

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 ۳ بهمن - شماره ۱۸۶

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



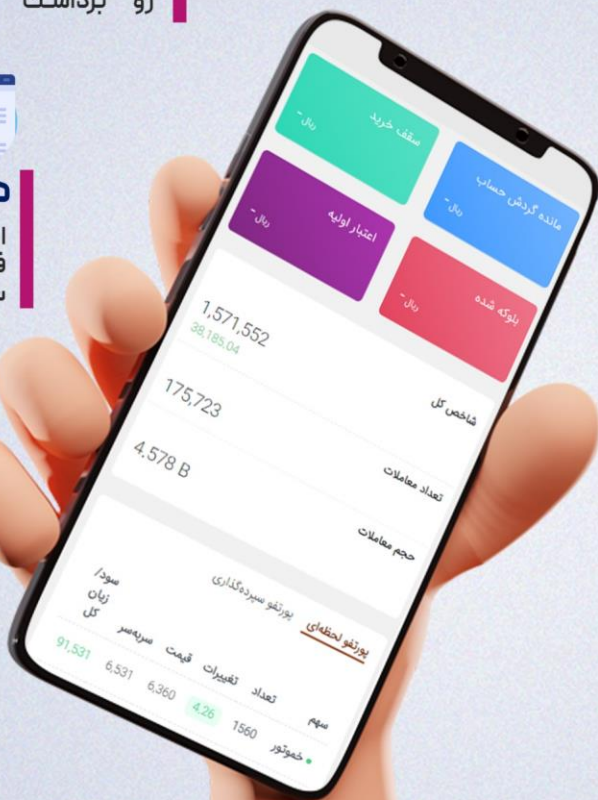
برداشت وجه آتی

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

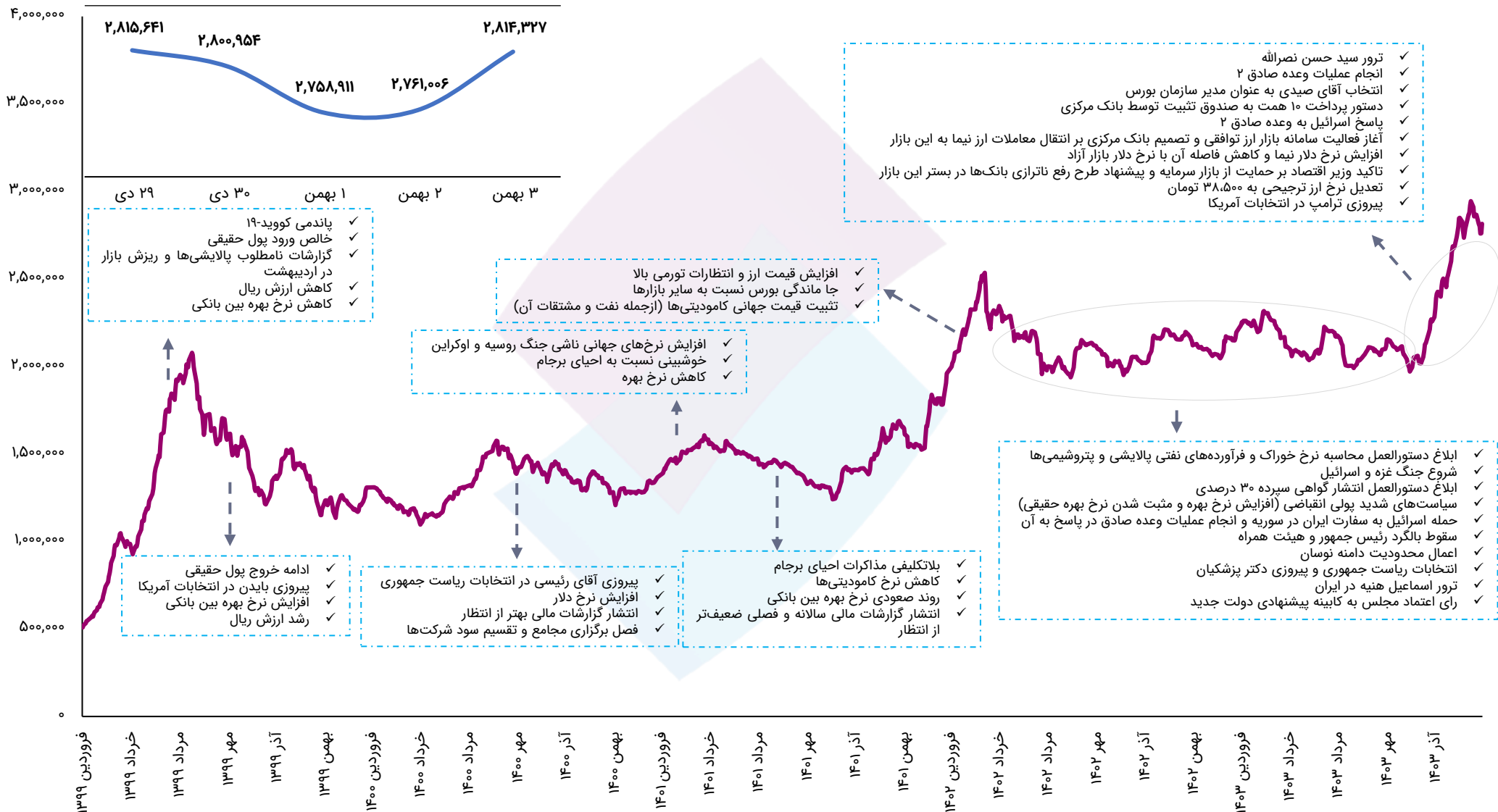
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



