

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 ۲۶ دی - شماره ۱۸۵

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



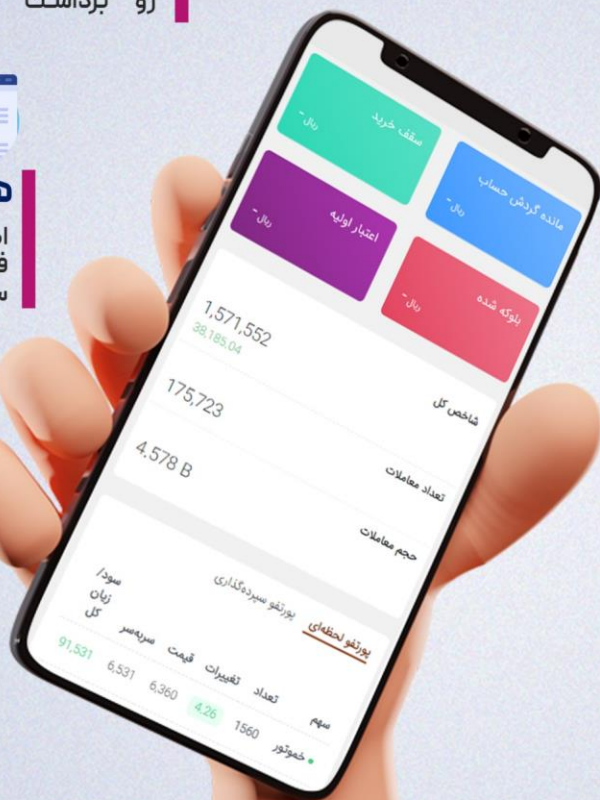
برداشت وجه آتی

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

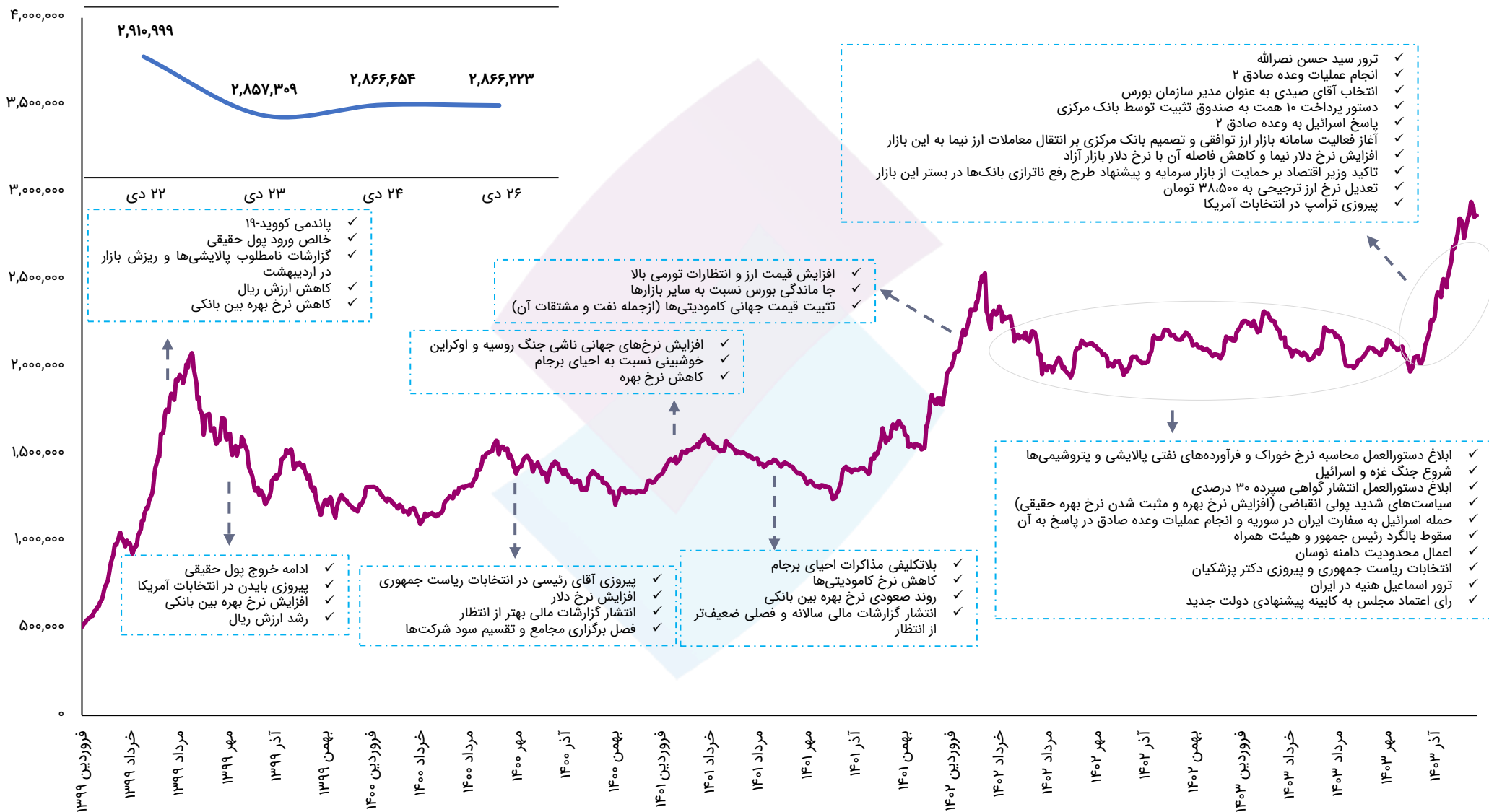
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

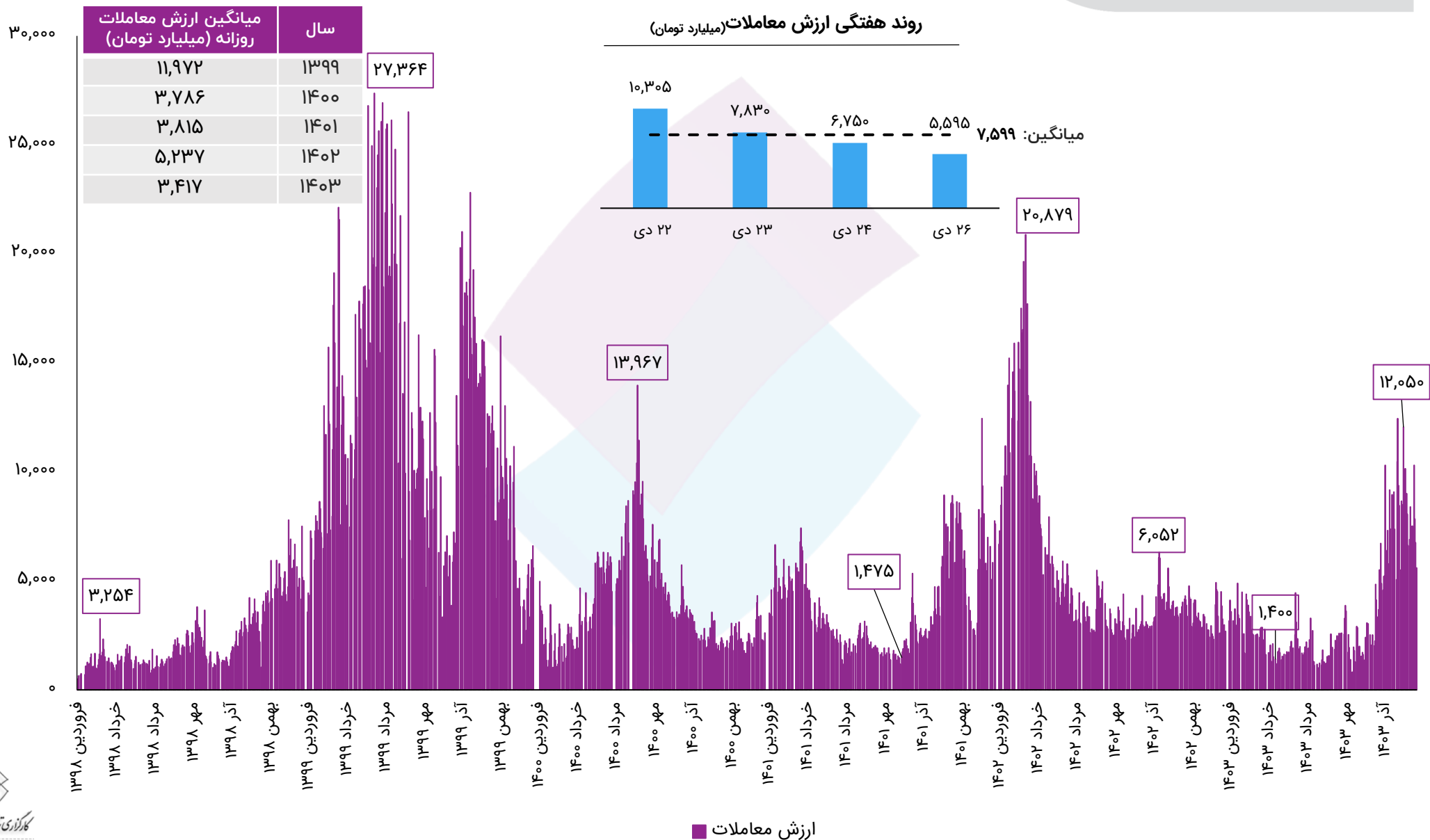
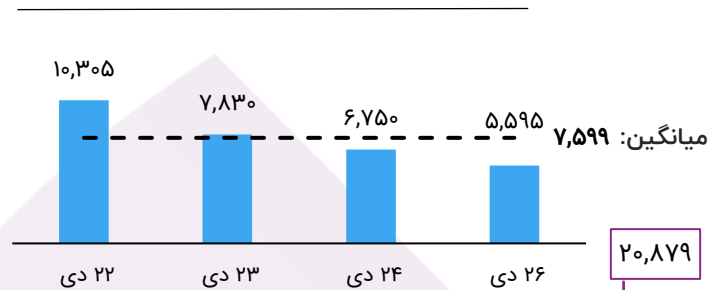
کاهش ۲.۷ درصدی شاخص کل در هفته جاری

