

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 ۱۹ دی - شماره ۱۸۴

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



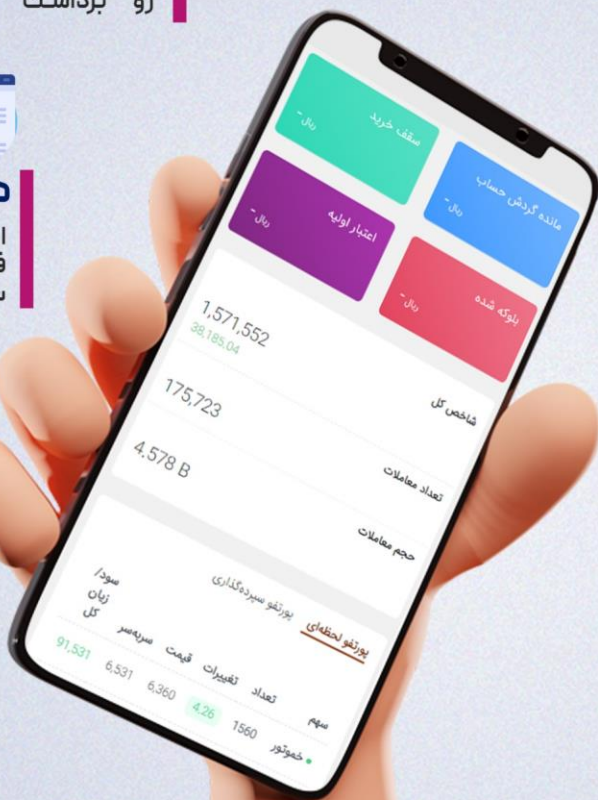
برداشت وجه آتی

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

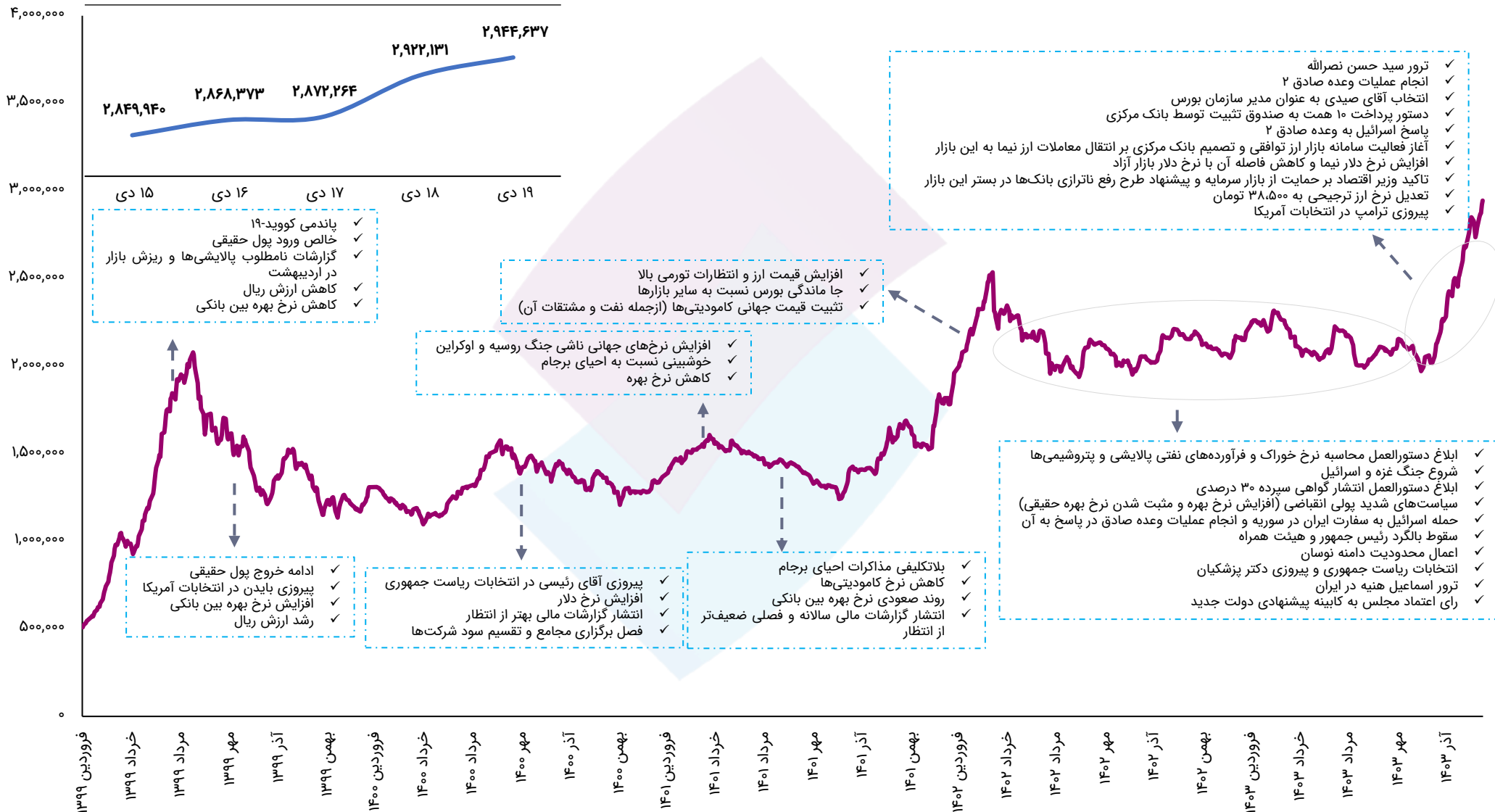
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



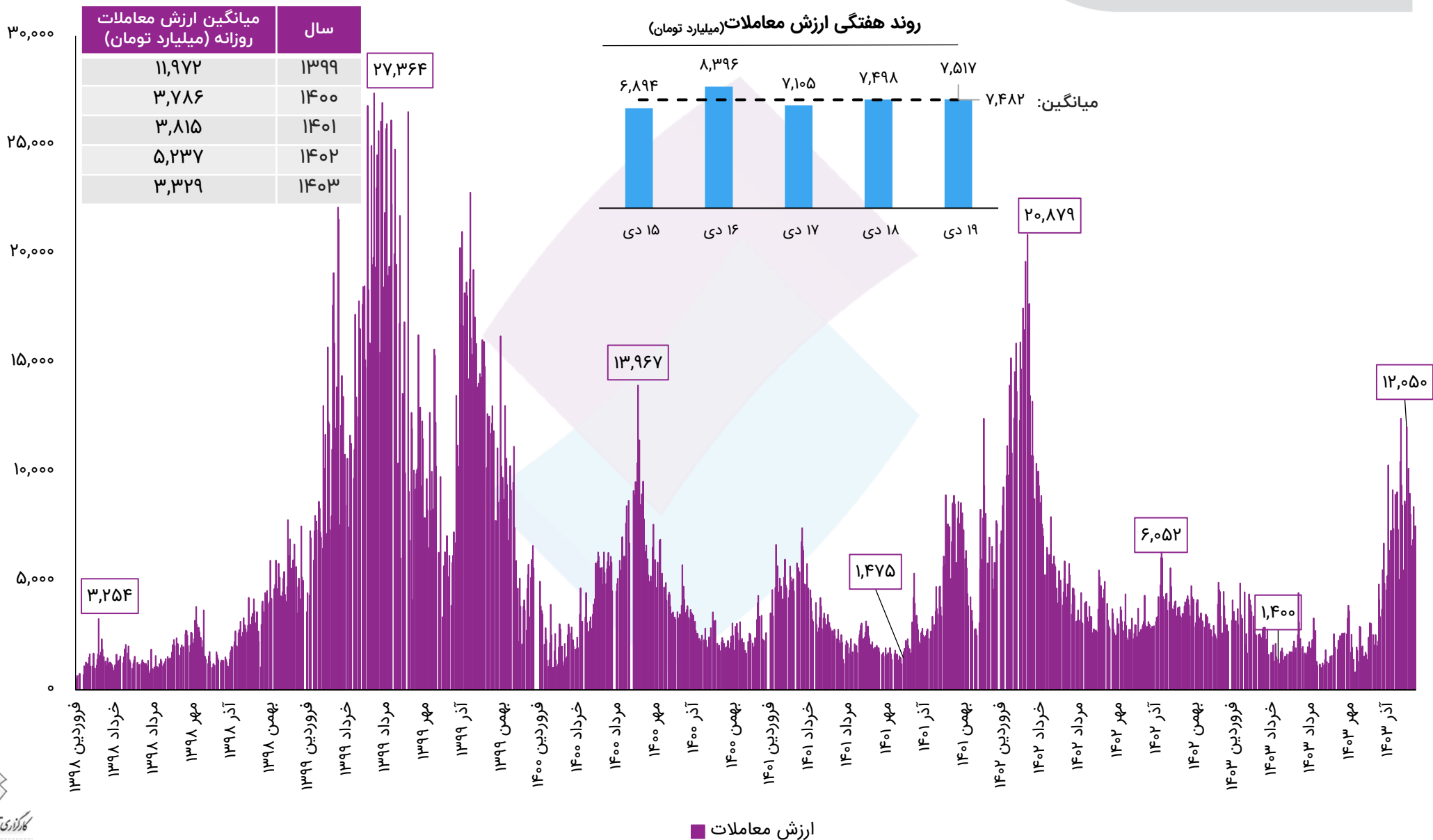
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