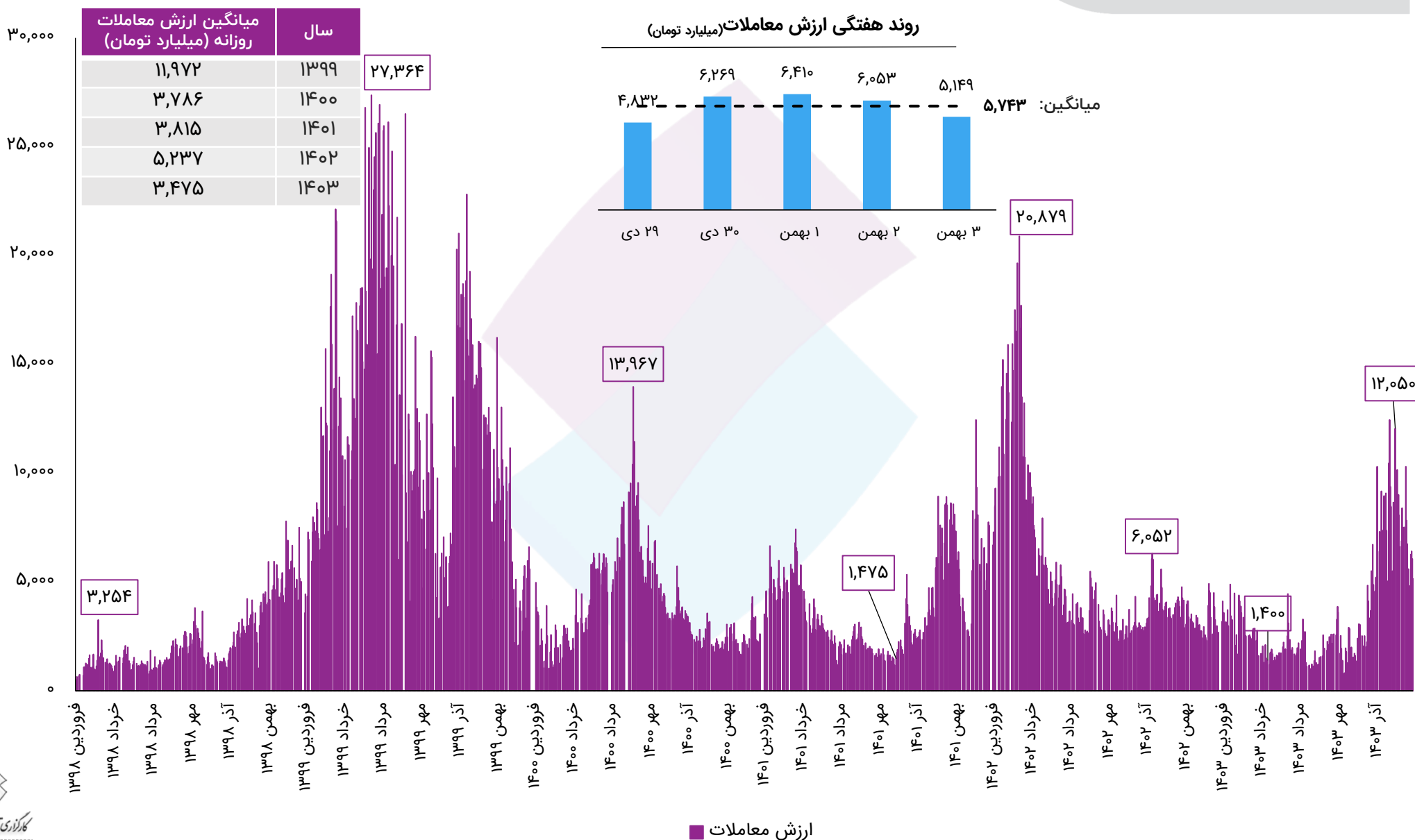
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