رند هفتگی شاخص کل

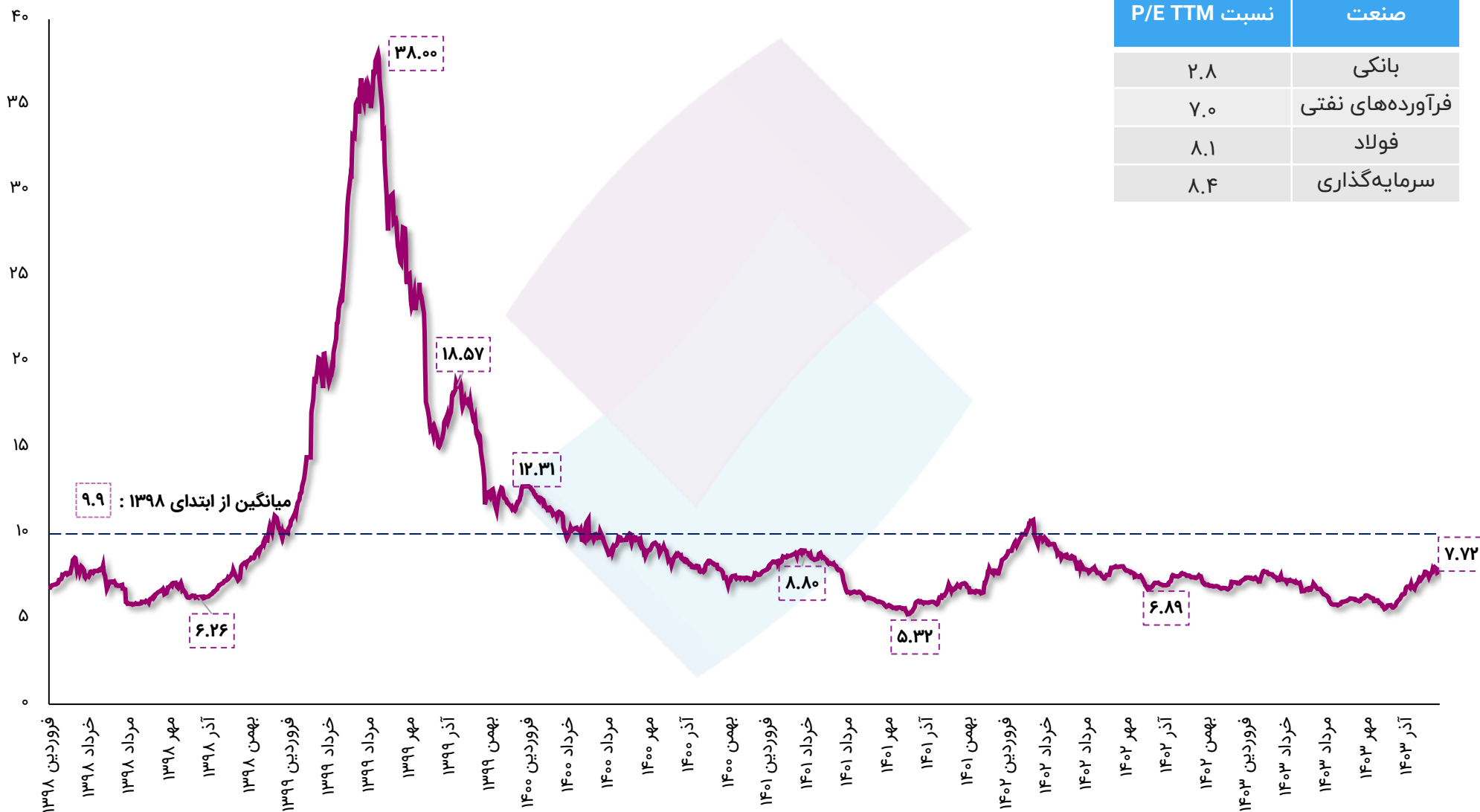


ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

روند هفتگی ارزش معاملات (میلیارد تومان)

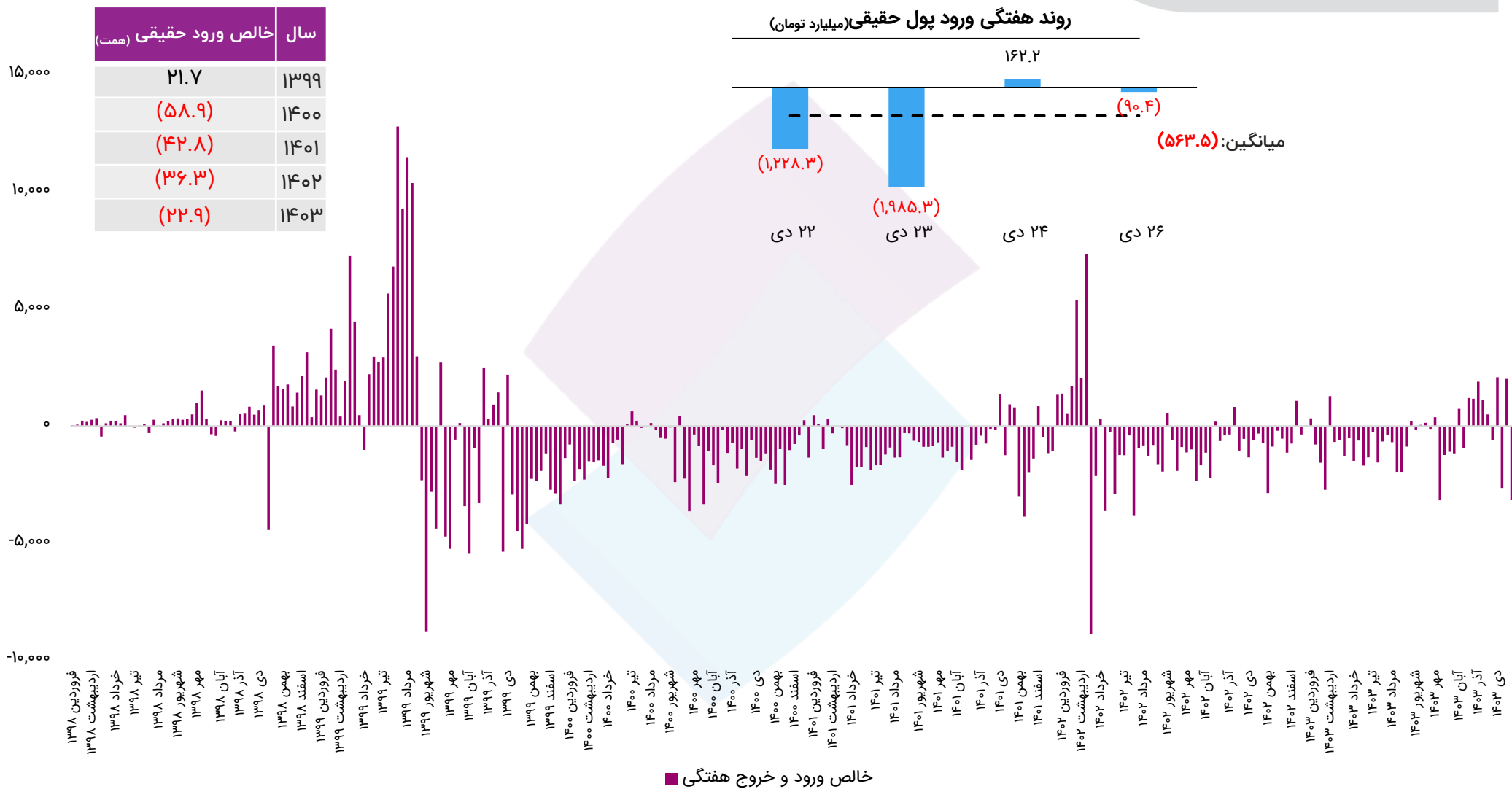


نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



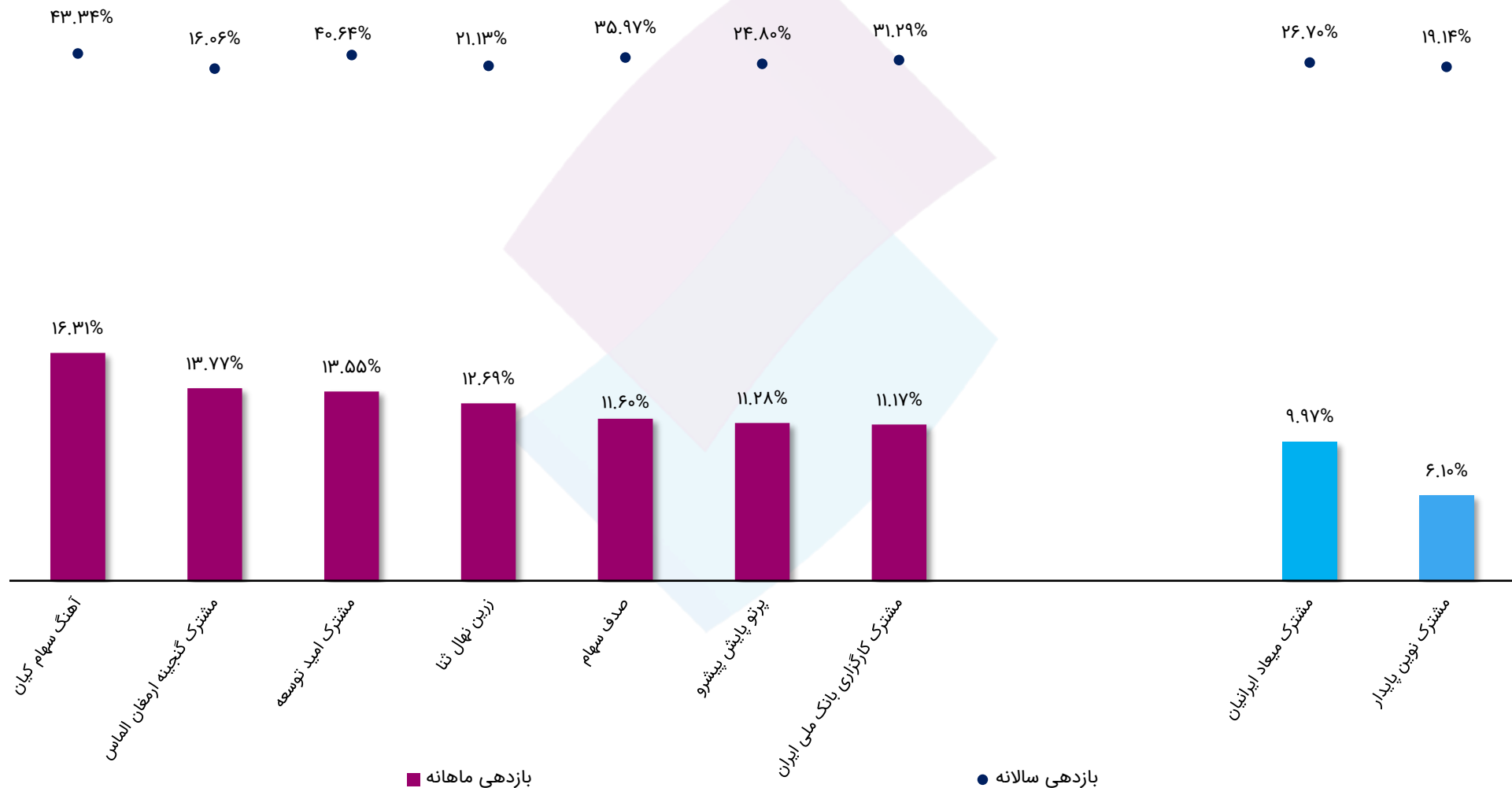
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۸	بانکی
۷.۰	فرآورده‌های نفتی
۸.۱	فولاد
۸.۴	سرمایه‌گذاری

۳,۱۴۲ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با ورود ۲,۰۱۱ میلیارد تومانی هفته گذشته