رشد ۵.۶ درصدی شاخص کل در هفته جاری

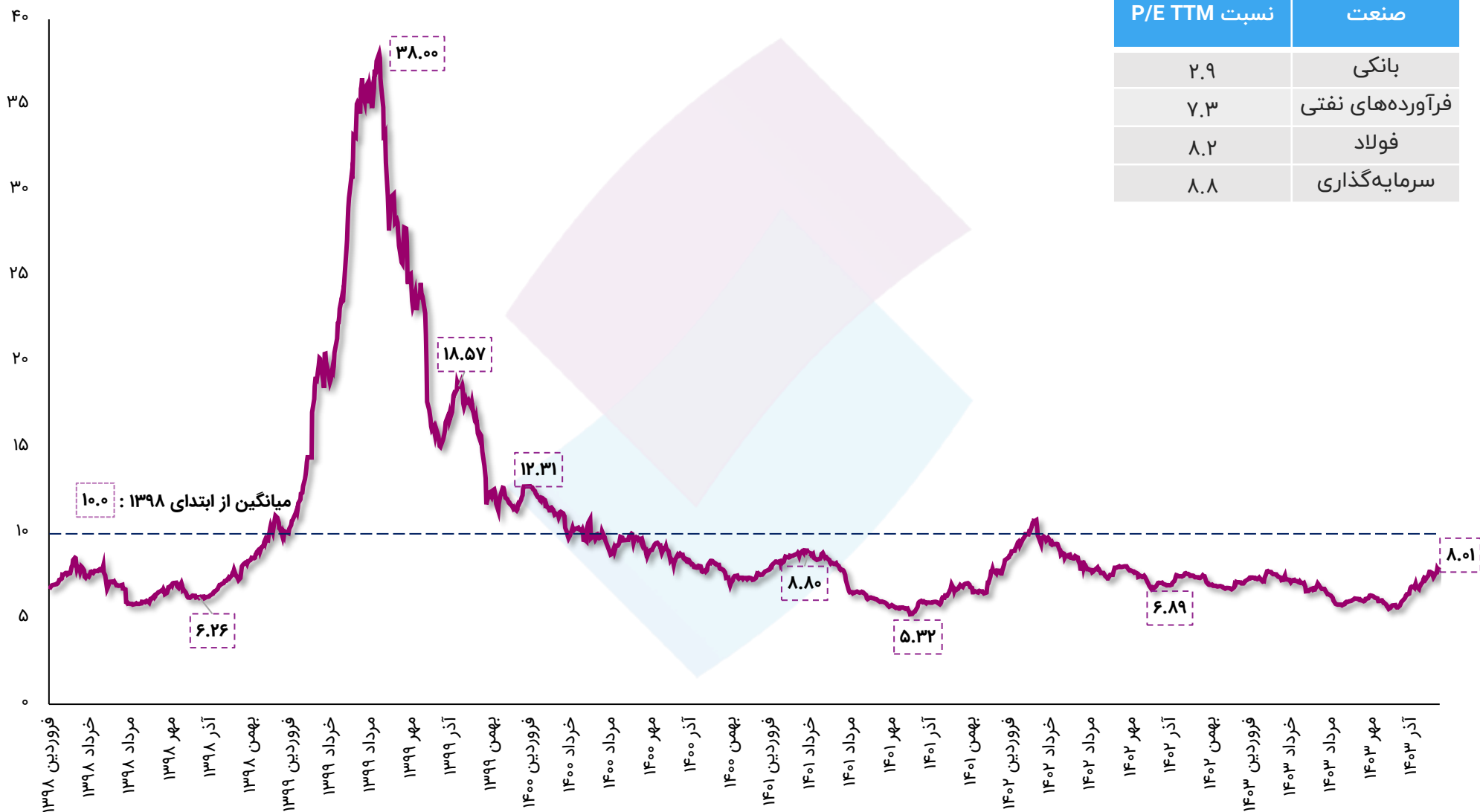
رشد هفتگی شاخص کل



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



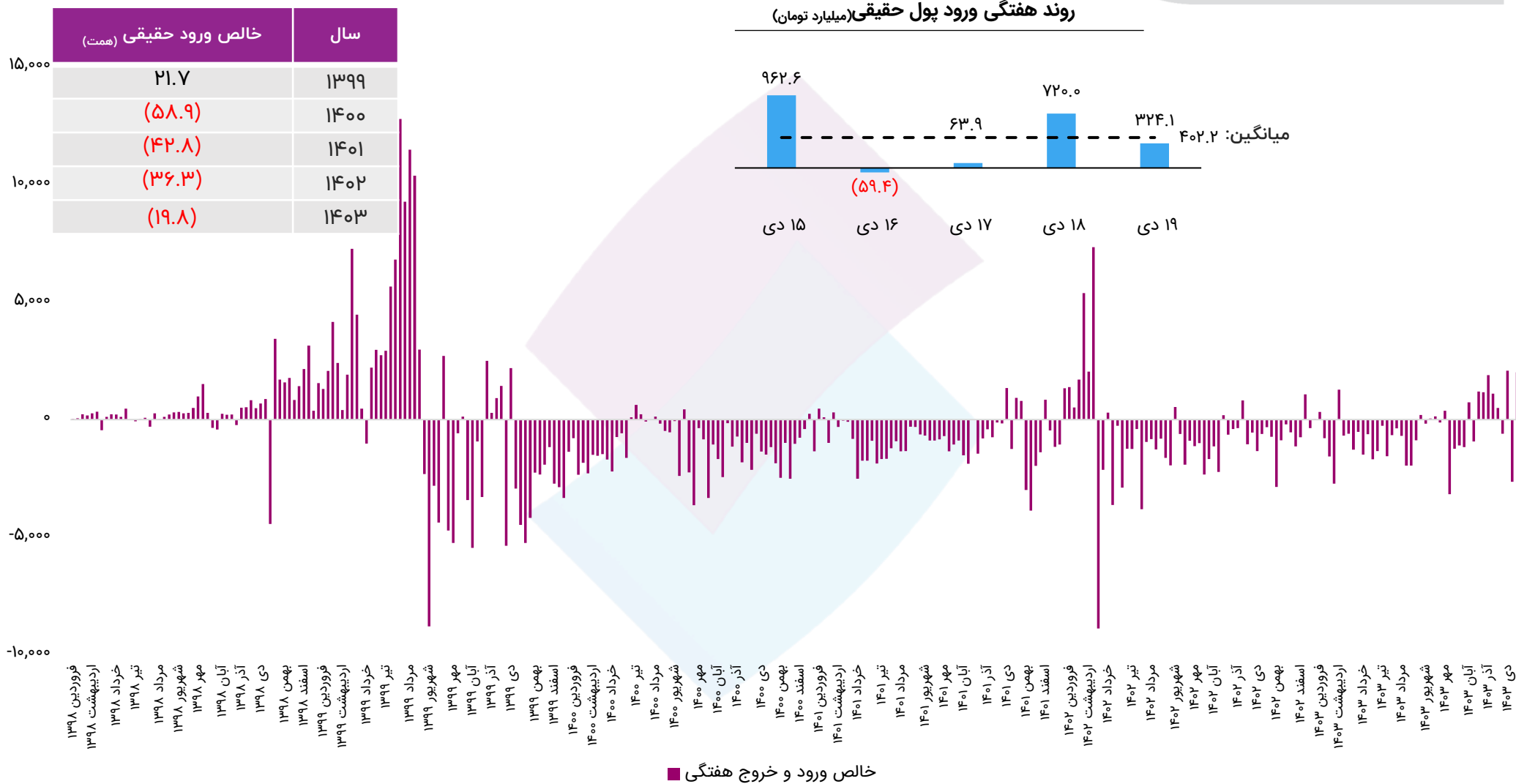
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۹	بانکی
۷.۳	فرآورده‌های نفتی
۸.۲	فولاد
۸.۸	سرمایه‌گذاری

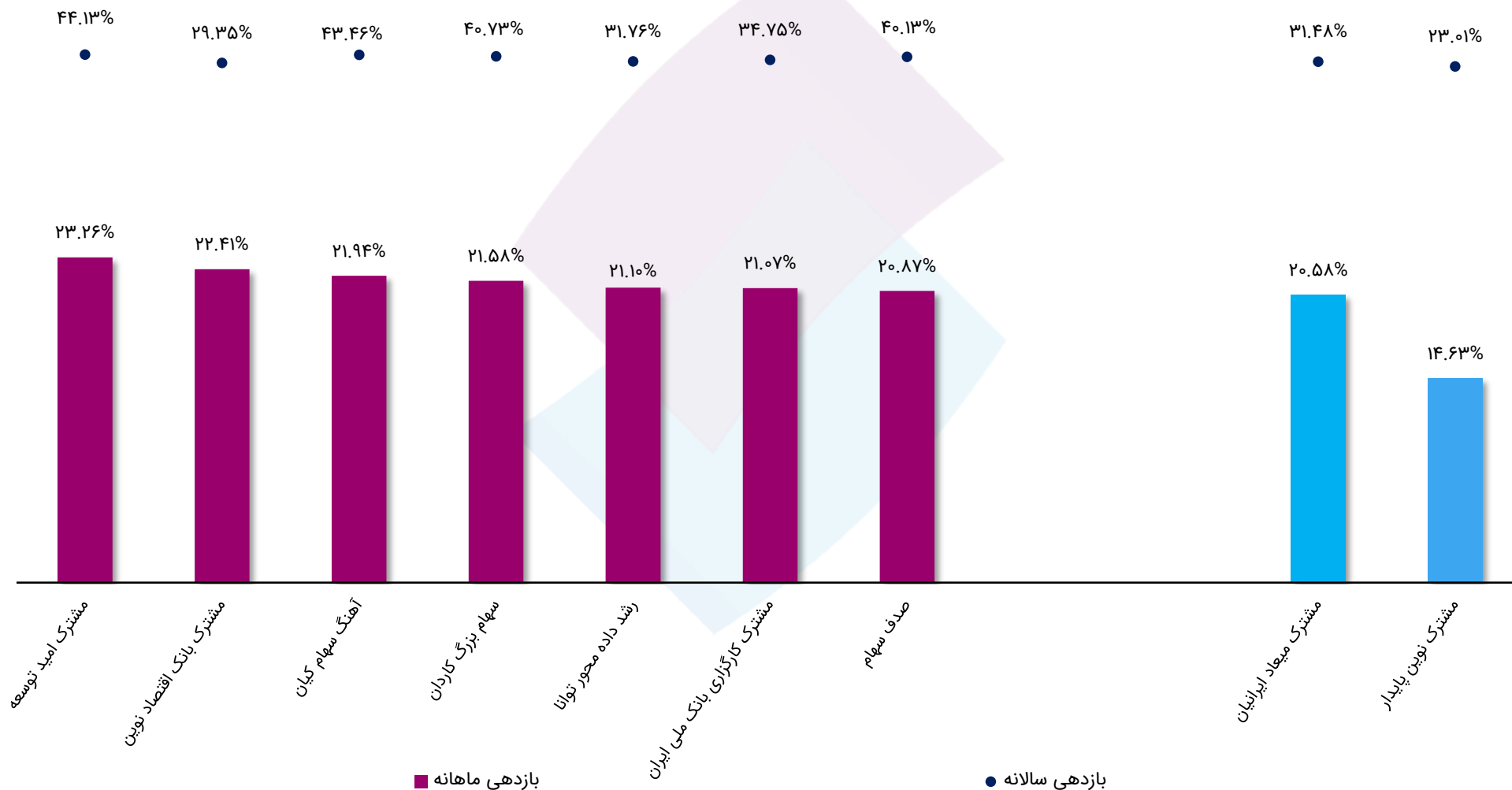
۲,۰۱۱ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۲,۶۴۶ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)