کاهش ۱.۸ درصدی شاخص کل در هفته جاری

روند هفتگی شاخص کل

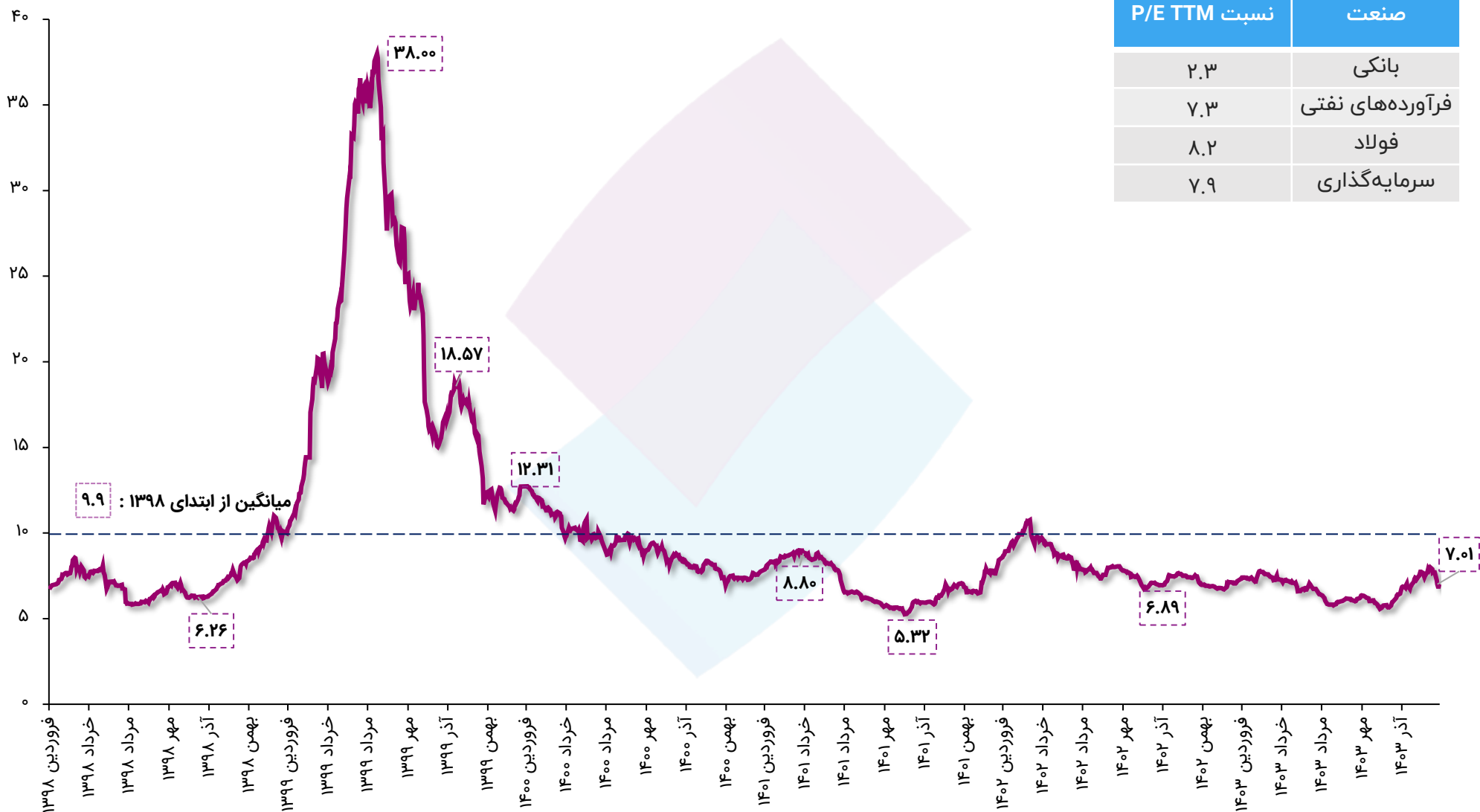


ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



