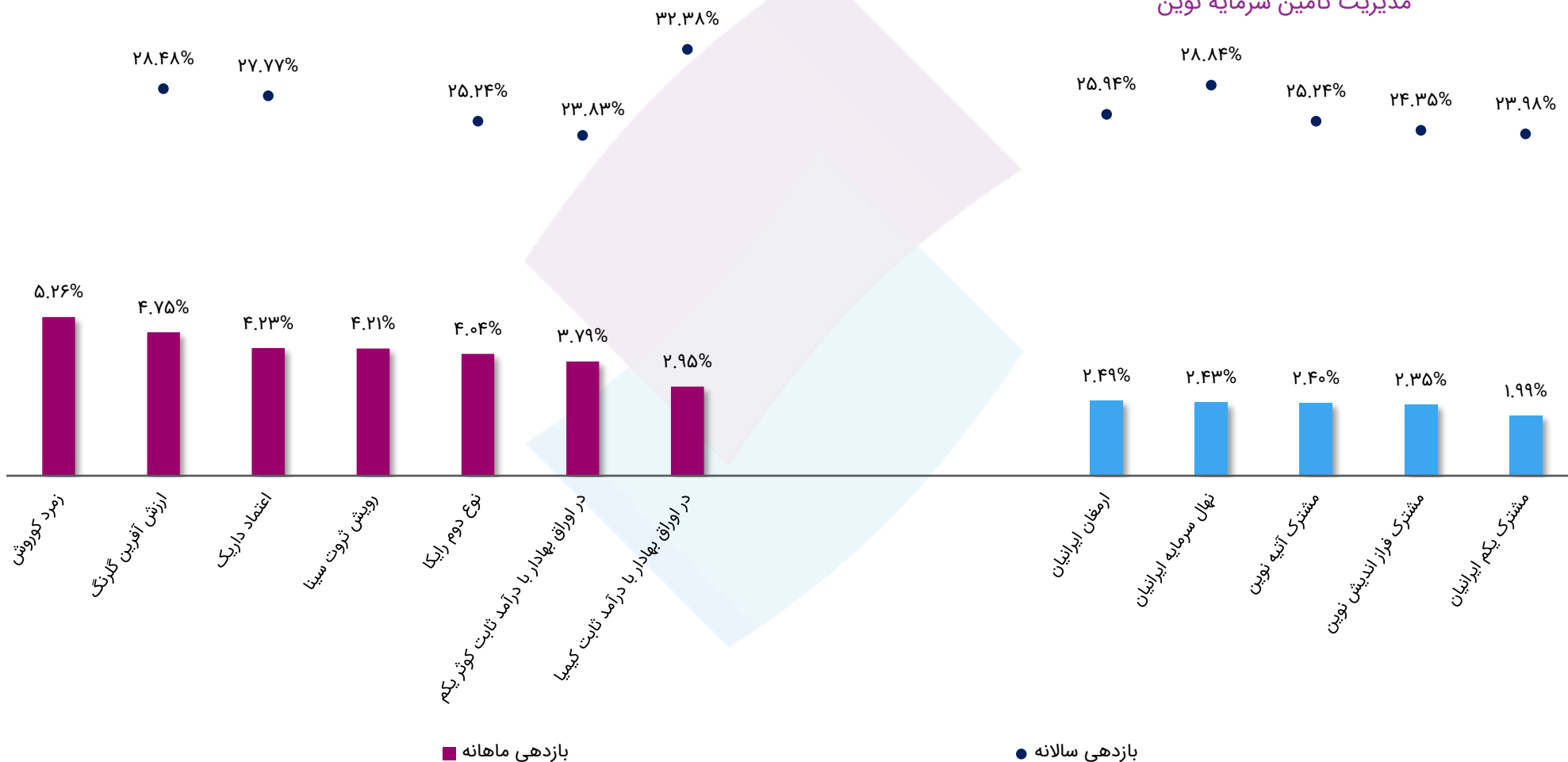


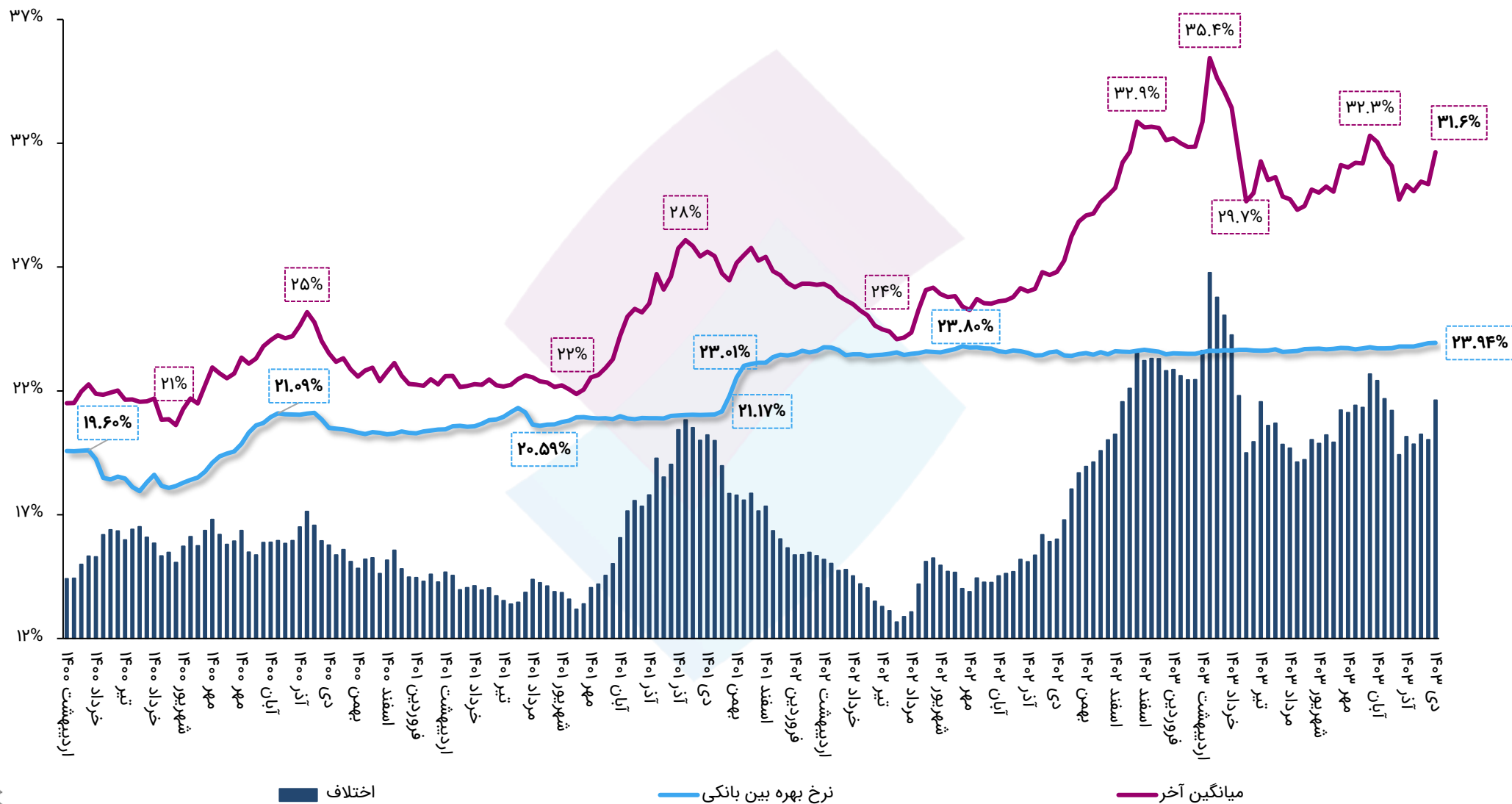
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

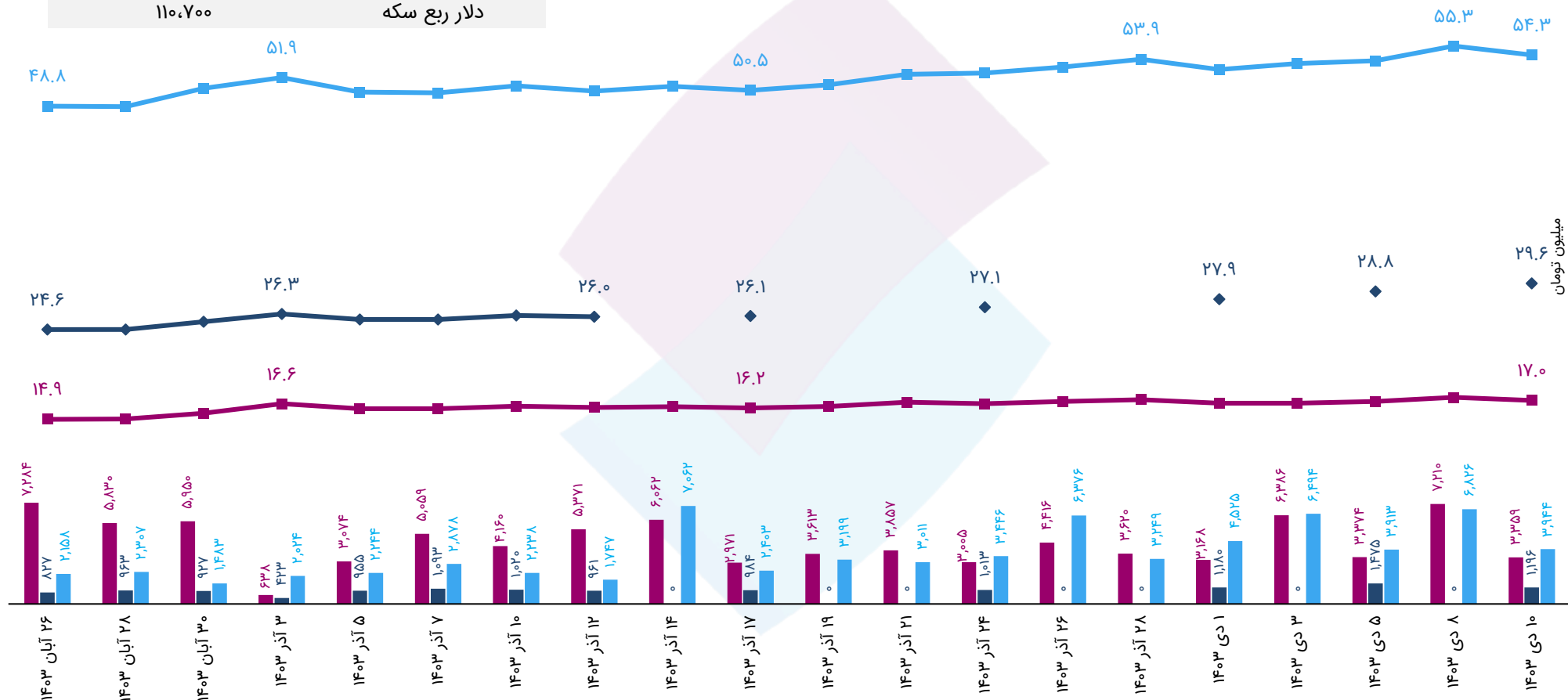
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین





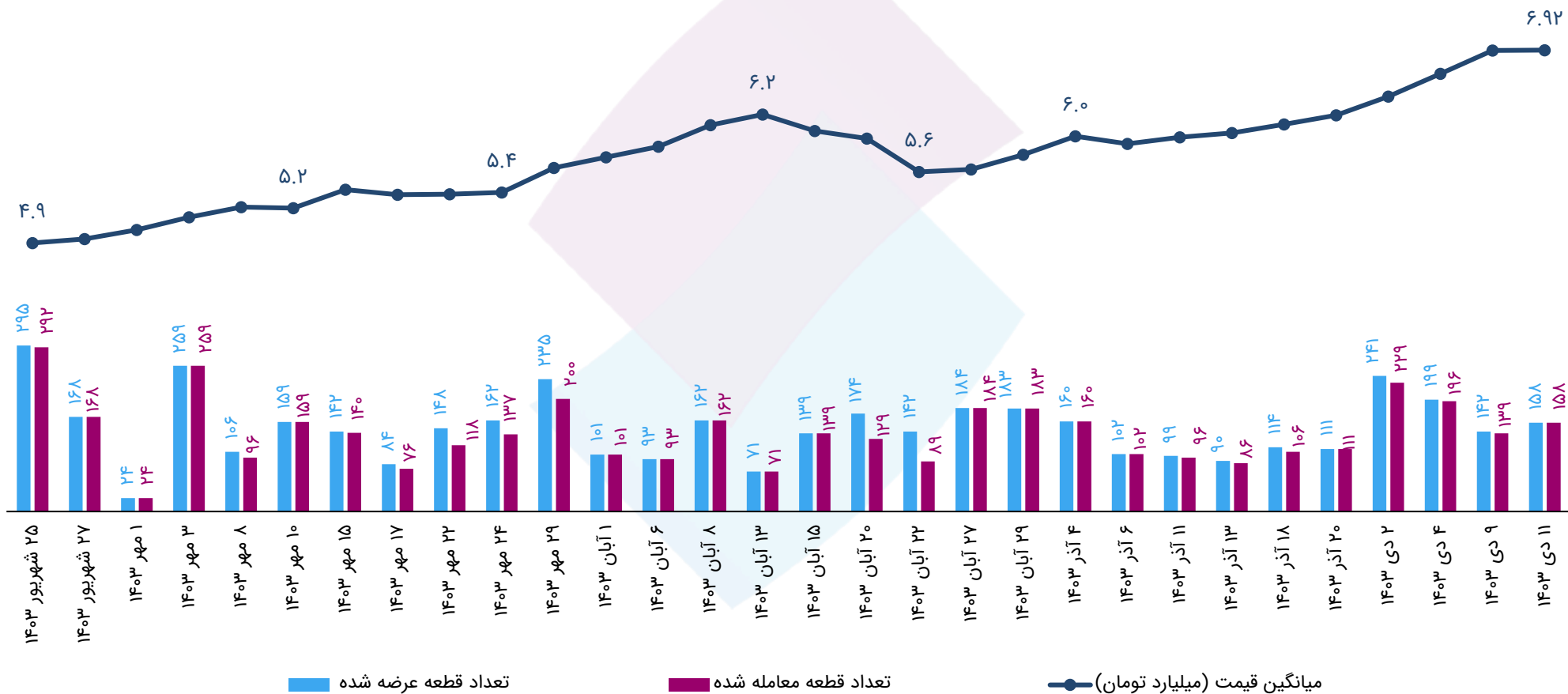
معامله ۶۴۱ هزار و ۳۳۷ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۶۶,۶۹۲	
دلار سکه تمام	۸۸,۴۰۰	
دلار نیم سکه	۹۶,۴۰۰	
دلار ربع سکه	۱۱۰,۷۰۰	



معامله ۱۳ هزار و ۷۴۹ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۶۶،۹۶۱	