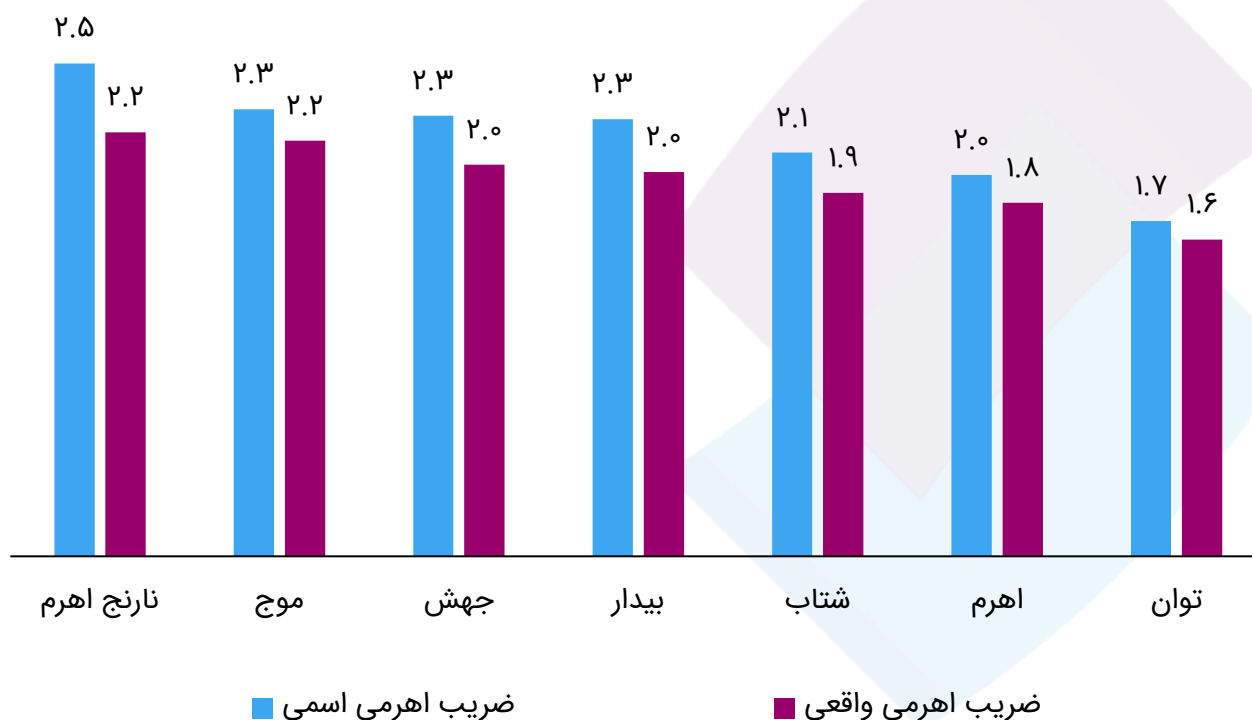


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
توان	۴.۳%	۱.۶
جهش	۲.۹%	۱.۷
نارنج اهرم	۲.۴%	۱.۷
بیدار	۲.۰%	۱.۷
اهرم	۱.۲%	۱.۷
شتاب	۰.۲%	۱.۶
موج	۷.۹%	۱.۶

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۲۷.۲%	۲.۵۳%
شتاب	۱۹.۱%	۲.۳۷%
نارنج اهرم	۱۳.۴%	۲.۵۳%
جهش	۱۰.۲%	۲.۵۴%
توان	۷.۲%	۲.۲۴%
بیدار	۶.۲%	۲.۵۳%
اهرم	۳.۶%	۲.۵۳%

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

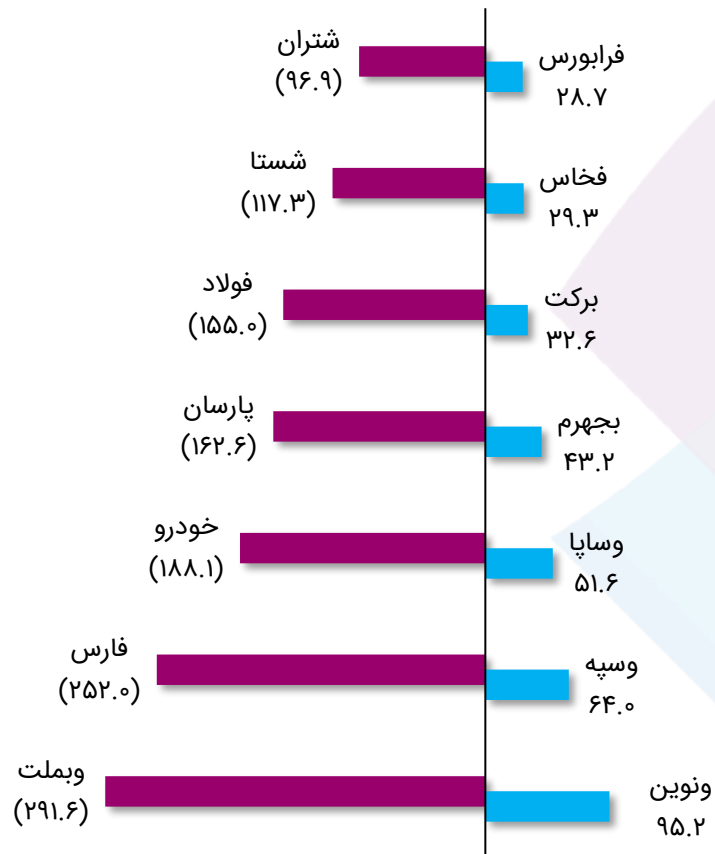
در محاسبه ضریب بتا از بازده قیمت پایانی و شاخص هموزن ۳ ماهه استفاده شده است.

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

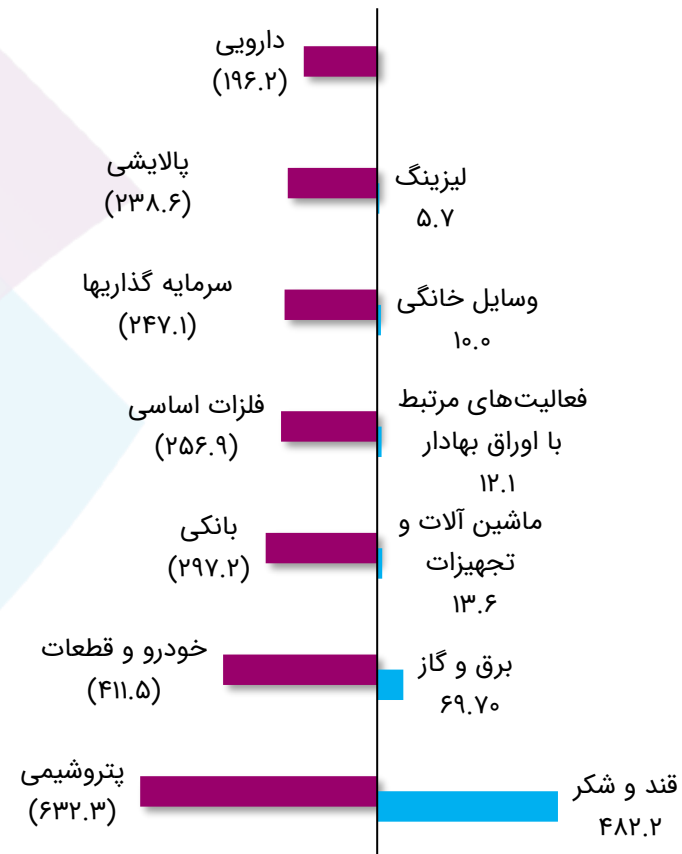
صنعت

نماد

میلیارد تومان

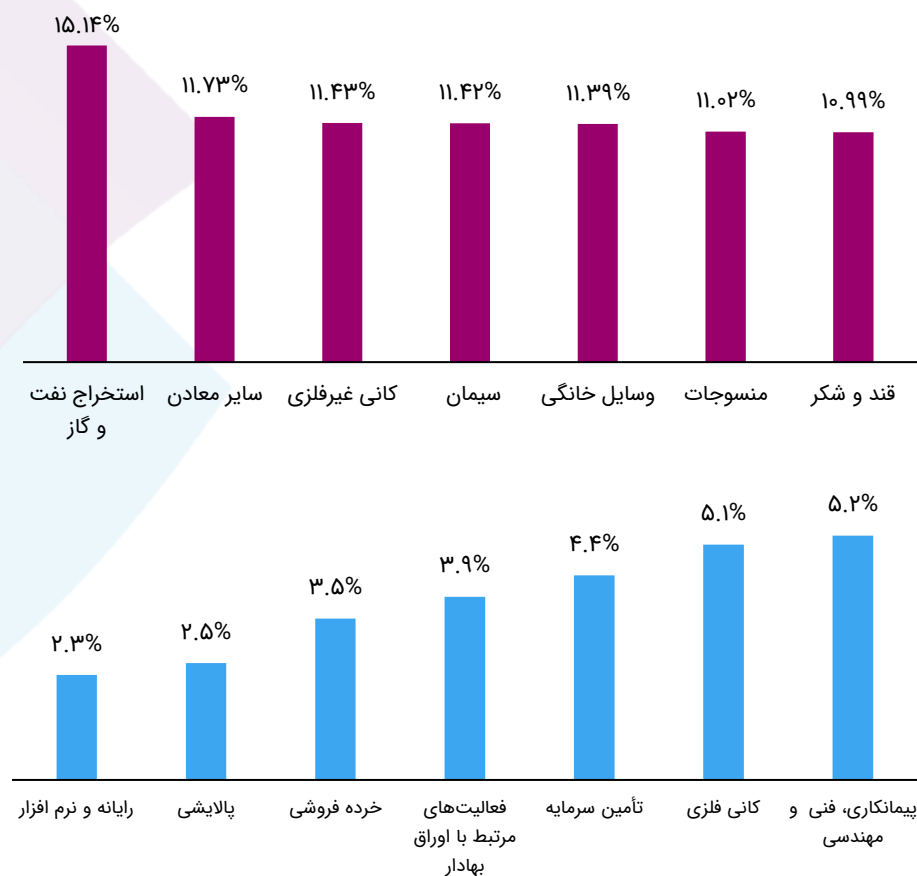
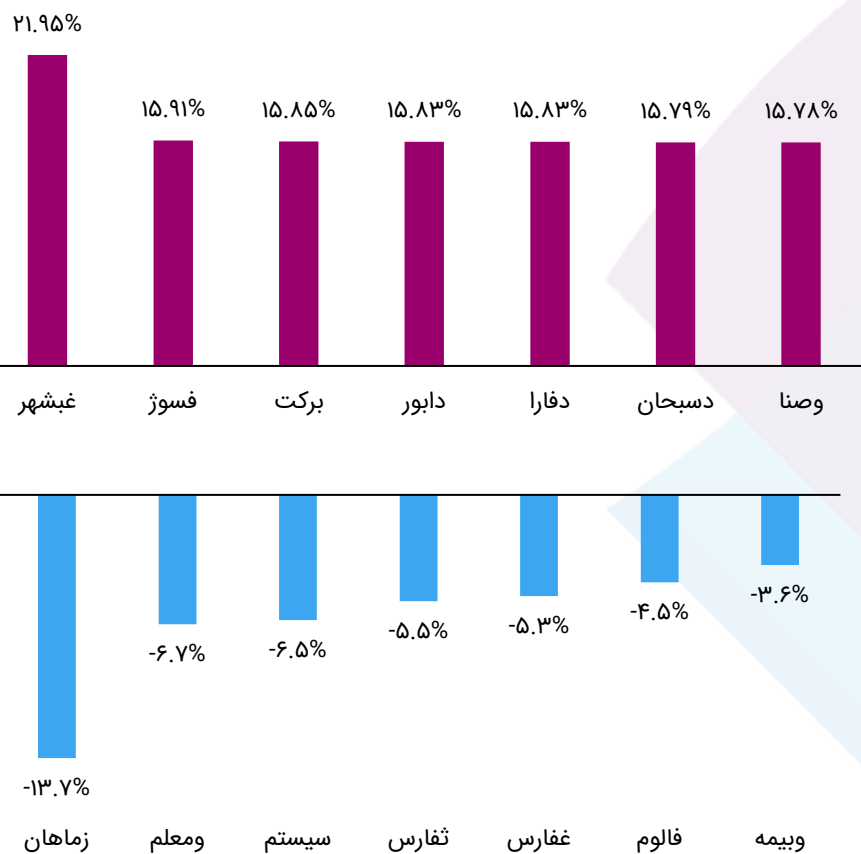