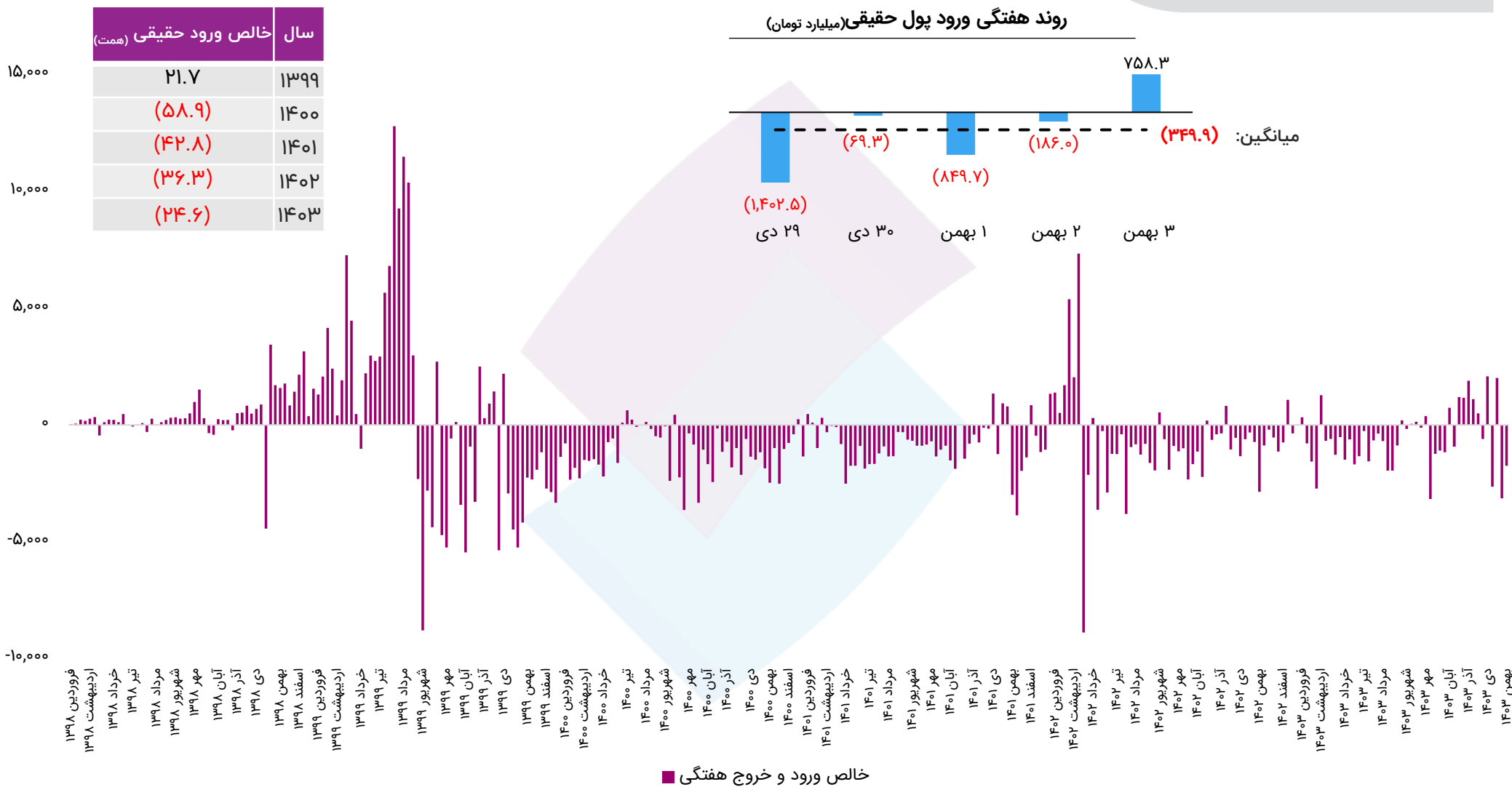
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران

نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۳	بانکی
۷.۳	فرآورده‌های نفتی
۸.۲	فولاد
۷.۹	سرمایه‌گذاری



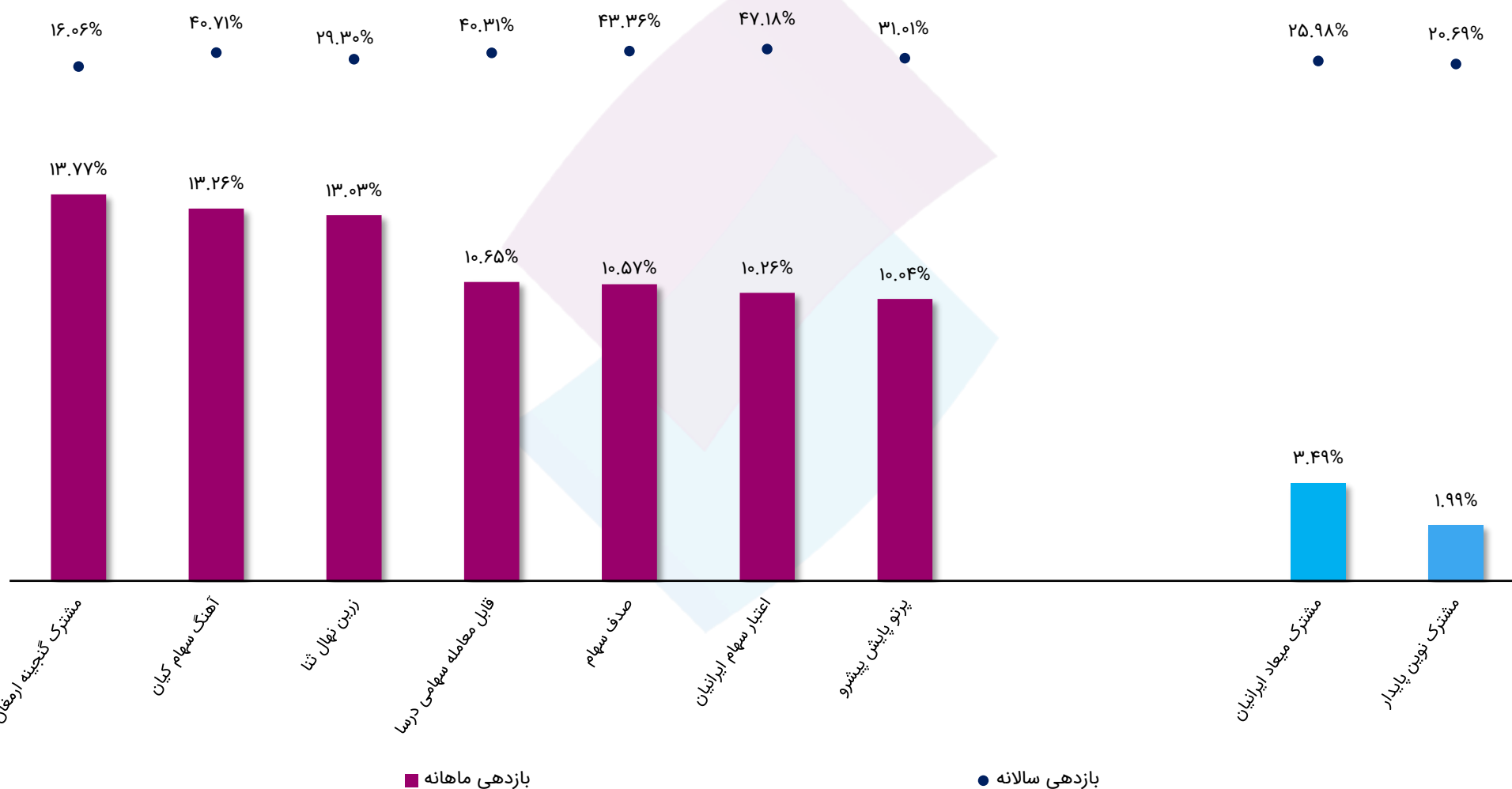
۱،۷۴۹ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۳،۱۴۲ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)