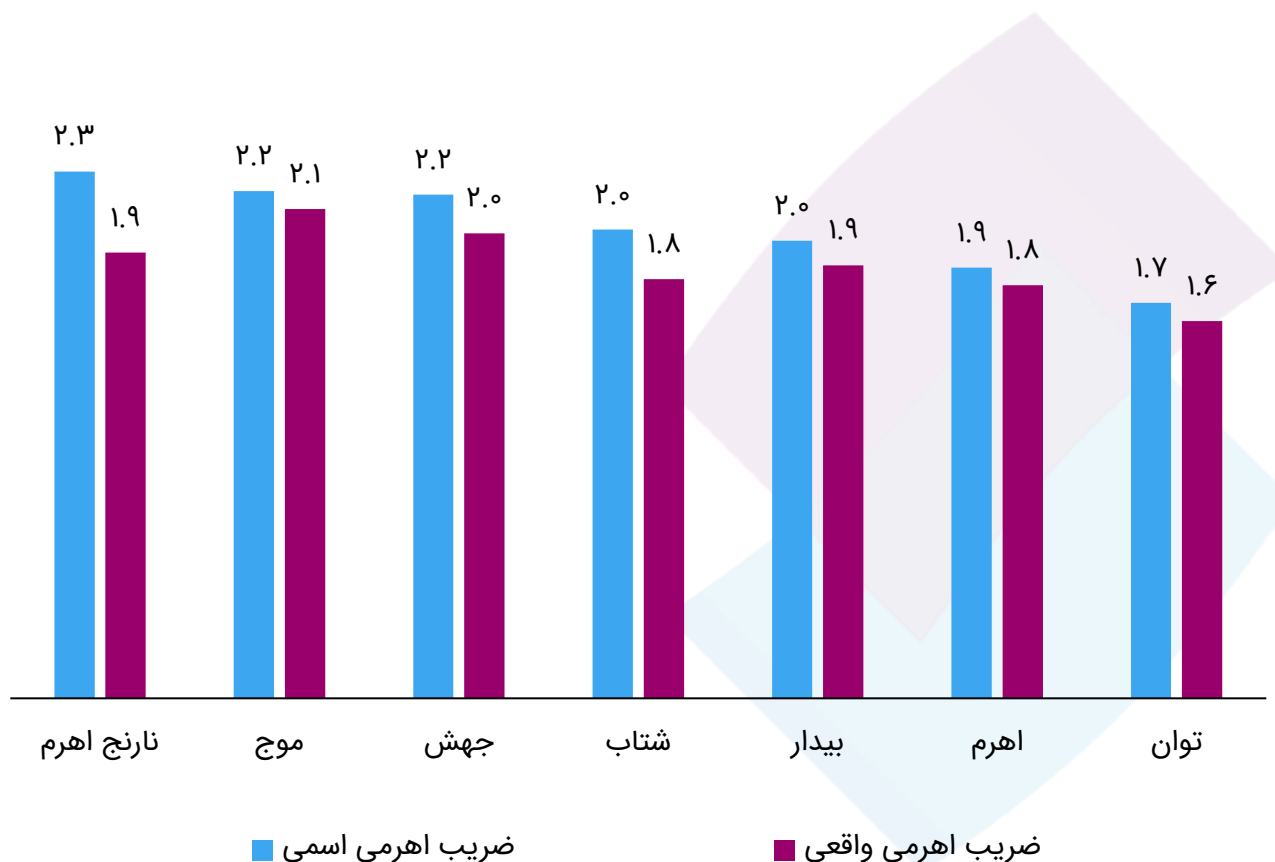


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
جهش	-۴.۷%	۱.۷
نارنج اهرم	-۴.۵%	۱.۷
توان	-۳.۷%	۱.۵
بیدار	-۳.۷%	۱.۷
شتاب	-۳.۶%	۱.۶
اهرم	-۱.۸%	۱.۷
موج	۲.۱%	۱.۶

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۴۶.۷%	۲.۵۴%
شتاب	۳۶.۴%	۲.۳۸%
نارنج اهرم	۳۴.۰%	۲.۵۵%
جهش	۳۰.۶%	۲.۵۴%
توان	۲۷.۴%	۲.۲۵%
اهرم	۲۴.۹%	۲.۵۴%
بیدار	۲۳.۷%	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

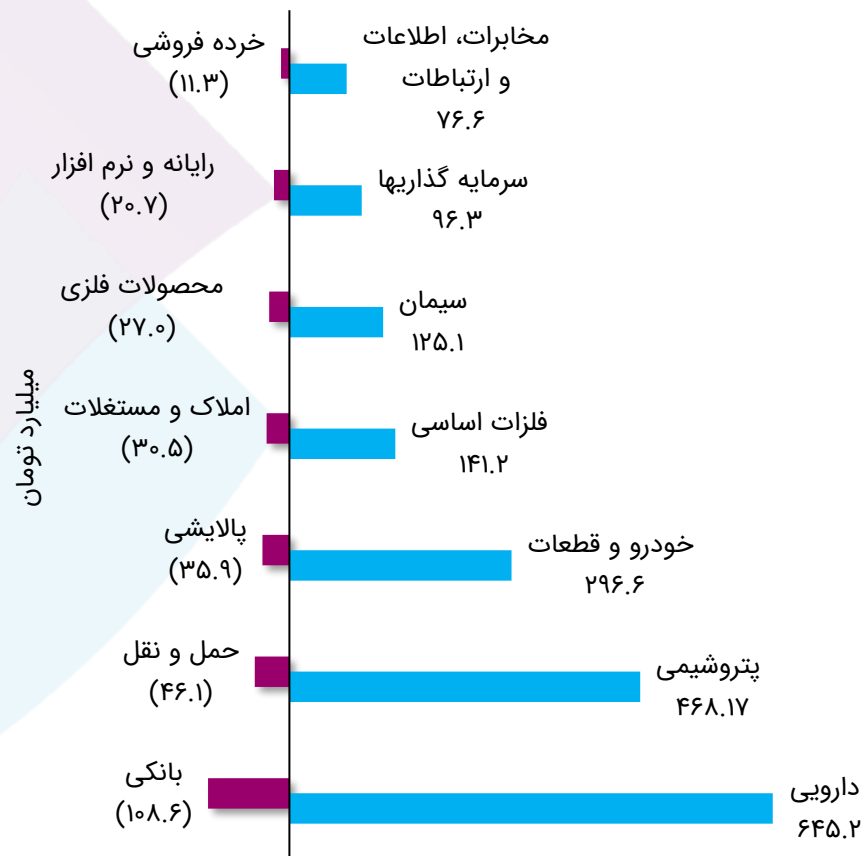
ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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.