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۸۲،۰۰۰	



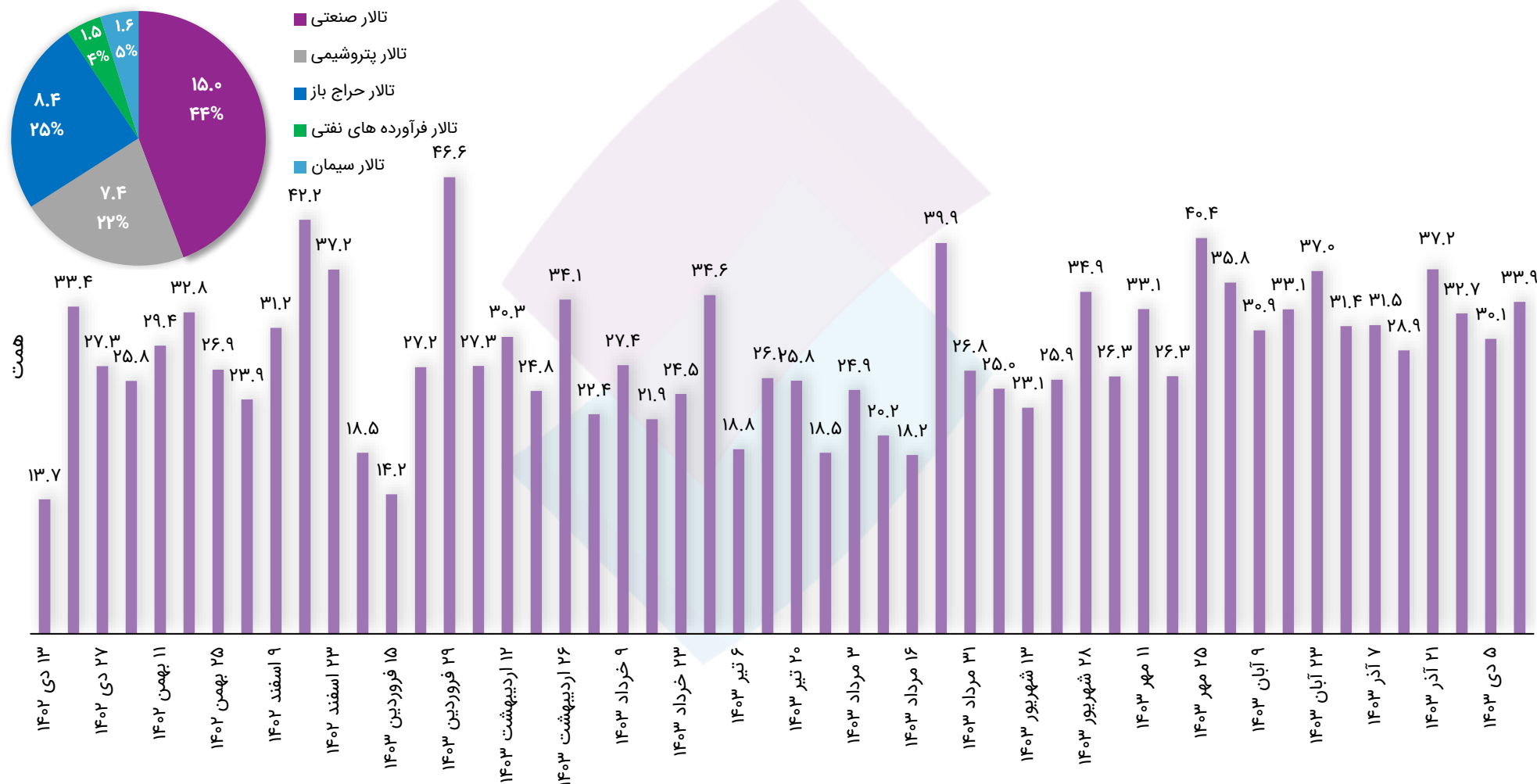
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۲۷.۴%	۲,۰۶۱	-۰.۶%	۲,۶۴۲	۰.۳%	۲,۶۱۷	۲,۶۲۵	طلا (دلار/انس)
۸۹.۸%	۲۹۸,۹۶۰	۹.۹%	۵۱۶,۲۵۰	۲.۷%	۵۵۲,۴۰۰	۵۶۷,۴۵۰	سکه (هزار ریال)
۵۷.۱%	۴۲۹,۳۱۷	۲۵.۴%	۵۳۷,۹۳۳	۲.۰%	۶۶۱,۴۱۸	۶۷۴,۳۲۰	دلار اسکناس (ریال)
۶۷.۵%	۳۹۱,۶۸۲	۲۵.۴%	۵۲۳,۲۸۱	۲.۰%	۶۴۳,۴۰۳	۶۵۵,۹۵۳	دلار حواله (ریال)