میلیارد تومان



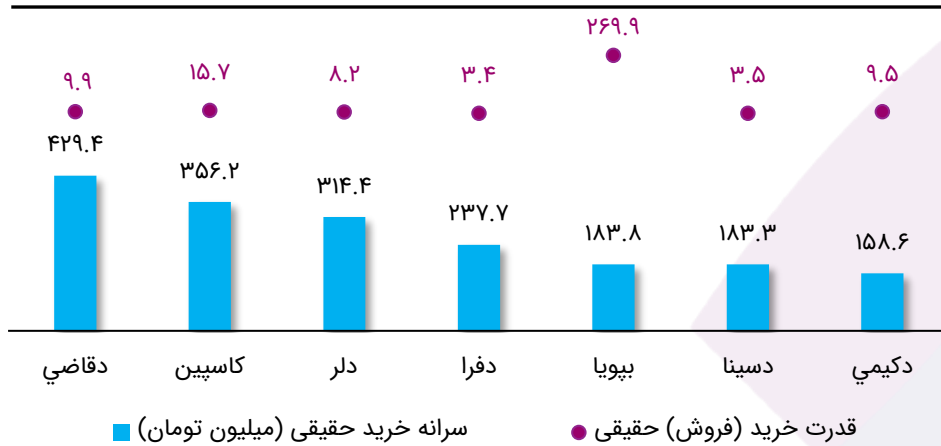
نماد

صنعت

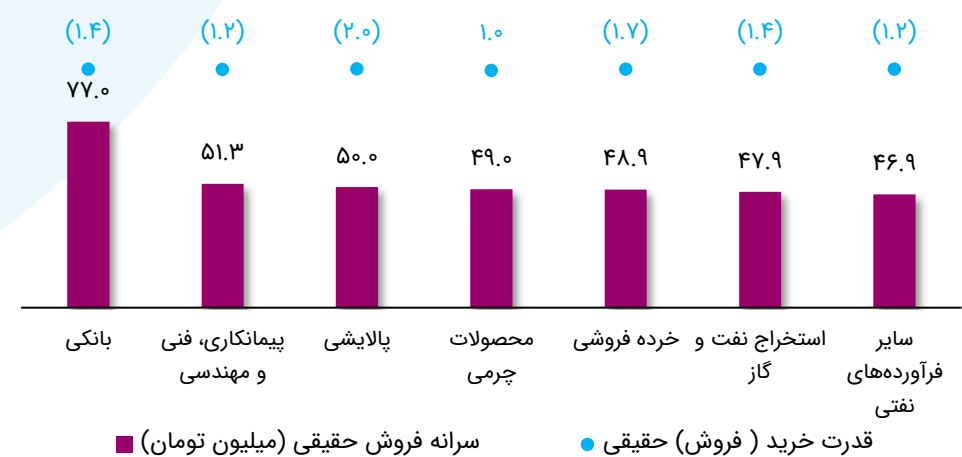
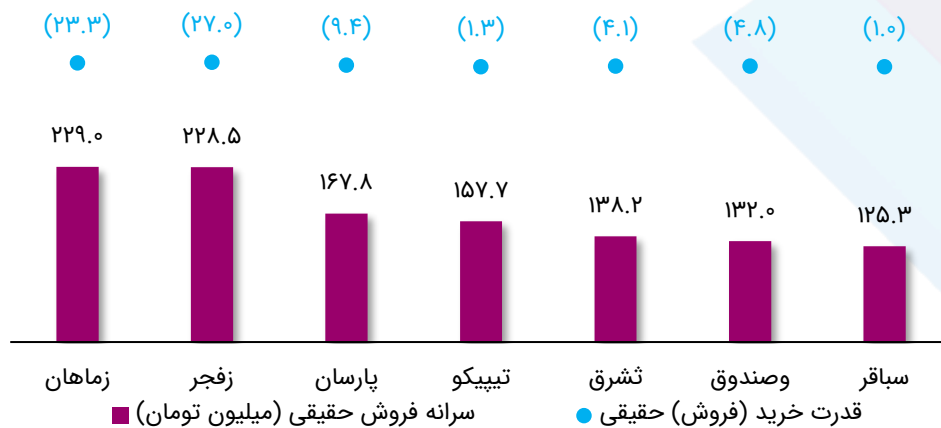
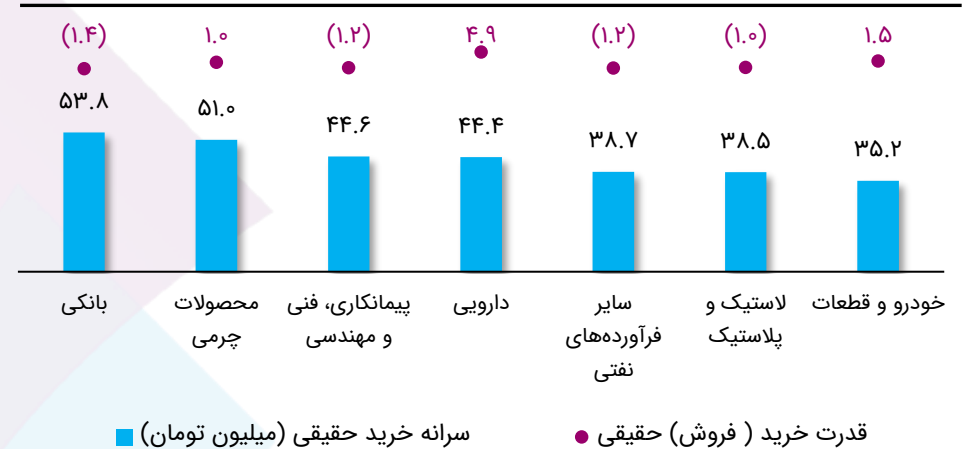


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

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

ثفارس	۴۰۵	۶۸۹	۷۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
خشرق	۲۴۳	۴۳۱	۷۷%	سود انباشته	افزایش در ظرفیت محصول خودروی تارا
دتماد	۷۱	۱۲۳	۷۳%	سود انباشته آورده نقدی تجدیدارزیابی	اصلاح ساختار مالی و طرح توسعه و تولید محصولات جدید
قمرو	۴۰۰	۵۰۰	۲۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
لوتوس	۵۰۰	۹۵۰	۹۰%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی
غصینو	۱,۲۵۰	۱,۶۰۰	۲۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
دفارا	۱۶۰	۹۲۱	۴۷۶%	سود انباشته تجدیدارزیابی	اصلاح ساختار مالی
کتوکا	۲۶۰	۳۱۰	۱۹%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
توریل	۷۰۰	۱,۱۰۰	۵۷%	سود انباشته	معافیت مالیاتی و جبران مخارج مالیاتی

صدور مجوز افزایش سرمایه

خدیزل	۳,۴۹۸	۵,۸۷۳	۶۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
وارس	۱۵۰	۳۰۰	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
دسانکو	۱۹۱	۶۰۰	۲۱۴%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی
فولای	۱۶۰	۲۴۰	۵۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
فایرا	۵,۰۰۰	۶,۲۰۰	۲۴%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

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

تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه

دبالک	۹۲	۱۸۲	۹۸%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی
وبصادر	۲۱,۵۳۵	۷۸,۱۷۲	۲۶۳%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی
ونیکی	۳,۵۰۰	۶,۵۰۰	۸۶%	سود انباشته (۳۰%) سایر اندوخته (۷۰%)	اصلاح ساختار مالی
دفرا	۱۴۰	۲۸۰	۱۰۰%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

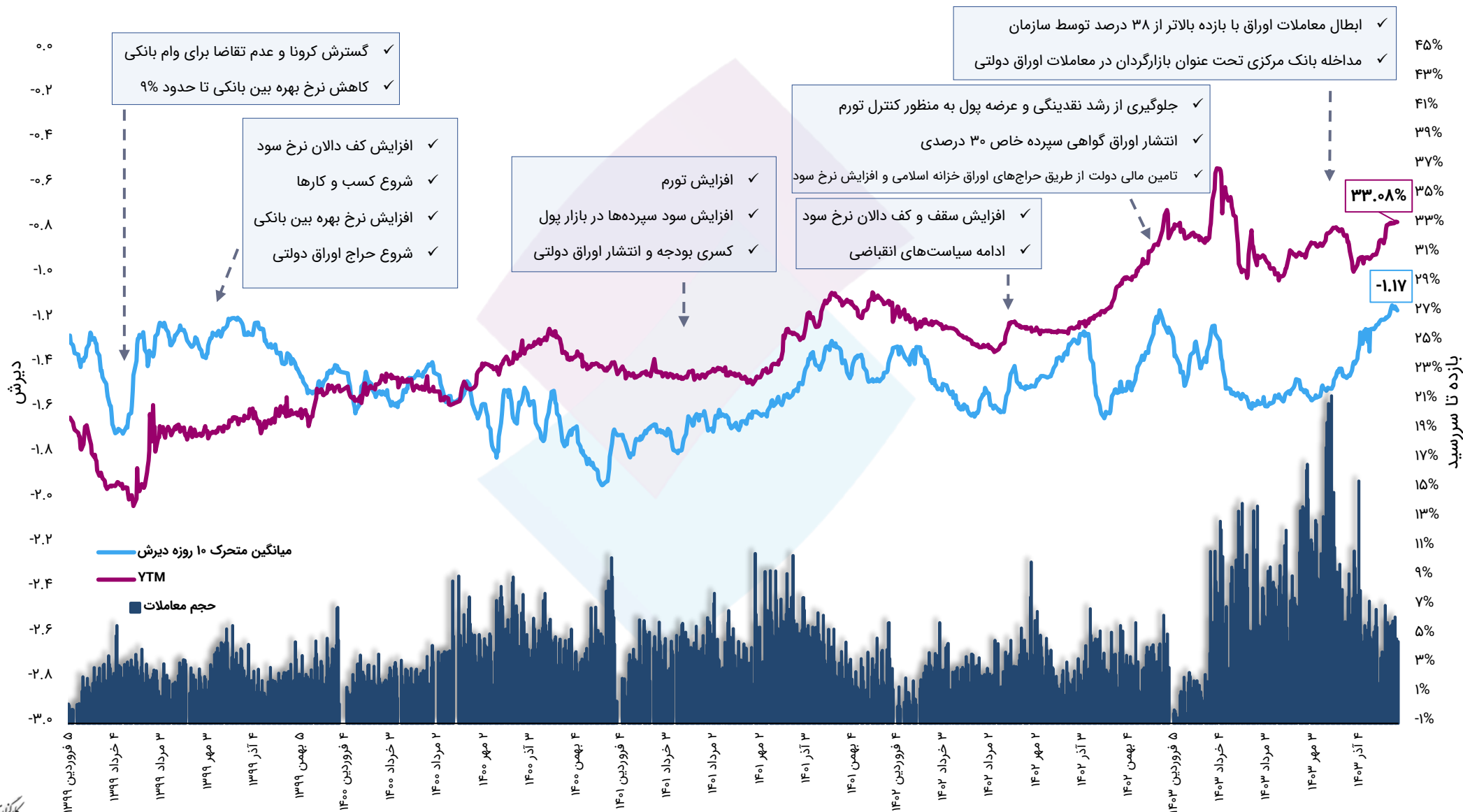
اعلامیه پذیره نویسی عمومی

فافق	۴۷۰	۷۰۰	۴۹%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی مهلت پذیره نویسی از تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۲۲ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۰۶ است.
حرهشا	۲	۲۰	۱۲۳۳%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی مهلت پذیره نویسی از تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۲۹ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۱۳ است.