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

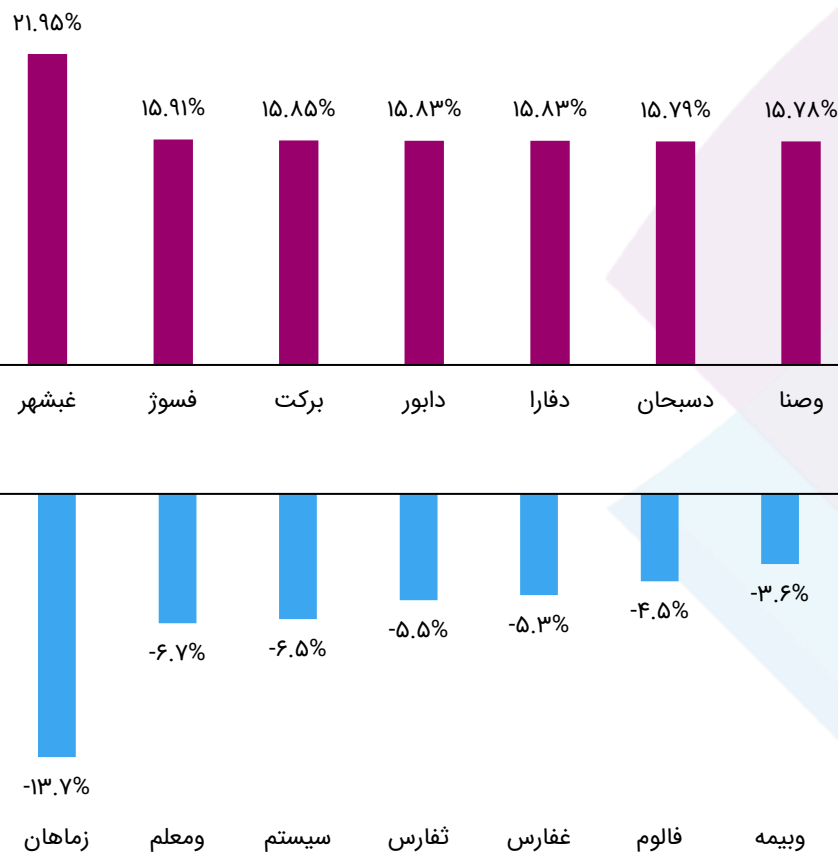
صنعت



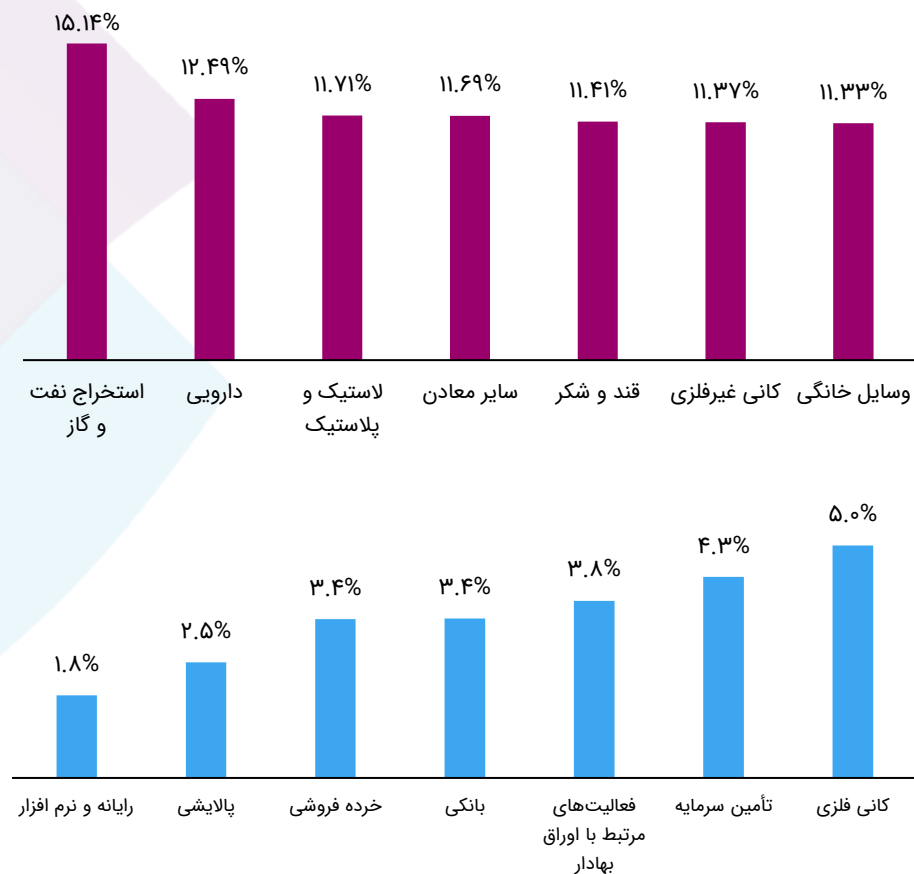
نماد



نماد

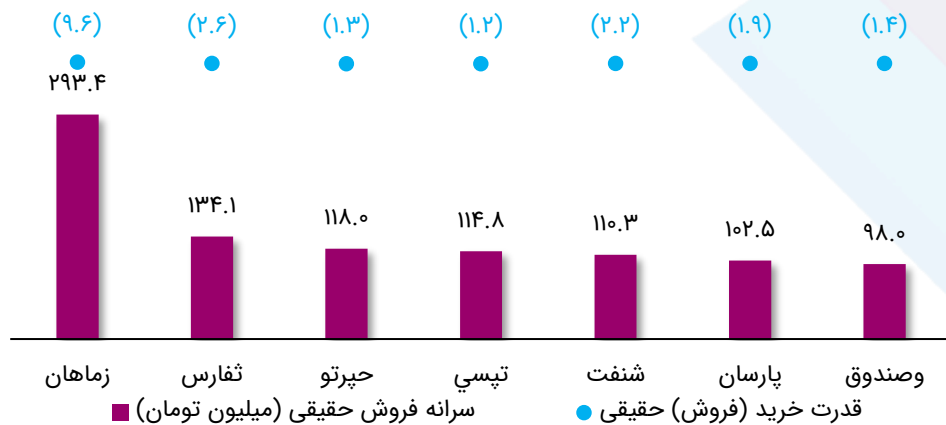
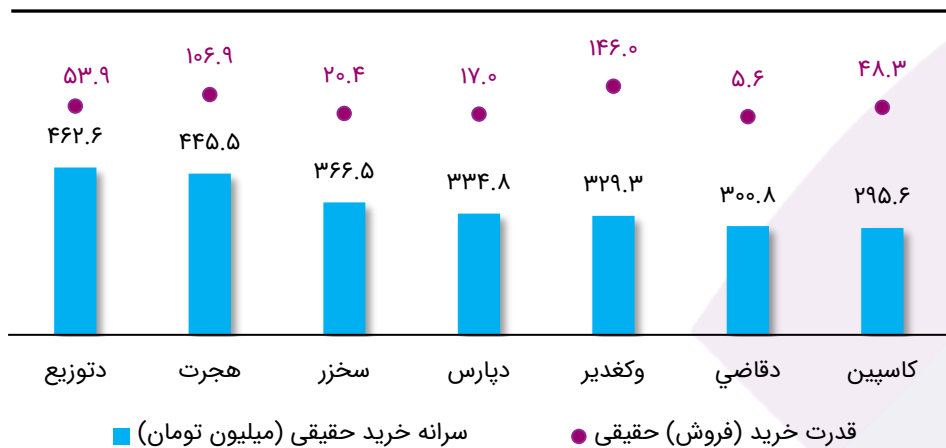


صنعت

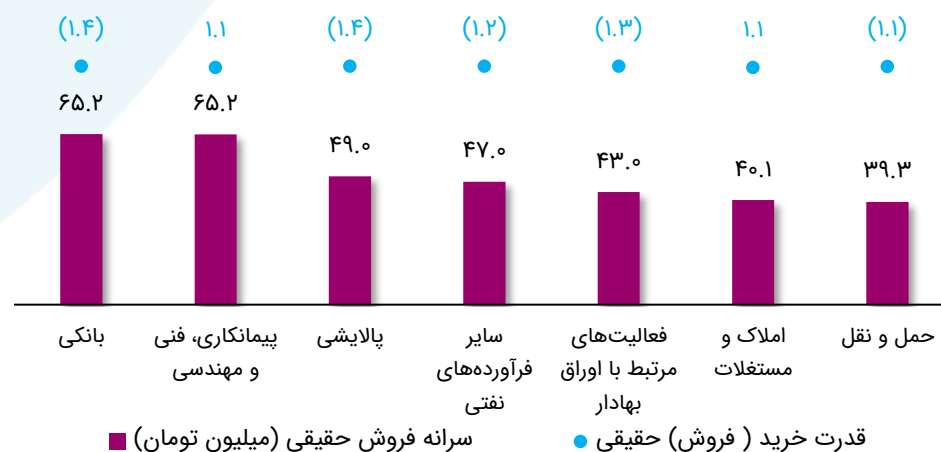
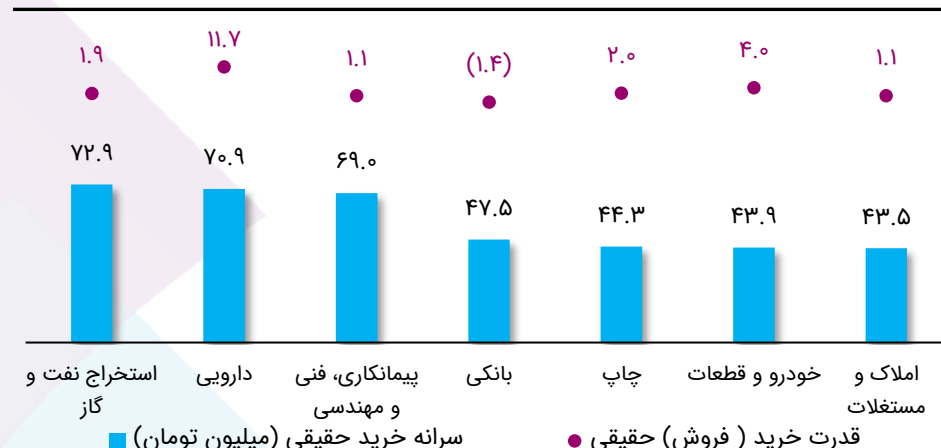


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



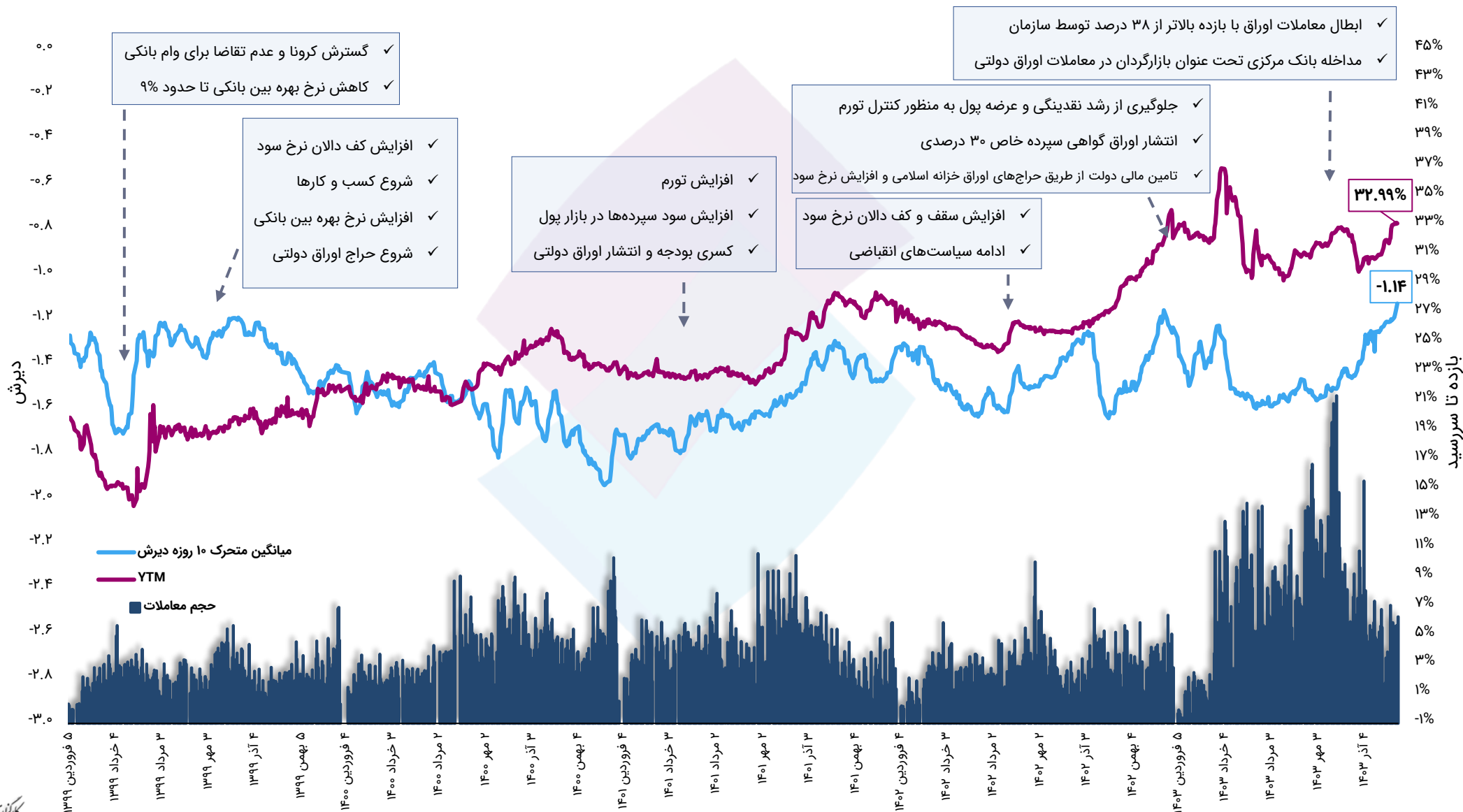
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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				
شنفت	۲,۳۰۰	۲,۶۰۰	۱۳%	سود انباشته
کسپا	۲۶۳	۳۲۳	۲۳%	سود انباشته
میهن	۳۵۹	۱,۴۰۰	۲۹۰%	آورده نقدی
کوثر	۳,۳۵۰	۴,۰۰۰	۱۹%	سود انباشته
غپینو	۱,۱۰۰	۷,۳۰۰	۵۶۴%	تجدید ارزیابی
والبر	۱,۳۵۰	۳,۱۰۰	۱۳۰%	آورده نقدی
کایتا	۲۰	۵۰	۱۵۰%	سود انباشته
قاسم	۷۰۰	۸۴۰	۲۰%	سود انباشته
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه				
وئخوز	۴۸	۱۱۰	۱۲۹%	آورده نقدی
دالبر	۱۲۰	۱۴۰	۱۷%	آورده نقدی