-۱.۶%	۷۶	۴.۰%	۷۲	۱.۶%	۷۴	۷۵	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۰۷.۱%	۴۴,۹۵۸	-۲.۹%	۹۵,۸۶۵	-۶.۲%	۹۹,۲۹۹	۹۳,۰۹۳	بیت کوین (دلار)
۳.۳%	۸,۴۲۶	-۱.۹%	۸,۸۷۰	-۱.۶%	۸,۸۴۷	۸,۷۰۵	مس LME (دلار/تن)
۱۴.۱%	۲,۶۰۷	-۳.۶%	۳,۰۸۵	-۱.۶%	۳,۰۲۲	۲,۹۷۴	روی LME (دلار/تن)
-۱۱.۴%	۵۰۰	-۳.۲%	۴۵۸	۰.۰%	۴۴۳	۴۴۳	بیلت CIS (دلار/تن)
۱.۸%	۴۴۰	۱.۸%	۴۴۰	-۱.۶%	۴۵۵	۴۴۸	بیلت ایران (دلار/تن)
۹.۷%	۲۷۷	۳.۸%	۲۹۳	۰.۰%	۳۰۴	۳۰۴	متانول CFR (\$/mt)
۱۲.۰%	۳۱۲	۶.۳%	۳۲۹	۰.۰%	۳۵۰	۳۵۰	سبذ اوره (mt/\$)