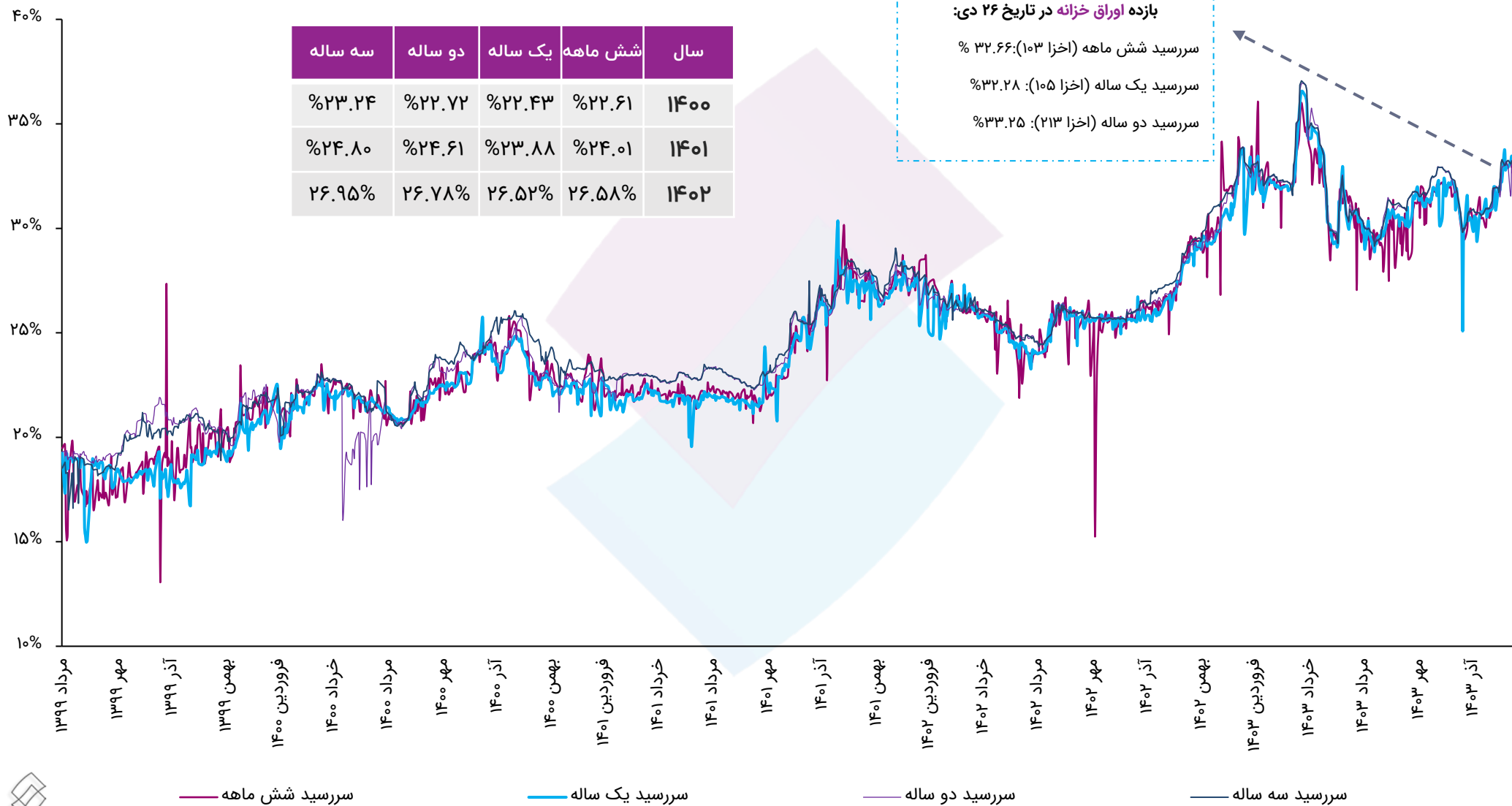
آگهی ثبت افزایش سرمایه

کیمیاتک	۶۰۰	۱,۰۰۰	۶۷%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
توسن	۳۰۰	۵۰۰	۶۷%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
سامان	۸,۰۰۰	۱۱,۰۰۰	۳۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
ولکار	۱۵۰	۲۹۰	۹۳%	سود انباشته (۲۹%) آورده نقدی (۷۱%)	اصلاح ساختار مالی

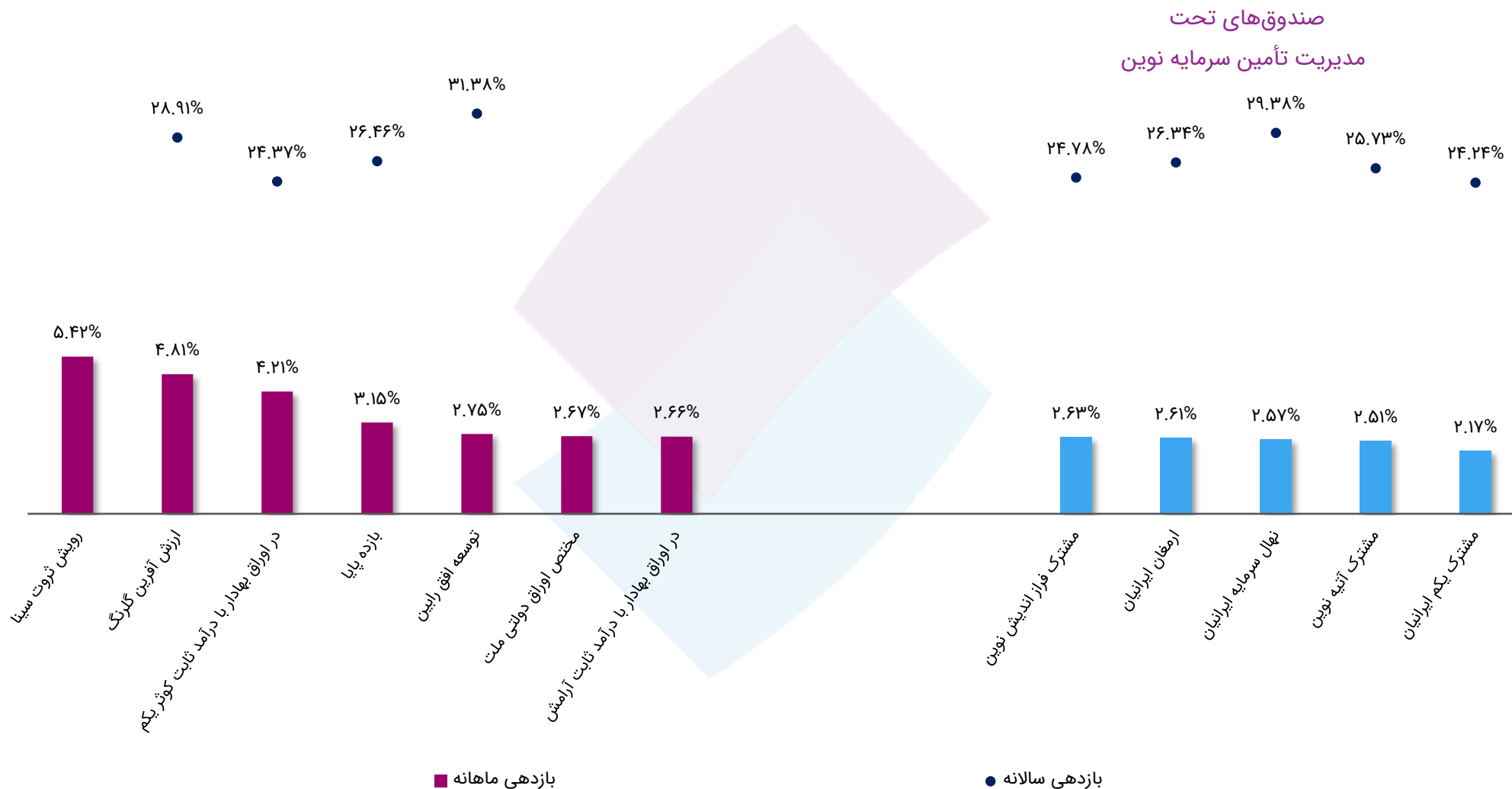
افزایش ۰.۰۹ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۳.۰۸ درصد