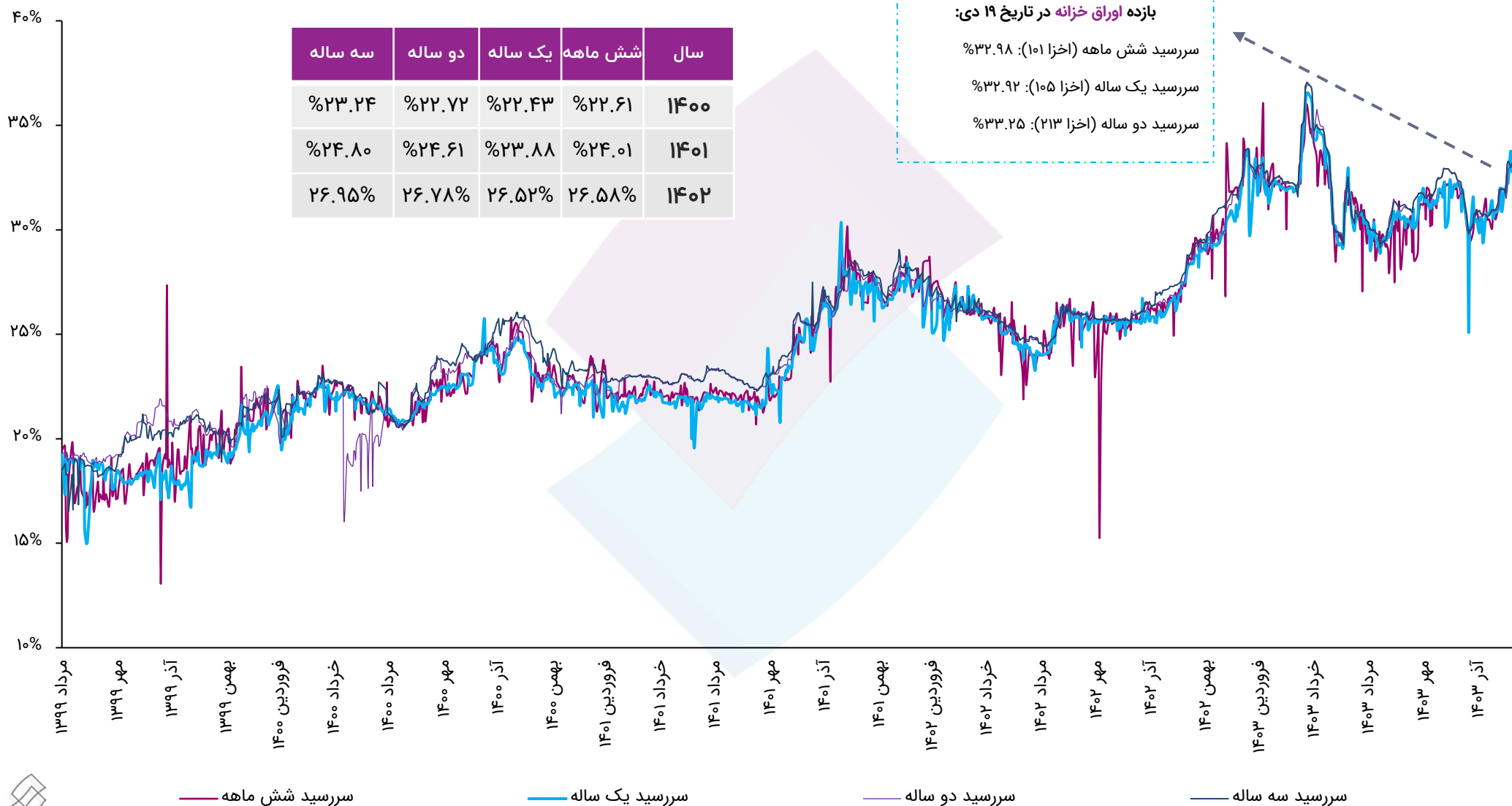
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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					
کوبر	۵۲۲	۱,۰۱۰	۹۳%	سود انباشته	اجرای طرح توسعه‌ای
زملارد	۸۰	۱,۳۲۲	۱۵۵۳%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی و استفاده از معافیت مالیاتی موضوع ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالای ایرانی
پی پاد	۳۰۰	۱,۲۰۰	۳۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و تامین نقدینگی مورد نیاز جهت خرید کارتهای و تجهیزات جانبی
اعلامیه پذیره نویسی عمومی					
زنجان	۶۱۲	۸۷۵	۴۳%	آورده نقدی	تکمیل احداث کارخانه اوره و آمونیاک
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
وهور	۷۶۱	۸۰۱	۵%	آورده نقدی	سرمایه گذاری در شرکت فرعی مولد نیروگاهی گوهر سیرجان و تامین سرمایه در گردش
تفارس	۱,۰۰۰	۱,۵۰۰	۵۰%	آورده نقدی	توسعه فعالیت تامین مالی و بهبود نسبت کفایت سرمایه
فسپا	۳۹۰	۹۷۵	۱۵۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
ولپارس	۲۰۰	۱,۰۰۰	۴۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و تقویت سطح اعتباری
وکبهن	۱,۰۰۰	۲,۰۰۰	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، حفظ رقابت پذیری و جلوگیری از خروج وجه نقد
ومل	۱,۰۰۰	۲,۰۰۰	۱۰۰%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی
بکابل	۲۰۵	۴۱۰	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی، افزایش سودآوری و استفاده از مشوق مالیاتی موضوع بند ۱۴ ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیر ساختها
شگامرن	۲۸	۲۹۸	۹۶۴%	سود انباشته (۸%) تجدید ارزیابی (۹۲%)	اصلاح ساختار مالی

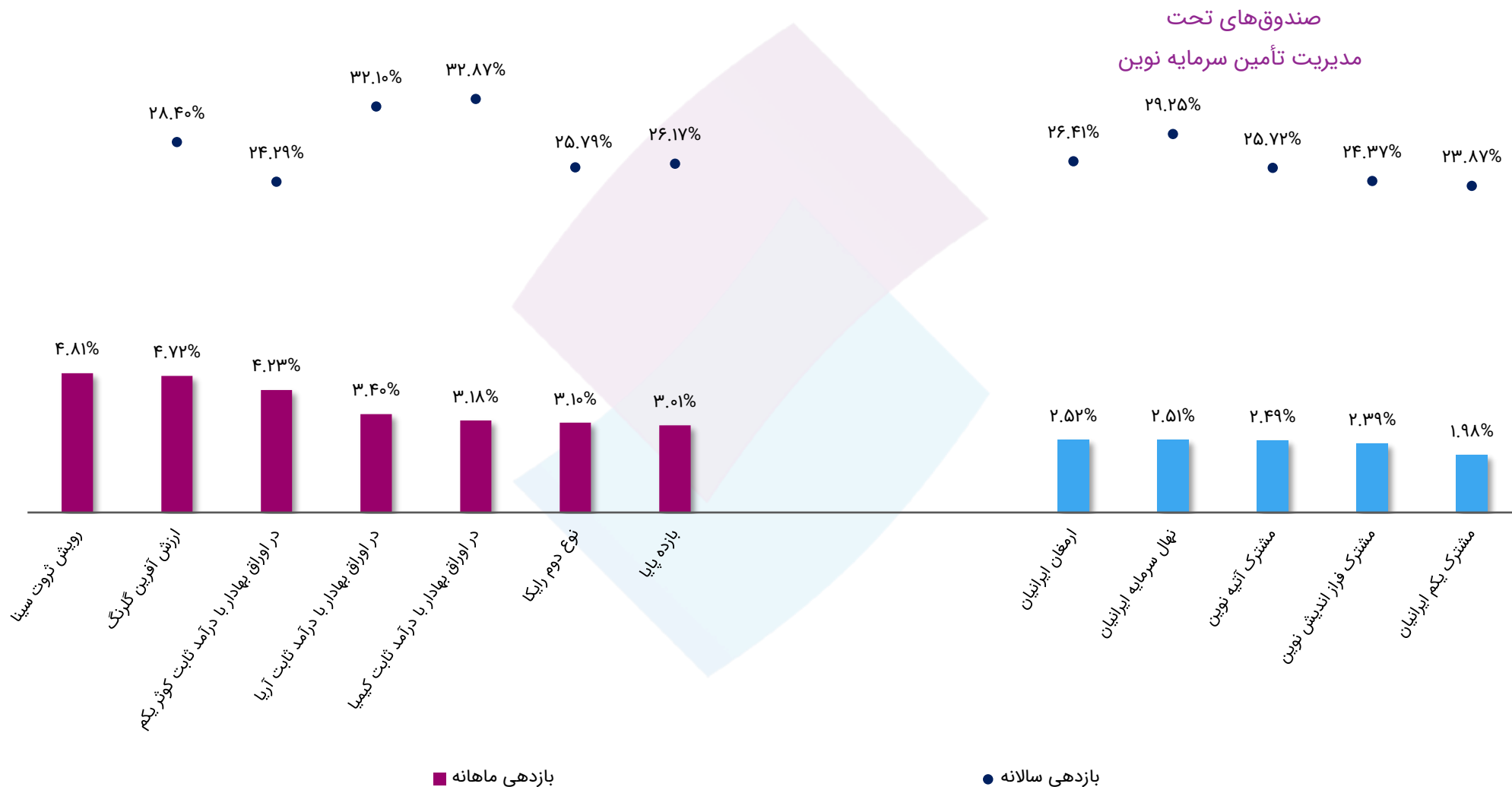
افزایش ۰.۱۲ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۹۹ درصد



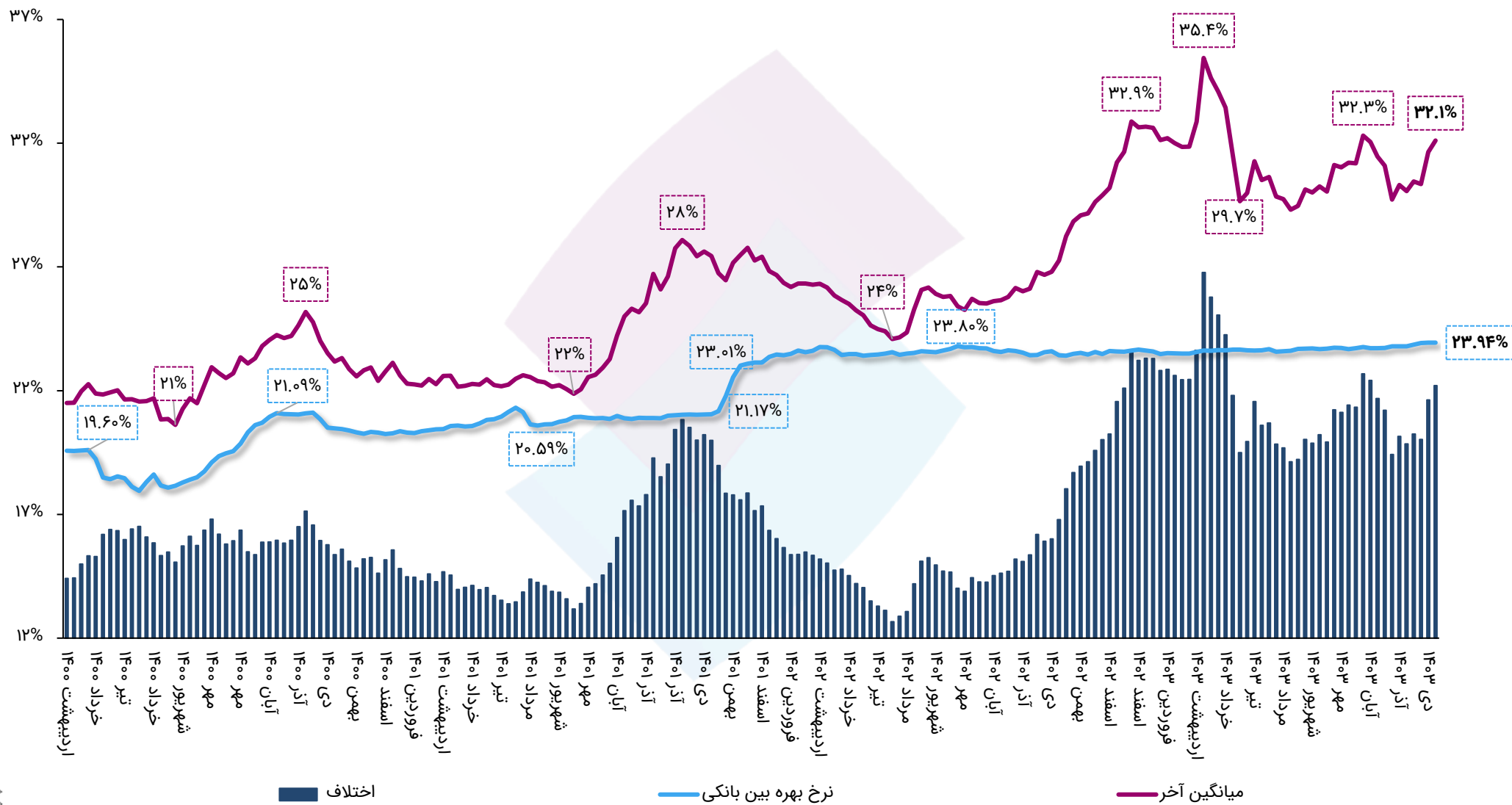
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