۴۲.۲%	۲.۵۶	۱۹.۳%	۳.۰۵	۲۳.۰%	۲.۹۶	۳.۶۴	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

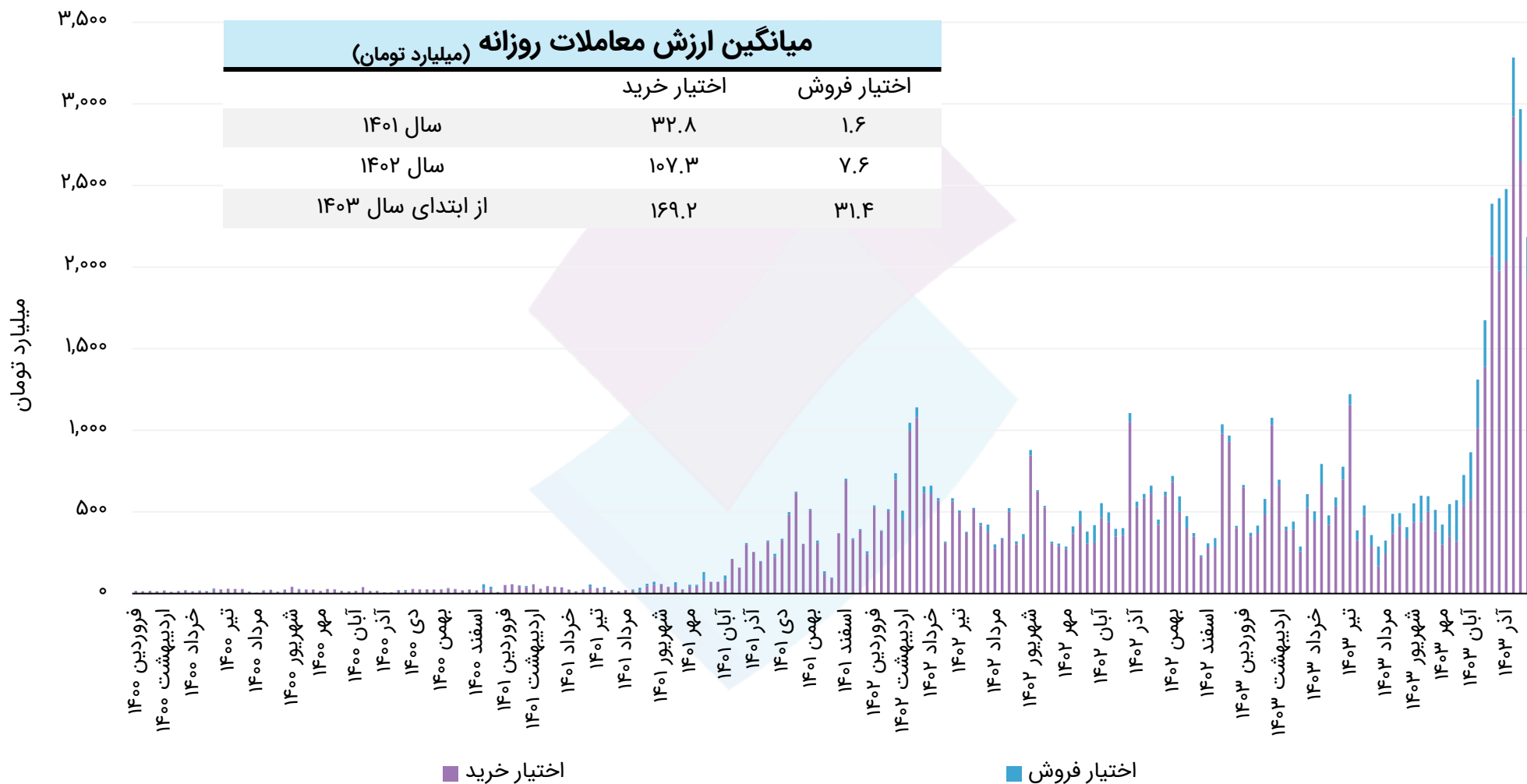


ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

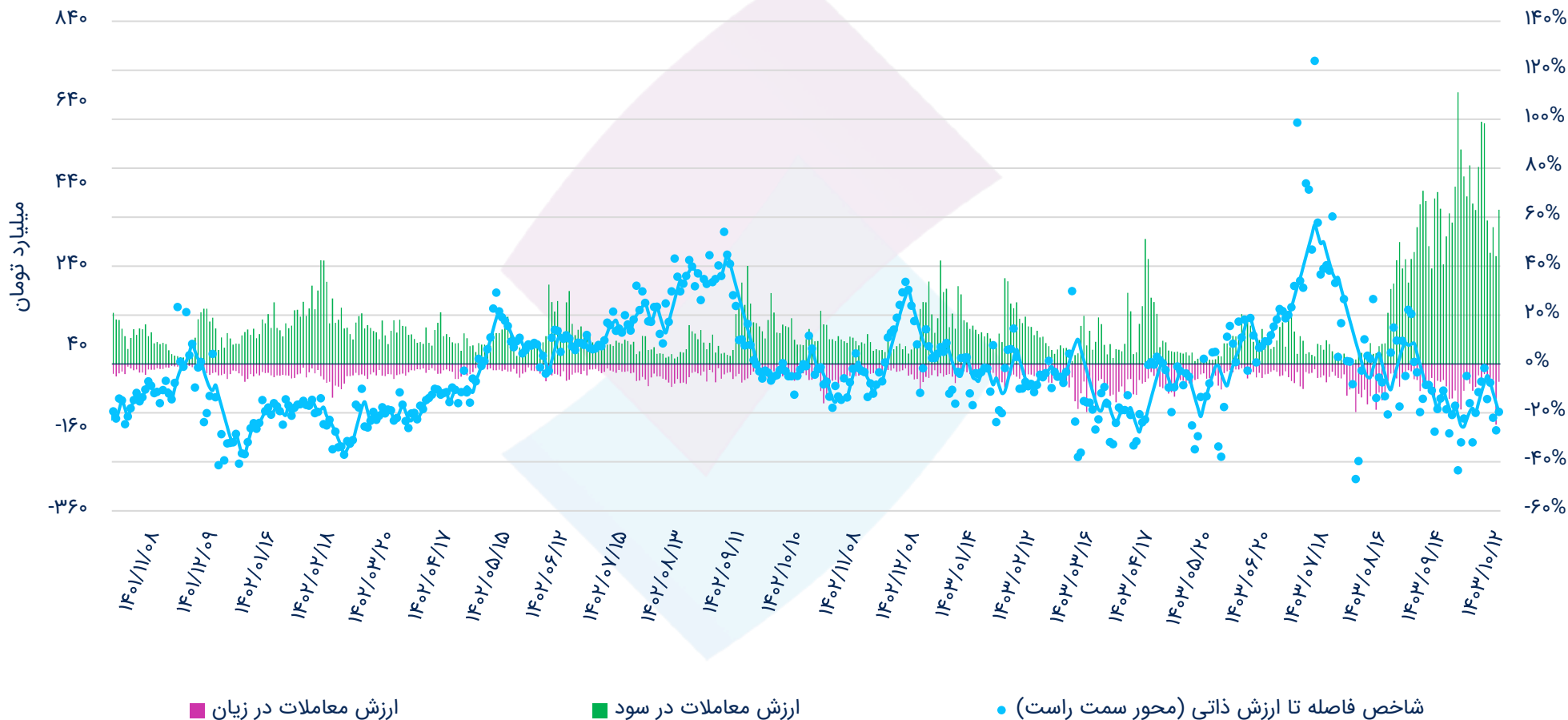
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۵	۶۳,۰۰۰	آهن و فولاد ارفع، پارس فولاد سبزواری، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر
پلی اتیلن ترفتالات	۶۲.۸	۱۲,۷۶۰	پتروشیمی تندگویان
پلی پروپیلن نساجی	۶۹.