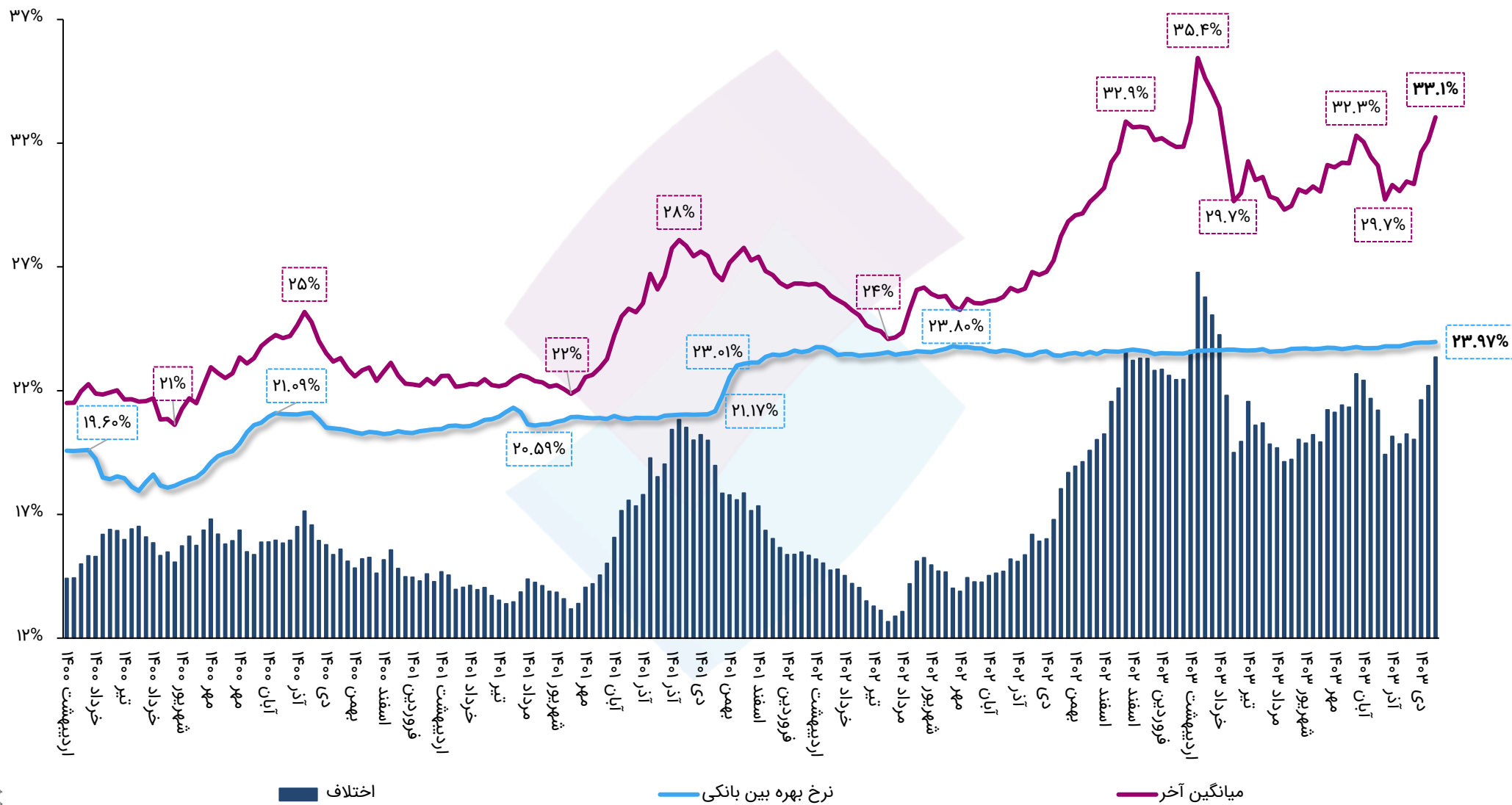
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



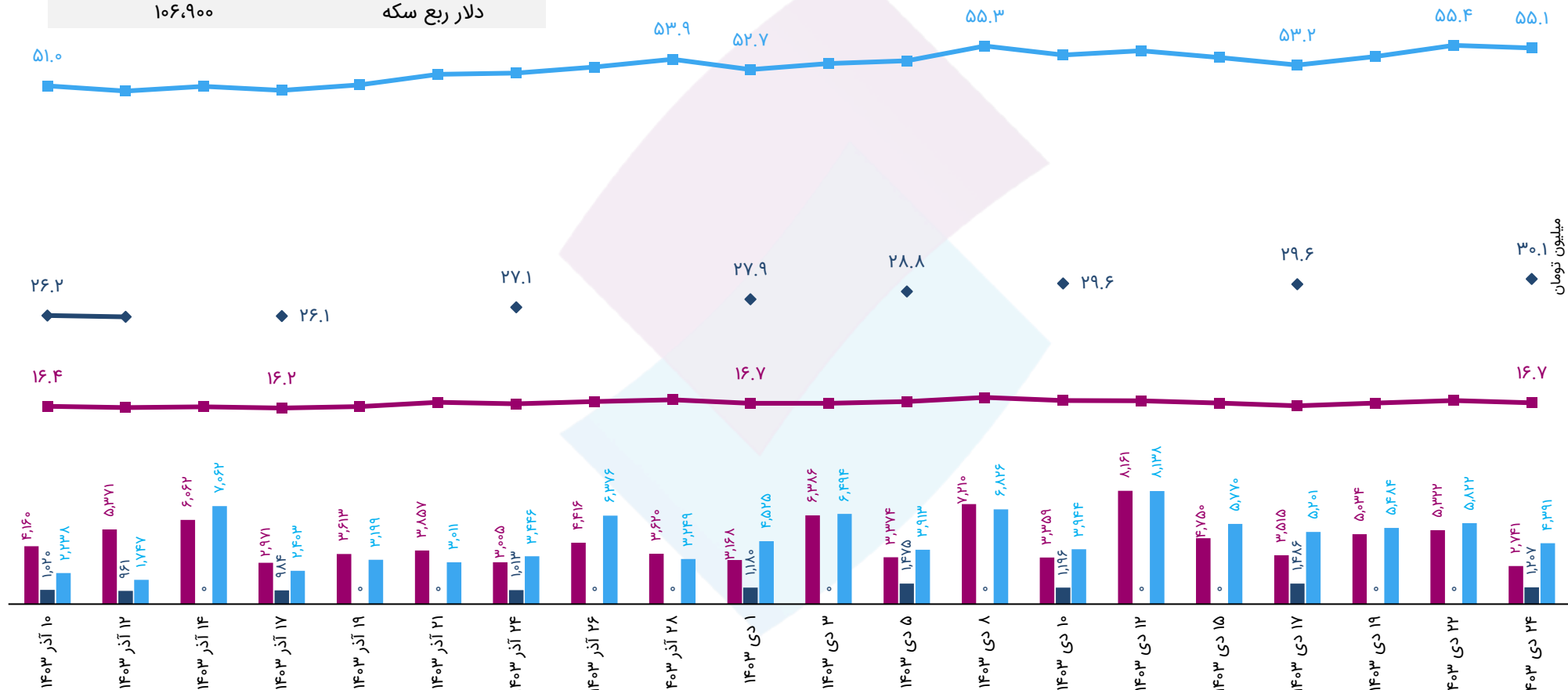
افزایش ۰.۳ درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۹۷ درصد و اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخرید به مبلغ ۲۲۷ همت



معامله ۷۰۸ هزار و ۳۵۹ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

۶۸،۵۹۲	دلار مرکز مبادله
۸۷،۹۰۰	دلار سکه تمام
۹۶،۲۰۰	دلار نیم سکه
۱۰۶،۹۰۰	دلار ربع سکه