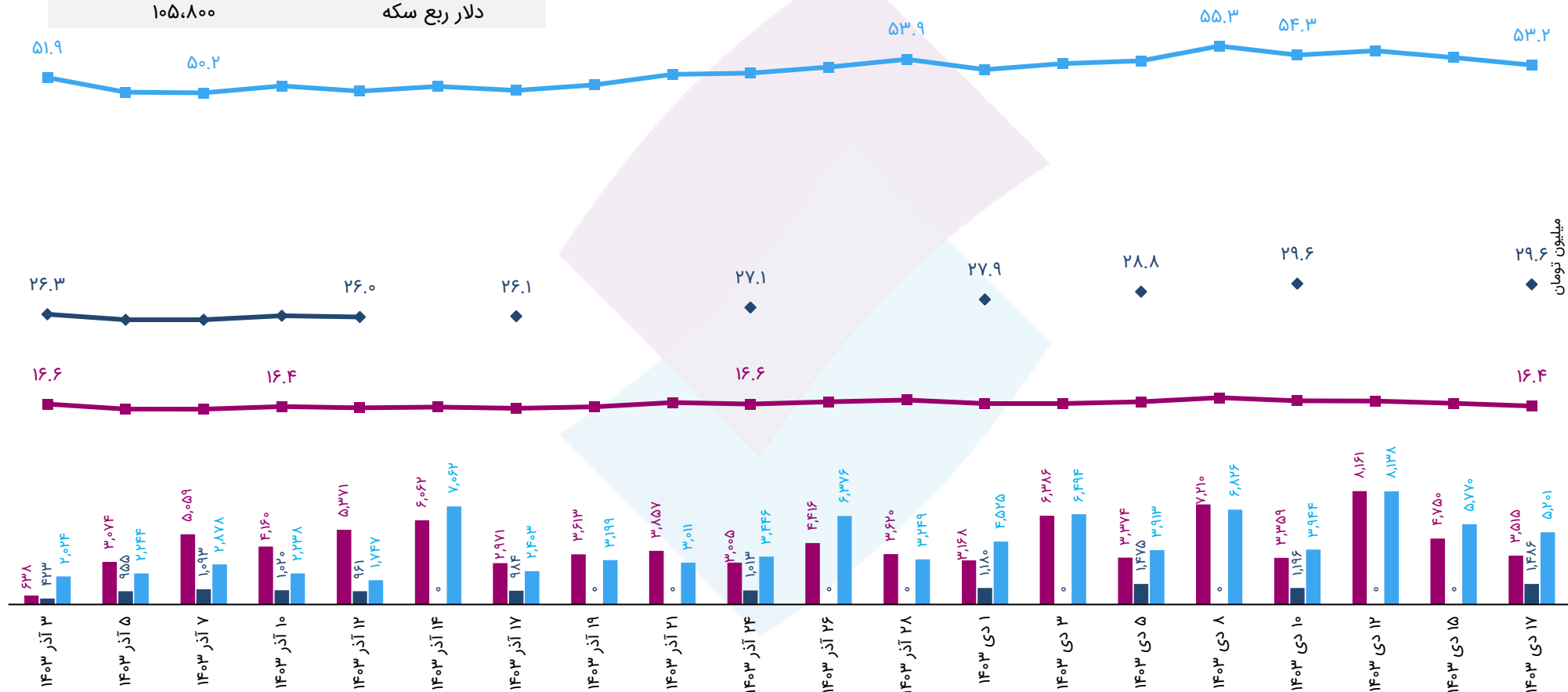


ثبات نرخ بهره بین بانکی در رقم ۲۳.۹۴ درصد و اجرای سی و دومین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی به مبلغ ۲۴ همت



معامله ۶۷۸ هزار و ۳۵۸ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۶۸,۰۲۵	
دلار سکه تمام	۸۵,۸۰۰	
دلار نیم سکه	۹۵,۳۰۰	
دلار ربع سکه	۱۰۵,۸۰۰	