۳	۱۱,۸۷۴	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۵	۱,۱۰۴,۰۸۷	بین المللی 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
شمش آلومینیوم	۱۹۹.۸	۵,۱۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۵.۳	۱۳۷,۲۰۰	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، فولاد کاوه جنوب کیش، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، تولید فولاد تارا شمش یزد، فولاد کویر دامغان، ذوب و نورد زرغام
کنسانتره سنگ آهن	۳.۹	۲۸۰,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان، صبا نور ایرانیان
گندله سنگ آهن	۵.۶	۳۲۰,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، صنعتی و معدنی اپال پارسیان سنگان، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان
لوب کات	۲۵.۸	۴۱,۰۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس کاتد	۵۸۵.۲	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۲۹.۰	۳۵,۳۲۵	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد سپهر ایرانیان، فولاد شاهرود، مجتمع فولاد خراسان، فولاد کاوه اروند، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب، فولاد آذربایجان، ذوب آهن آرمان آسیا، فولاد آلیاژی ایران، فولاد روینا جنوب، تات فولاد تاکستان
ورق گالوانیزه	۴۶.۱	۱۸,۷۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تاراز چهارمحال، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، گروه صنعتی دانیال استیل، مجتمع فولادی روی اندودکاوه
وکیوم باتوم	۲۴.۵	۱۳۲,۰۰۰	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
ورق سرد	۴۰.۵	۵۸,۵۵۰	فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