معامله ۱۴ هزار و ۱۱۷ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

مبلغ در تاریخ آخرین حراج

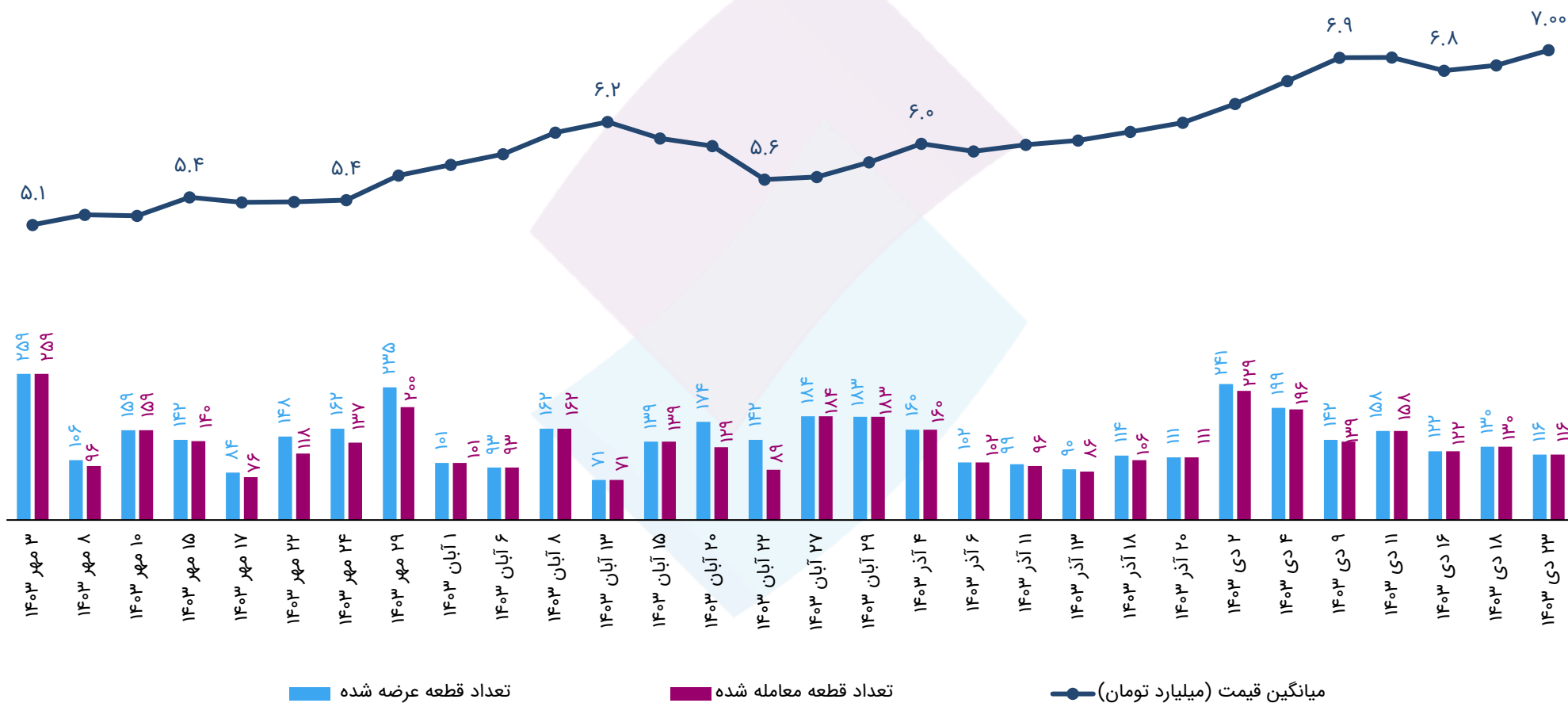
۶۸،۵۰۸

آخرین نرخ

دلار مرکز مبادله

۸۰،۹۰۰

دلار شمش طلا مرکز مبادله



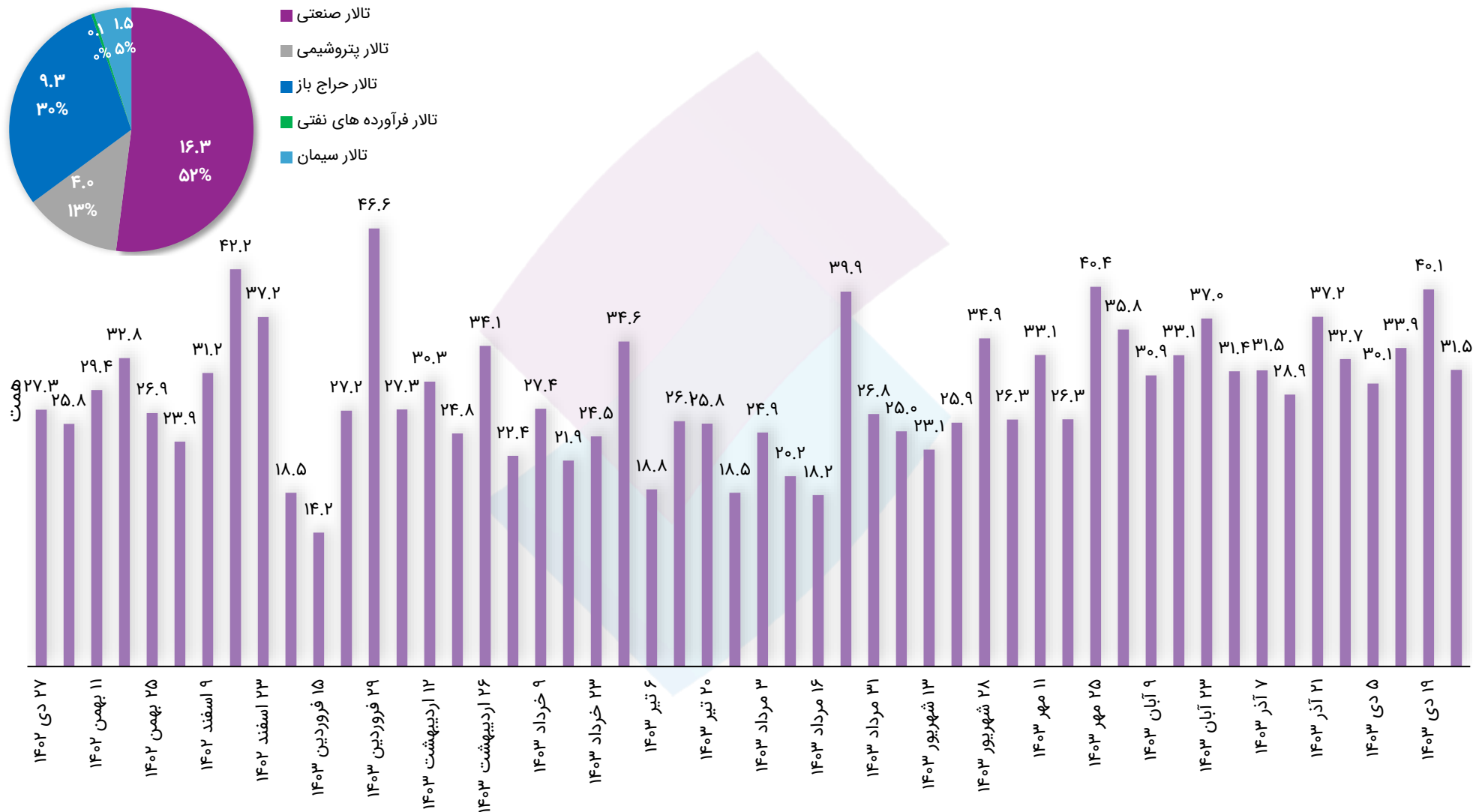
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۲.۴%	۲,۰۲۹	۱.۳%	۲,۶۵۲	۱.۰%	۲,۶۶۰	۲,۶۸۶	طلا (دلار/انس)
۷۹.۶%	۳۱۳,۰۱۰	۲.۳%	۵۴۹,۷۰۰	۰.۱%	۵۶۱,۳۰۰	۵۶۲,۱۰۰	سکه (هزار ریال)
۵۹.۷%	۴۲۹,۲۶۱	۸.۸%	۶۳۰,۰۵۶	۰.۲%	۶۸۳,۸۷۲	۶۸۵,۵۳۳	دلار اسکناس (ریال)
۶۸.۷%	۳۹۵,۲۶۹	۸.۸%	۶۱۲,۸۹۵	۰.۲%	۶۶۵,۲۴۵	۶۶۶,۸۶۱	دلار حواله (ریال)
۲.۸%	۷۸	۸.۳%	۷۴	۵.۱%	۷۶	۸۰	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۲۴.۸%	۴۳,۱۵۵	-۸.۵%	۱۰۶,۰۳۰	۲.۱%	۹۵,۰۴۴	۹۷,۰۱۱	بیت کوین (دلار)
۸.۹%	۸,۲۷۹	۰.۹%	۸,۹۳۲	۱.۹%	۸,۸۴۷	۹,۰۱۵	مس LME (دلار/تن)
۱۲.۴%	۲,۵۱۸	-۷.۵%	۳,۰۶۰	۱.۲%	۲,۷۹۷	۲,۸۳۱	روی LME (دلار/تن)
-۱۴.۱%	۵۰۷	-۰.۶%	۴۳۸	-۰.۸%	۴۳۹	۴۳۶	بیلت CIS (دلار/تن)
-۳.۳%	۴۵۹	-۳.۳%	۴۵۹	۰.۰%	۴۴۴	۴۴۴	بیلت ایران (دلار/تن)
۹.۶%	۲۸۰	۲.۳%	۳۰۰	۱.۰%	۳۰۴	۳۰۷	متانول CFR (\$/mt)
۱۴.۷%	۳۱۸	۷.۴%	۳۴۰	۳.۴%	۳۵۳	۳۶۵	سبذ اوره (mt/\$)
۲۲.۲%	۳.۲۵	۳۸.۳%	۲.۸۷	۸.۸%	۳.۶۵	۳.۹۷	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



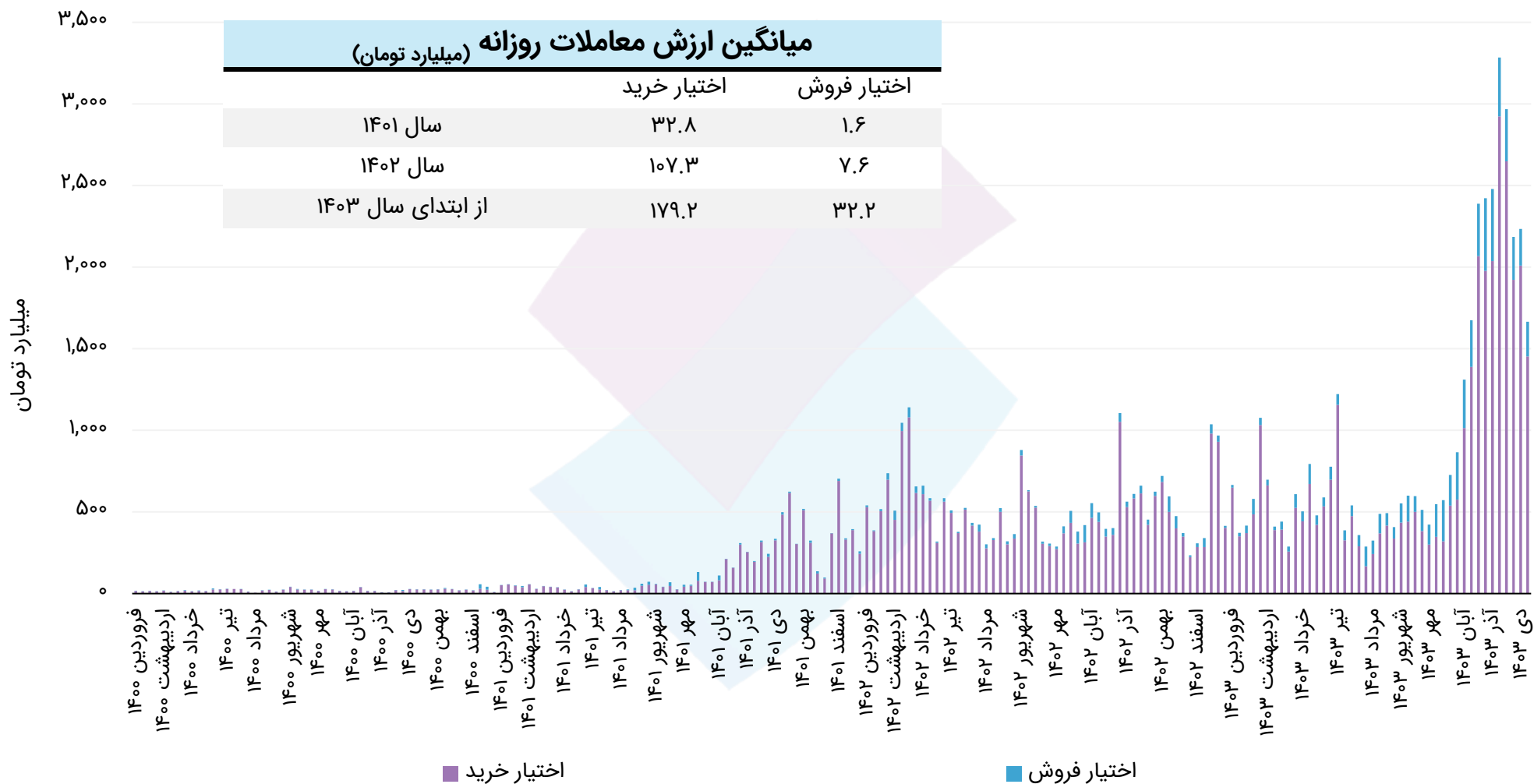
ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