قیمت سکه تمام — قیمت سکه نیم — قیمت سکه ربع

تعداد سکه تمام شده — تعداد سکه نیم شده — تعداد سکه ربع شده

معامله ۱۳ هزار و ۸۷۱ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

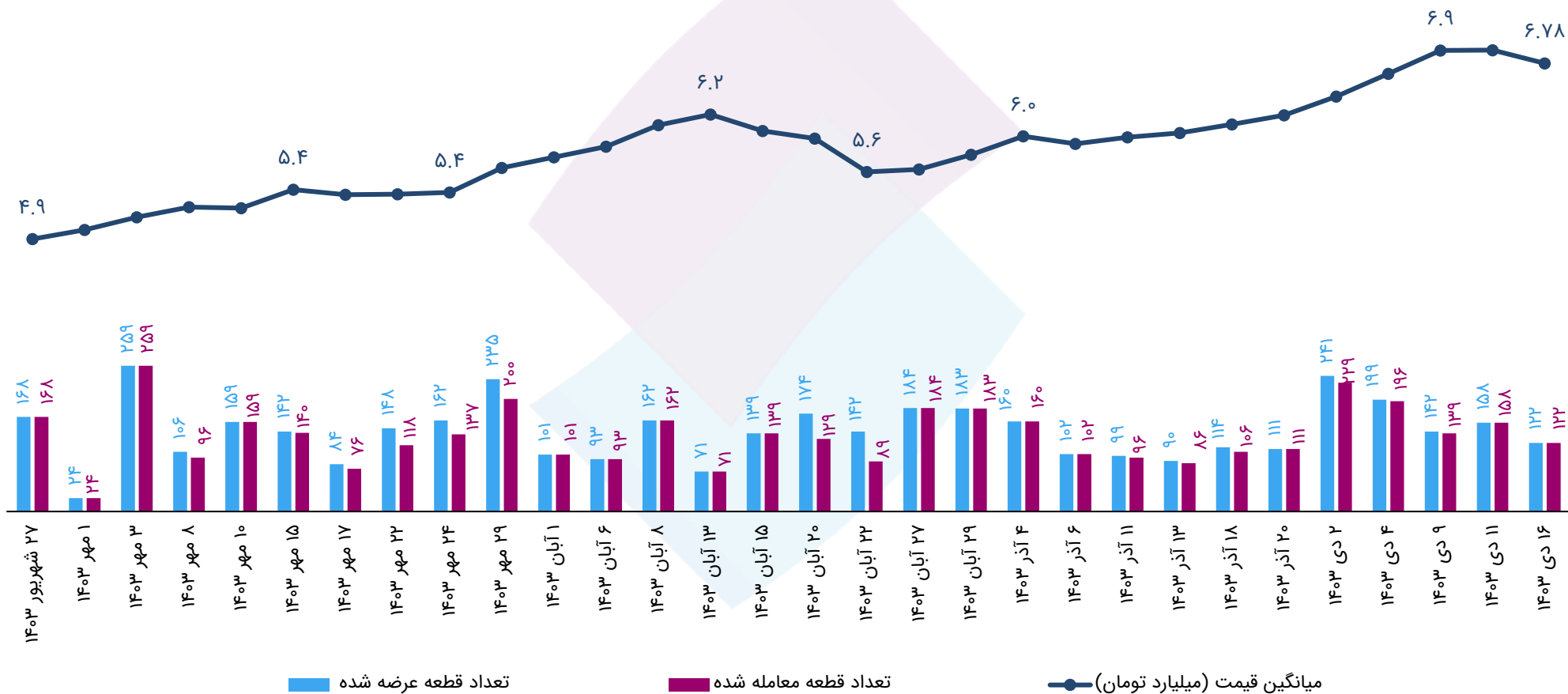
۶۸۰،۰۷۴

آخرین نرخ

دلار مرکز مبادله

۷۹،۹۲۵

دلار شمش طلا مرکز مبادله



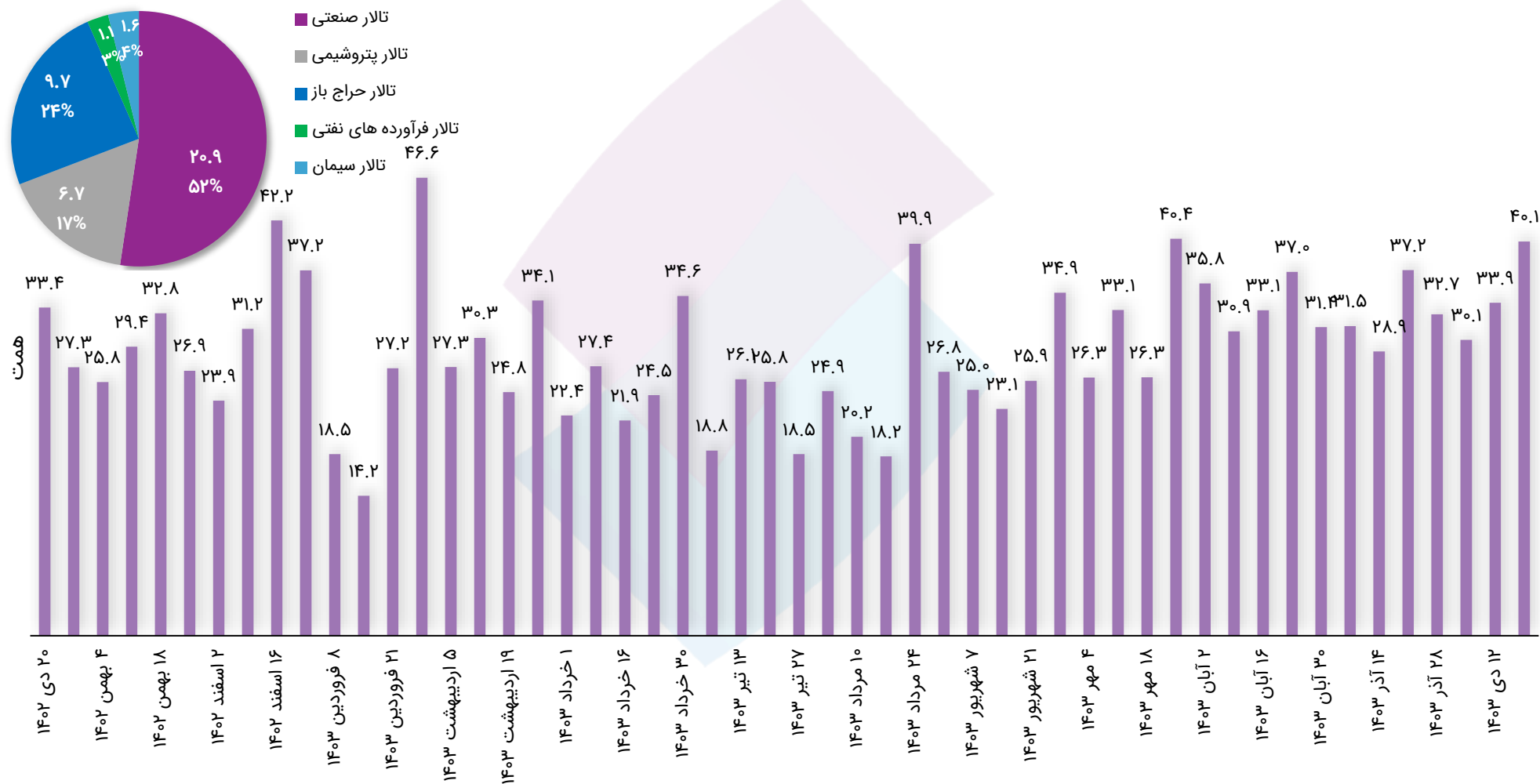
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلوگرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۰.۷%	۲,۰۳۰	-۰.۱%	۲,۶۵۸	۱.۱%	۲,۶۲۵	۲,۶۵۴	طلا (دلار/انس)
۸۱.۹%	۳۰۸,۴۹۰	۷.۳%	۵۲۳,۱۰۰	-۰.۲%	۵۶۲,۲۰۰	۵۶۱,۱۰۰	سکه (هزار ریال)
۵۹.۳%	۴۲۹,۲۶۹	۲۳.۴%	۵۵۴,۳۵۳	۱.۴%	۶۷۴,۳۲۰	۶۸۳,۸۷۲	دلار اسکناس (ریال)
۶۸.۳%	۳۹۵,۲۸۱	۲۳.۴%	۵۳۹,۲۵۴	۱.۴%	۶۵۵,۹۵۳	۶۶۵,۲۴۵	دلار حواله (ریال)
-۰.۶%	۷۷	۷.۱%	۷۲	۲.۹%	۷۵	۷۷	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۰۷.۵%	۴۶,۱۴۰	-۱.۸%	۹۷,۴۳۳	۱.۴%	۹۴,۴۲۰	۹۵,۷۲۰	بیت کوین (دلار)
۷.۰%	۸,۳۰۱	-۲.۴%	۹,۱۰۴	۲.۱%	۸,۷۰۵	۸,۸۸۶	مس LME (دلار/تن)
۱۳.۶%	۲,۵۰۲	-۸.۶%	۳,۱۱۰	-۴.۴%	۲,۹۷۴	۲,۸۴۳	روی LME (دلار/تن)
-۱۲.۲%	۵۰۰	-۰.۲%	۴۴۰	-۰.۹%	۴۴۳	۴۳۹	بیلت CIS (دلار/تن)
-۱.۲%	۴۵۰	-۱.۲%	۴۵۰	-۰.۸%	۴۴۸	۴۴۴	بیلت ایران (دلار/تن)
۹.۷%	۲۷۷	۵.۲%	۲۸۹	۰.۰%	۳۰۴	۳۰۴	متانول CFR (\$/mt)
۱۱.۷%	۳۱۶	۶.۸%	۳۳۱	۱.۰%	۳۵۰	۳۵۳	سبد اوره (mt/\$)
۱۱.۷%	۳.۲۵	۱۹.۰%	۳.۰۵	۶.۸%	۳.۴	۳.۶۳	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