تختال	۲۷.۱	۳۱,۷۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

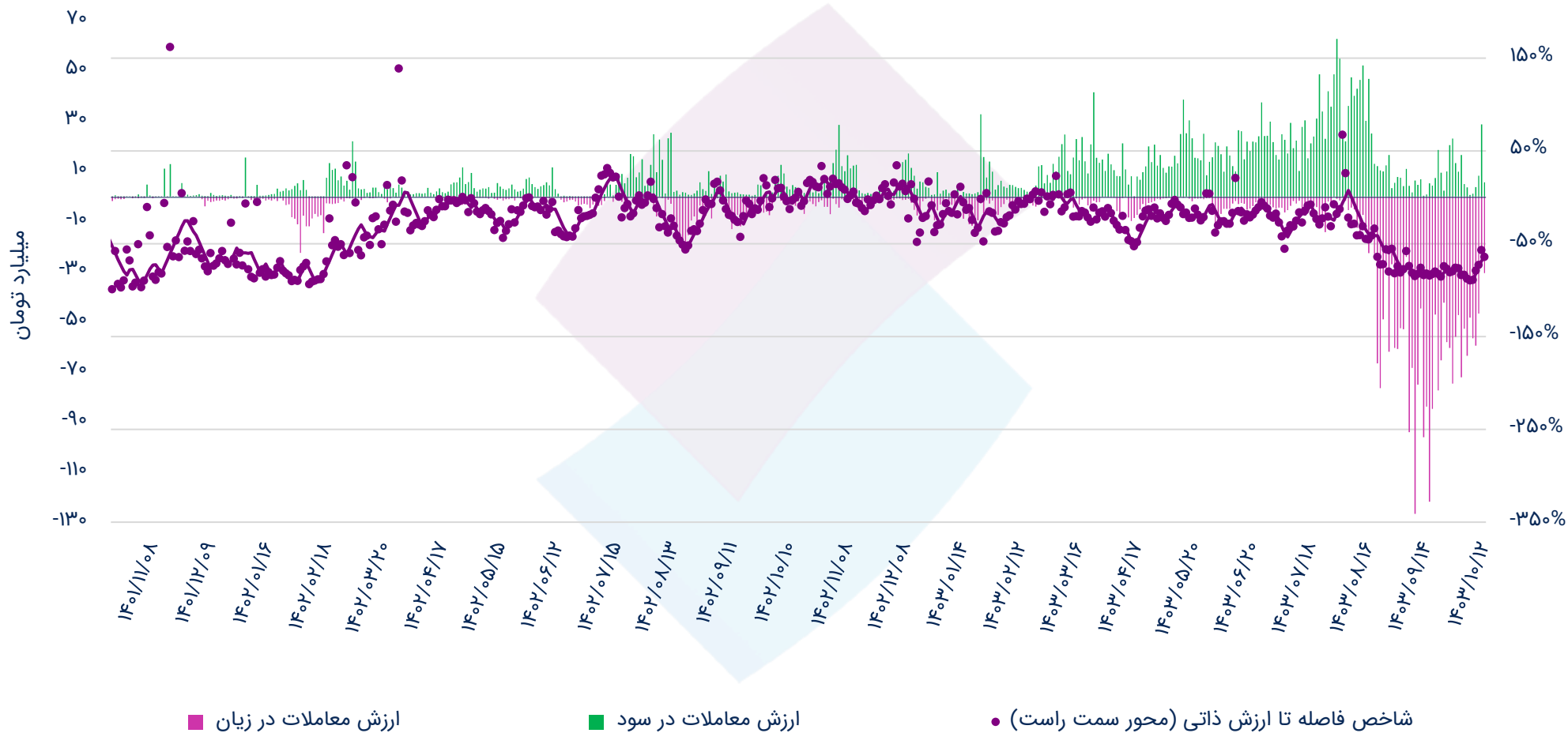


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

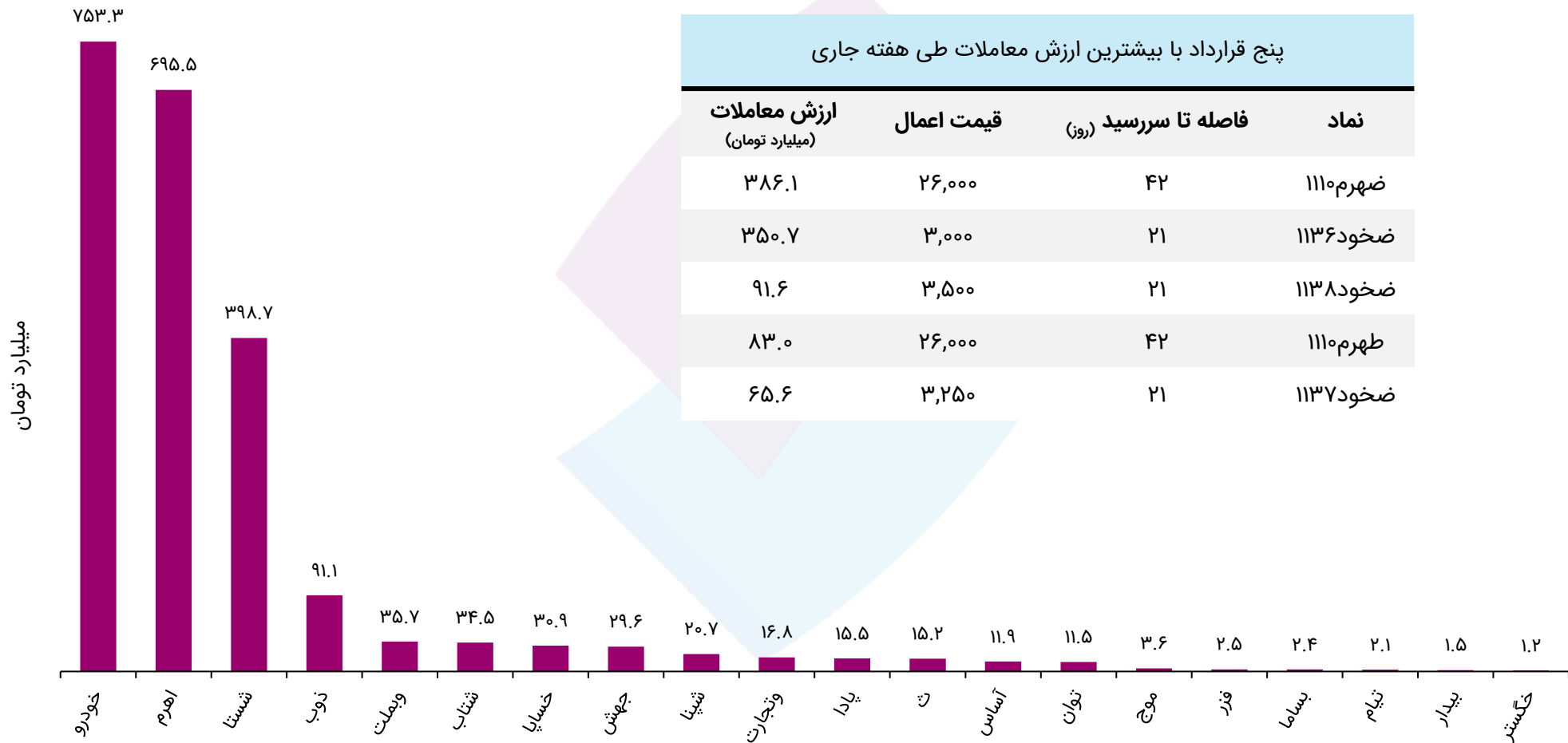
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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)
ضهرم ۱۱۱۰	۴۲	۲۶,۰۰۰	۳۸۶.۱
ضخود ۱۱۳۶	۲۱	۳,۰۰۰	۳۵۰.۷
ضخود ۱۱۳۸	۲۱	۳,۵۰۰	۹۱.۶
طهرم ۱۱۱۰	۴۲	۲۶,۰۰۰	۸۳.۰
ضخود ۱۱۳۷	۲۱	۳,۲۵۰	۶۵.۶

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)