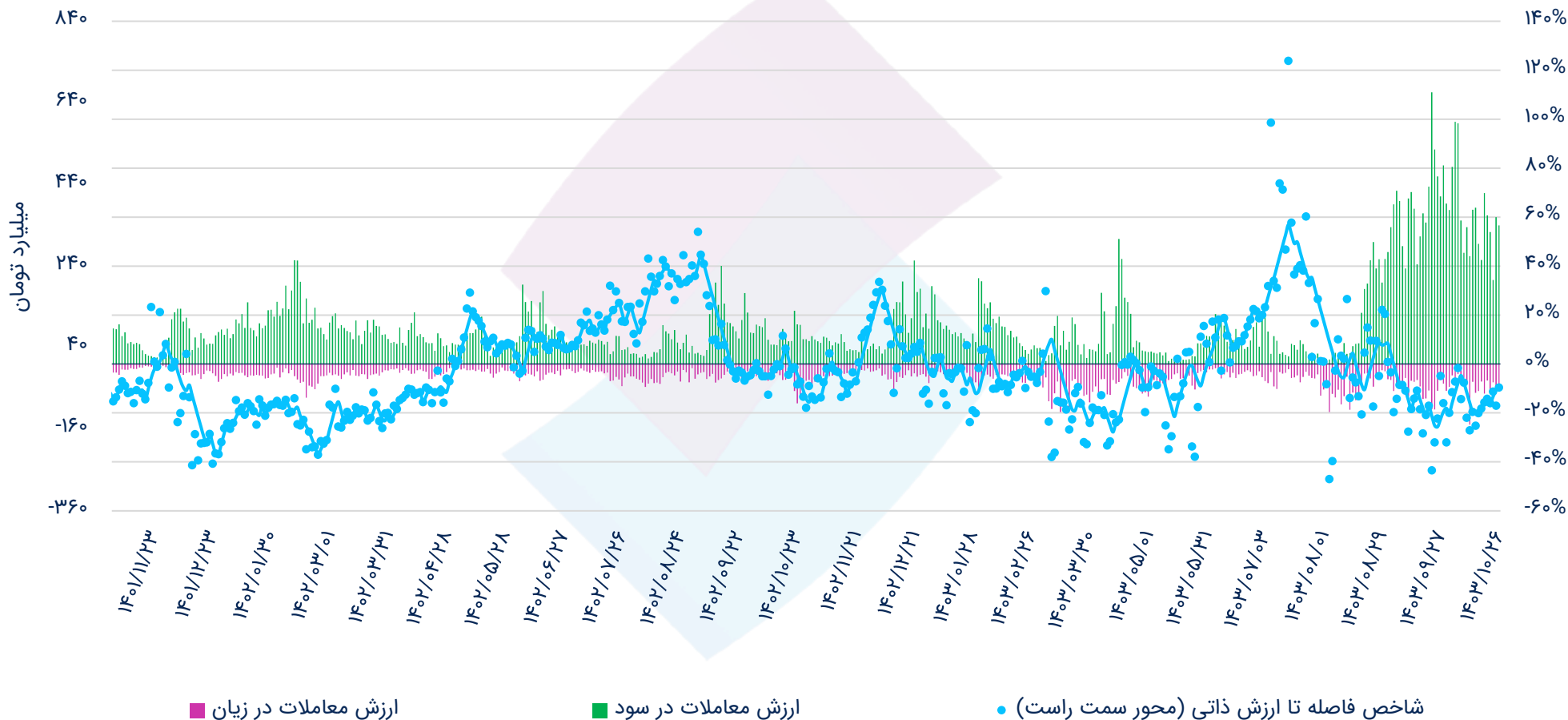
شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۸	۱۳۶,۳۰۰	پارس فولاد سبزواری، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر
پلی پروپیلن نساجی	۷۲.۱	۱۱,۱۸۶	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۵	۱,۱۴۳,۴۲۱	بین‌المللی ساروج بوشهر، توسعه گستر هلال خاورمیانه (سیمان مارگون)، ساروج اصفهان، سیمان آبیک، 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	۲۰۳.۱	۵,۳۲۵	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۵.۷	۱۲۸,۲۵۰	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، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، تولید فولاد تارا شمش یزد
کنسانتره سنگ آهن	۴.۱	۱۵۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، توسعه معدنی و صنعتی صبانور، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
گندله سنگ آهن	۵.۷	۳۴۰,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان
مس کاتد	۵۷۳.۶	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۲۹.۹	۴۶,۶۸۹	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد البرز ایرانیان، فولاد سپهر ایرانیان، فولاد شاهرود، مجتمع فولاد خراسان، فولاد کاوه اروند، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب
ورق گالوانیزه	۴۷.۲	۱۳,۰۵۰	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	۲۳.۰	۱۰۸,۵۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز
ورق گرم	۳۶.۰	۹۱,۳۴۰	فولاد مبارکه اصفهان، نورد و تولید قطعات فولادی، فولاد اکسین خوزستان، فولاد کاویان
مس مفتول	۶۸۲.۷	۱,۶۲۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران
تختال	۲۷.۳	۳۹,۶۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب، فولاد جهان آرا اروند
خاک روی	۲۲.۹	۱۰۷,۰۰۰	مجتمع سرب و روی انگوران



روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

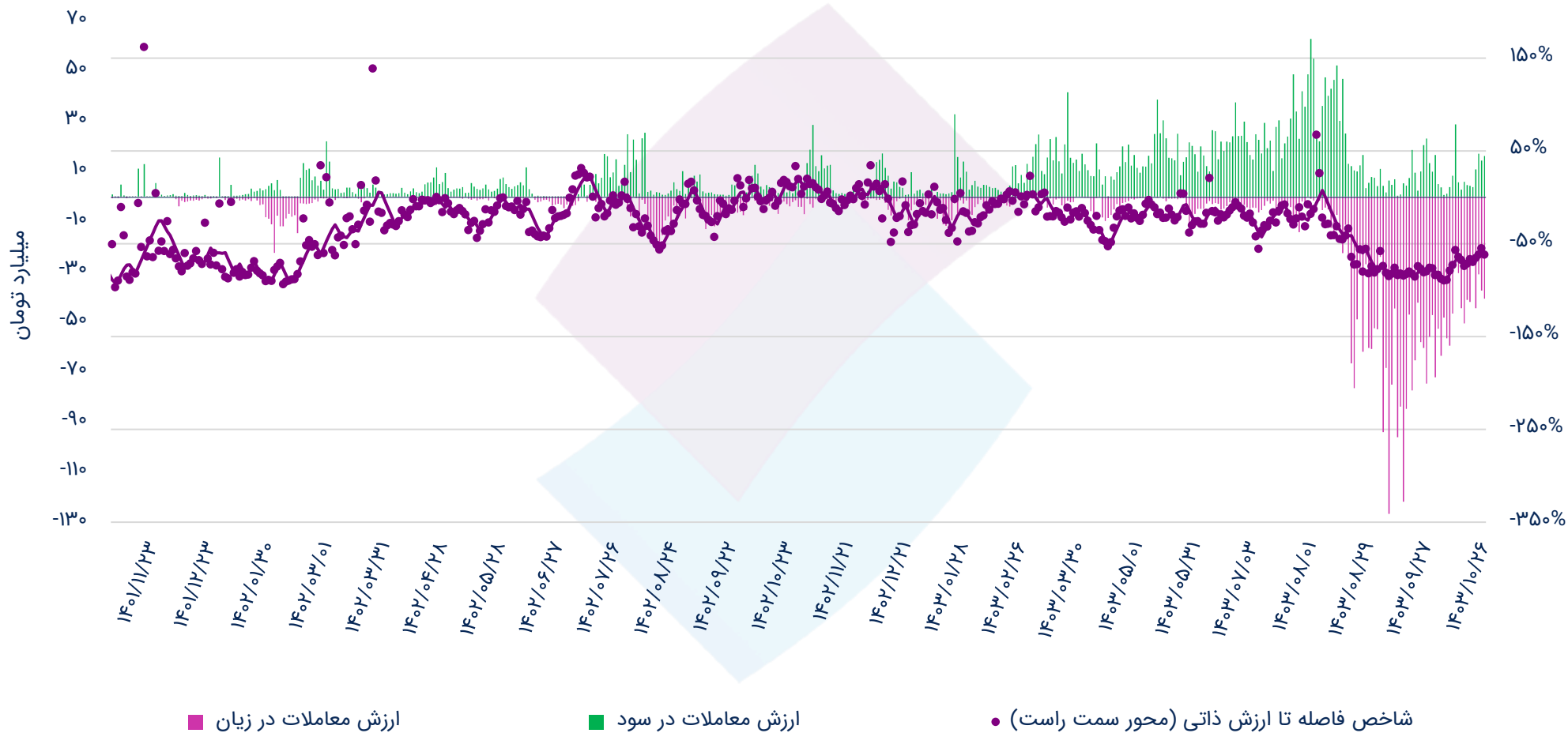


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

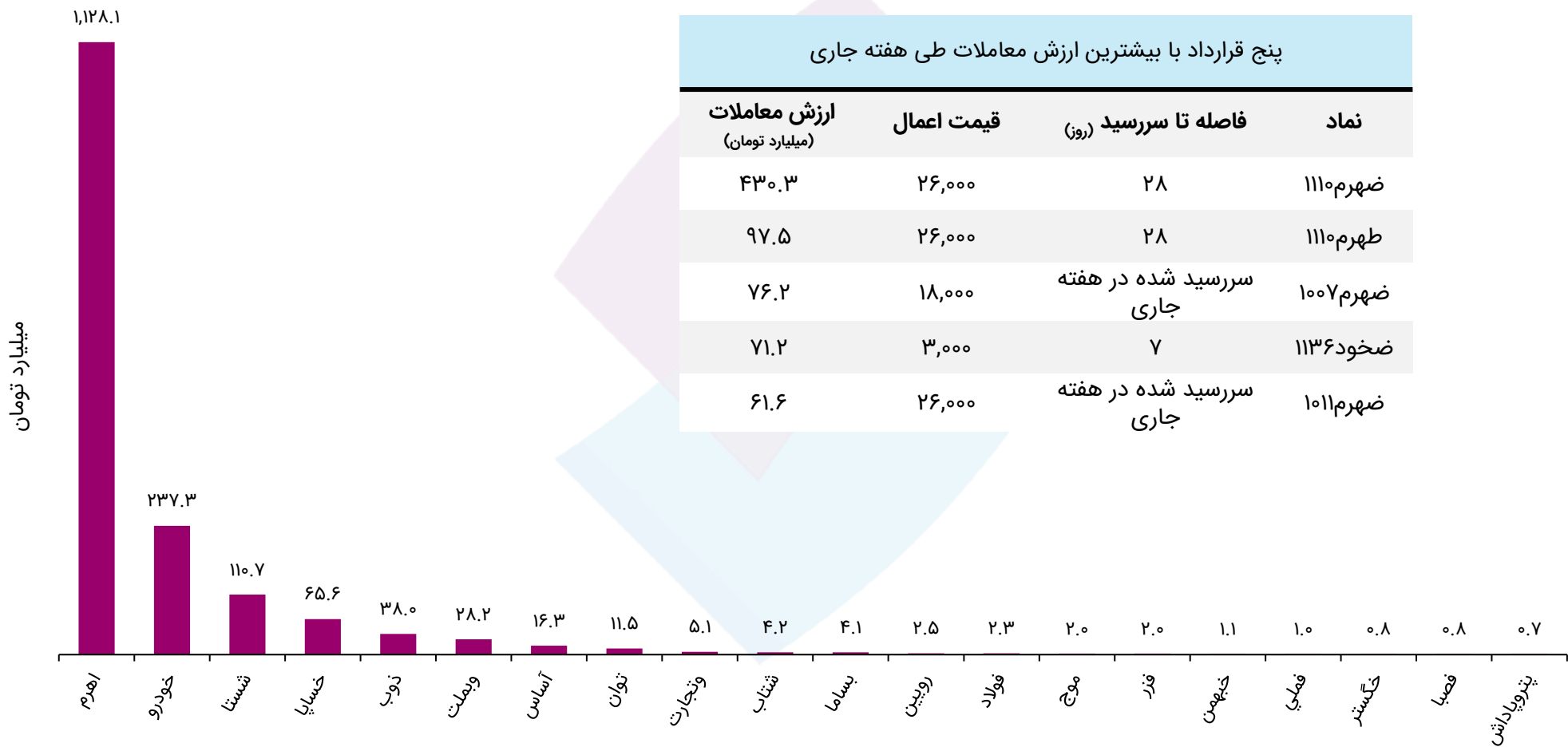
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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 ۱۱۰	۲۸	۲۶,۰۰۰	۴۳۰.۳
طهرم ۱۱۰	۲۸	۲۶,۰۰۰	۹۷.۵
ضهرم ۱۰۰۷	سررسید شده در هفته جاری	۱۸,۰۰۰	۷۶.۲
ضخود ۱۱۳۶	۷	۳,۰۰۰	۷۱.۲
ضهرم ۱۰۱۱	سررسید شده در هفته جاری	۲۶,۰۰۰	۶۱.۶

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

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

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