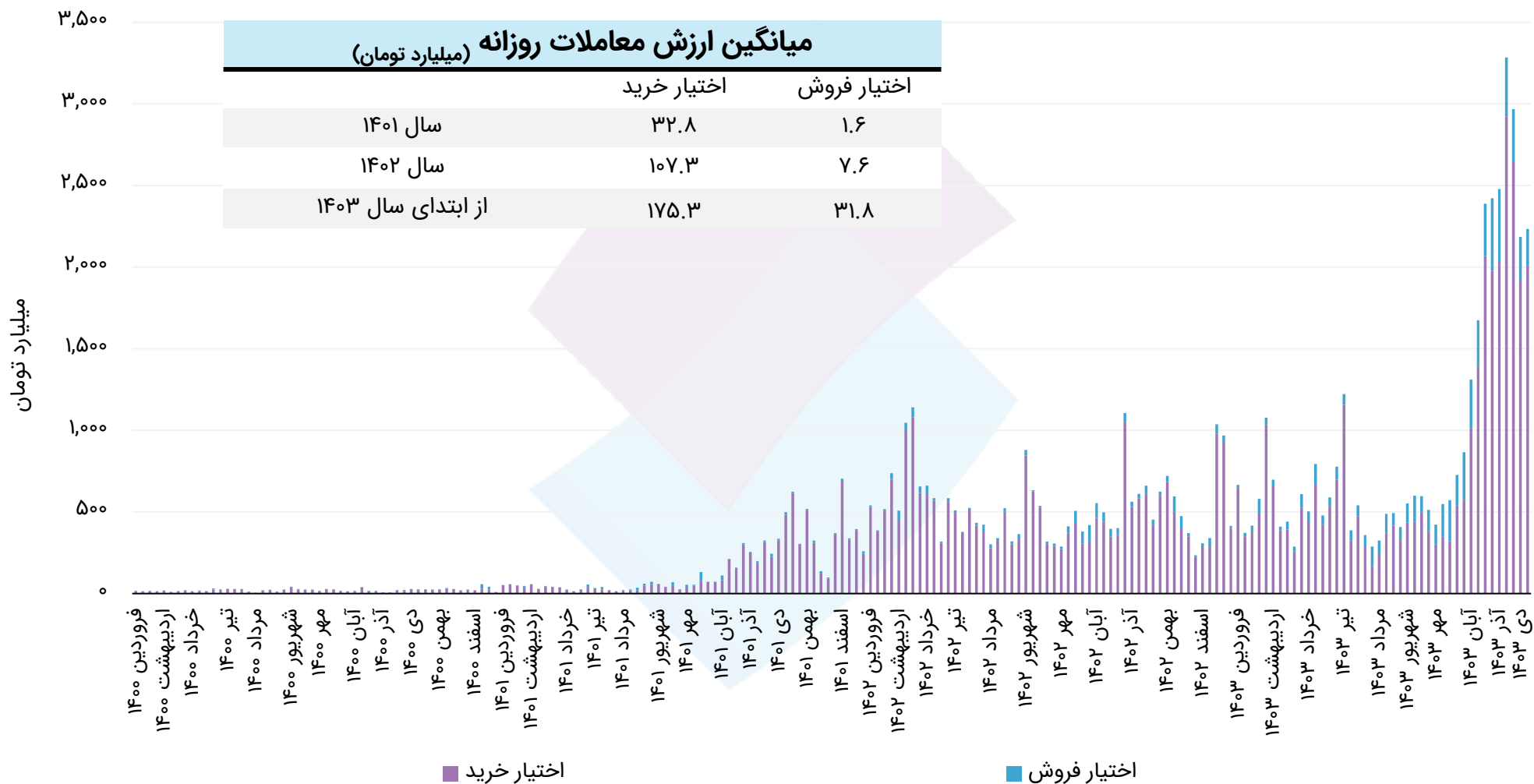


ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

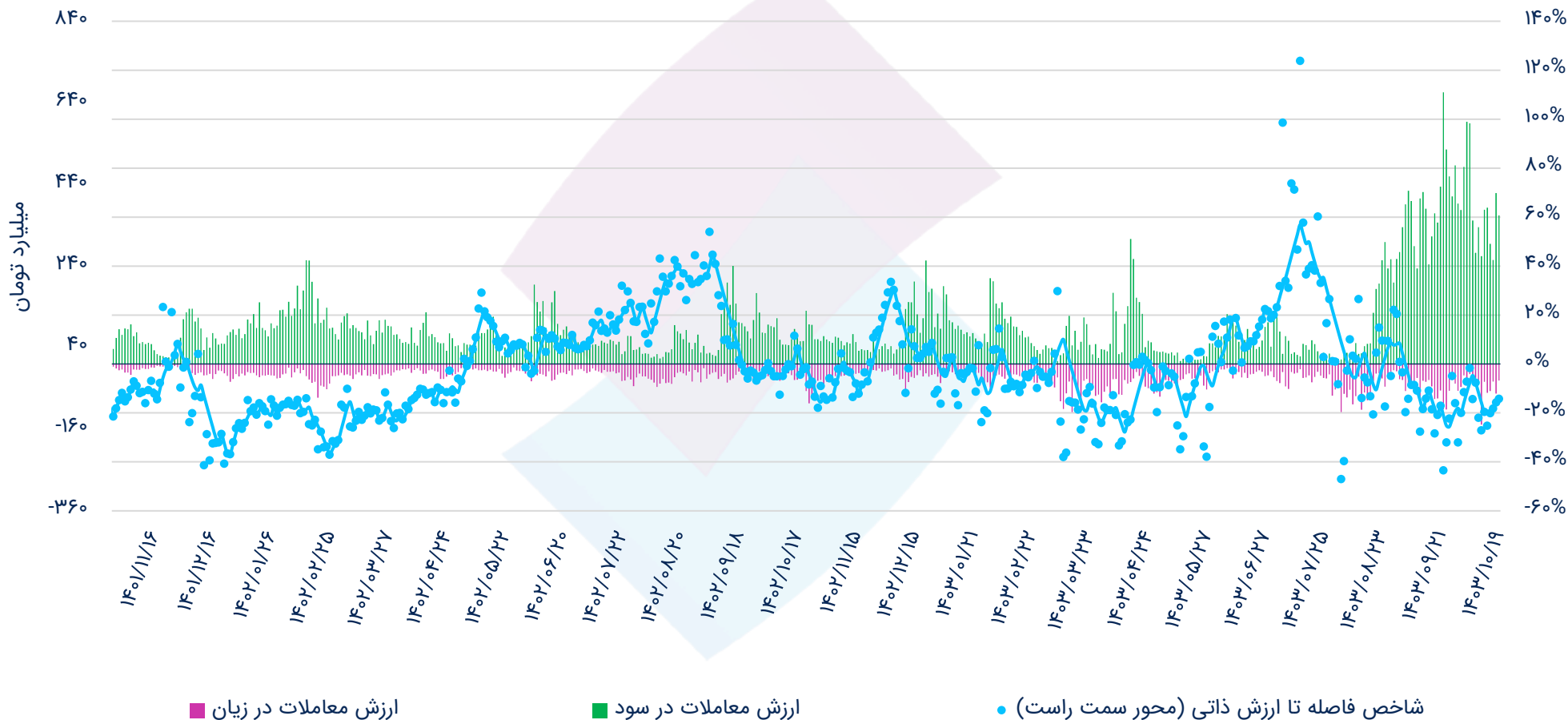
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۳	۱۱۵,۵۰۰	آهن و فولاد ارفع، پارس فولاد سبزوار، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد غدیر نی ریز، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صنعت فولاد شادگان، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، مجتمع فولاد اردکان، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر
پلی پروپیلن نساجی	۷۰.۷	۱۲,۱۲۷	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۵	۱,۱۴۶,۱۳۲	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
شمش آلومینیوم	۲۰۶.۱	۵,۴۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۵.۳	۱۲۵,۵۲۵	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، فولاد کاوه جنوب کیش، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد، فولاد سیرجان ایرانیان، صبا راد محور، شرکت ذوب بربیس، مجتمع فولاد البرز ناب آرش، مجتمع فولاد شمش نگین مشهد، پولاد آذر ماهان
کنسانتره سنگ آهن	۴.۱	۲۳۷,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، توسعه معدنی و صنعتی صبانور، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
گندله سنگ آهن	۵.۶	۳۲۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، صنعتی و معدنی اپال پارسین سنگان، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان
لوب کات	۳۰.۷	۲۶,۸۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
مس کاتد	۵۶۴.۹	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۲۹.۱	۳۱,۵۵۰	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد سپهر ایرانیان، فولاد آذربایجان، ذوب آهن آرمان آسیا، فولاد آلیاژی ایران، فولاد روهینا جنوب، تات فولاد تاکستان، صنایع نورد میلاد یزد، صنایع فولاد هیربد زرنديه، فولاد خرم‌دشت تاکستان
ورق گالوانیزه	۴۷.۱	۲۴,۱۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تاراز چهارمحال، صنایع هفت الماس، گروه صنعتی دانیال استیل، مجتمع فولادی روی اندودکاوه، فولاد دشتستان (مجتمع نورد گالوانیزه دشتستان راد)
وکیوم باتوم	۲۵.۵	۱۵۳,۵۰۰	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
ورق گرم	۳۵.۴	۲۴۳,۹۴۰	فولاد مبارکه اصفهان، نورد و تولید قطعات فولادی، فولاد اکسین خوزستان، فولاد کاویان، مجتمع فولاد آریا ذوب
مس مفتول	۶۷۸.۹	۲,۱۴۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، صنایع مس کاوه
تختال	۲۷.۴	۵۰,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد مبارکه اصفهان، فولاد جهان آرا اروند

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

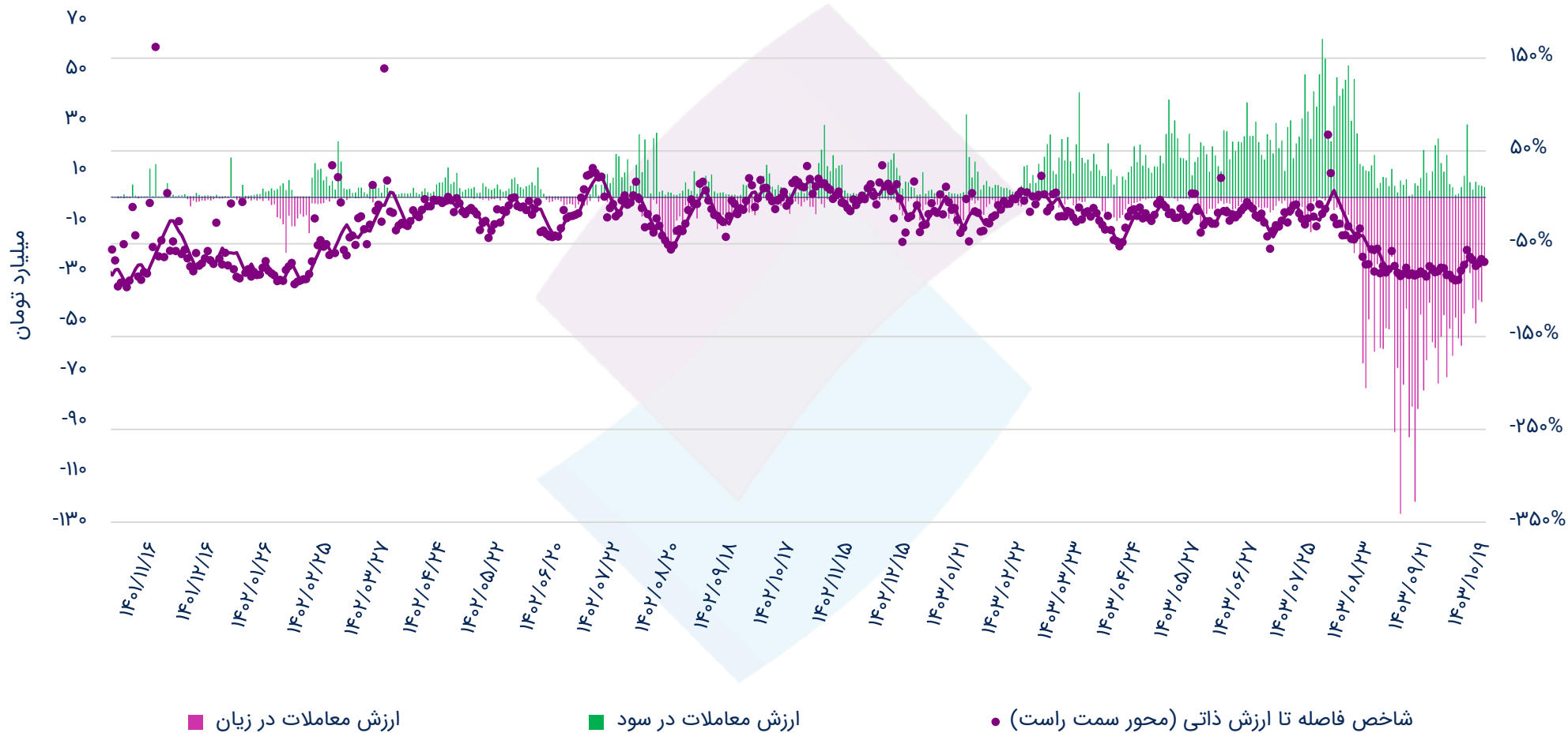


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

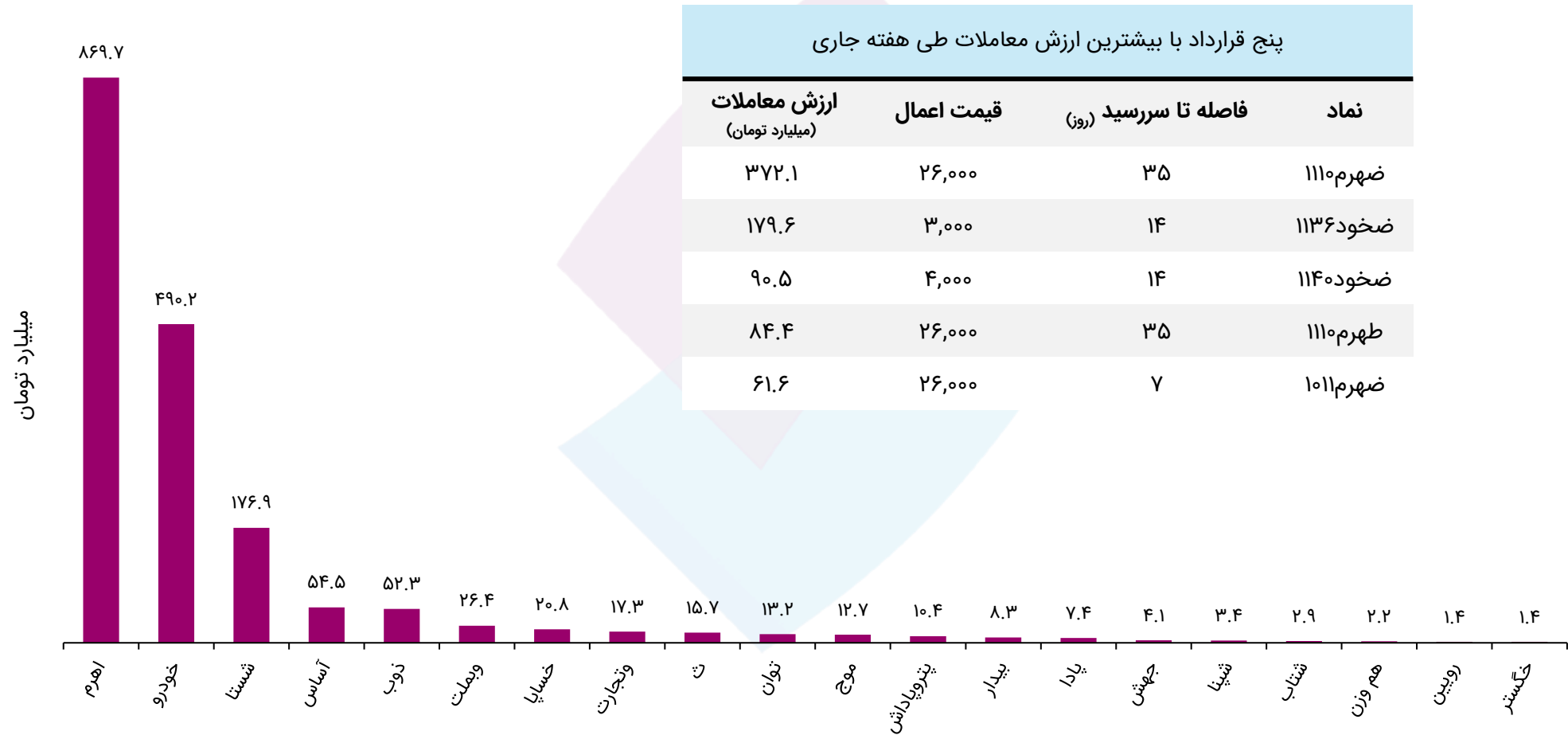
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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

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

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