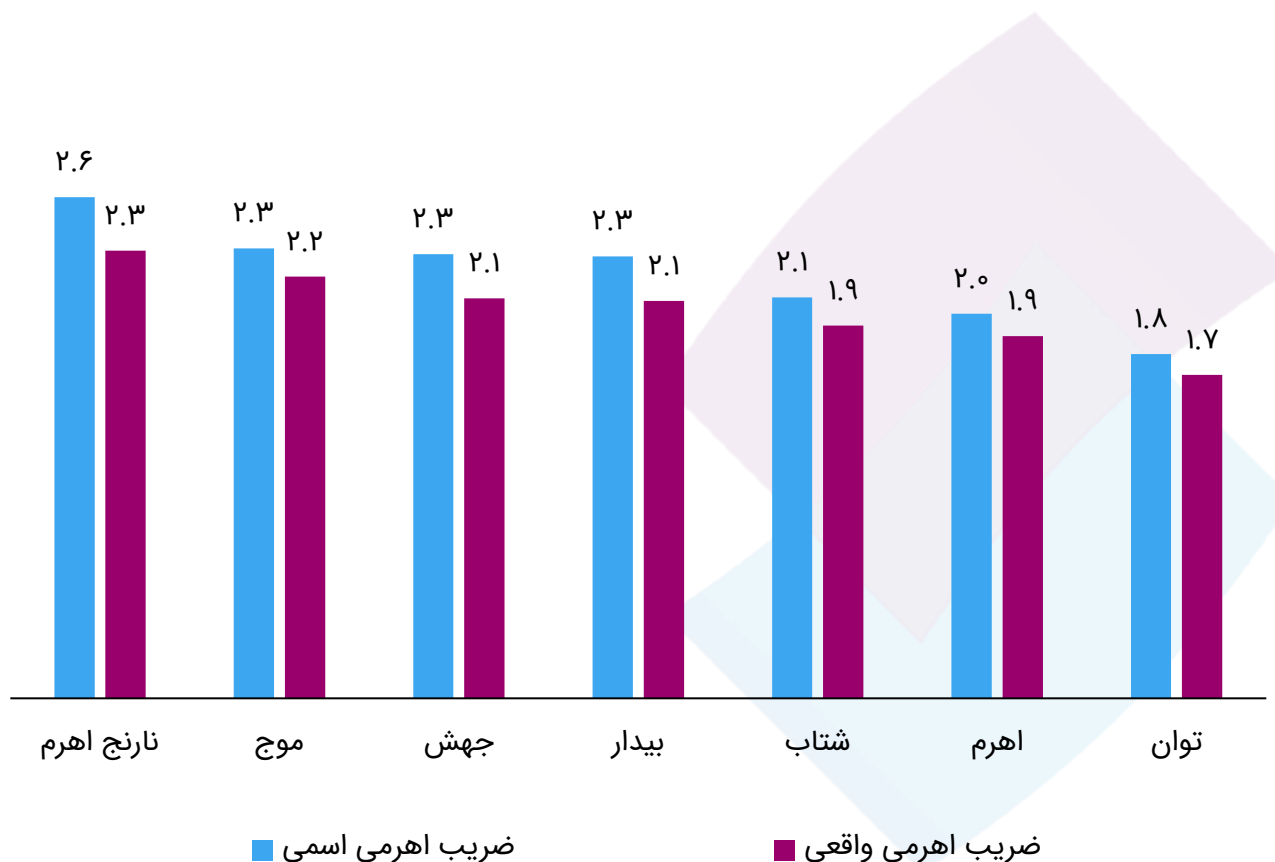


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
جهش	-۶.۷%	۱.۶
توان	-۶.۰%	۱.۶
نارنج اهرم	-۵.۴%	۱.۶
بیدار	-۵.۰%	۱.۶
شتاب	-۴.۴%	۱.۵
اهرم	-۳.۹%	۱.۶
موج	۱.۳%	۱.۵

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۷.۱%	۲.۵۳%
شتاب	۴.۶%	۲.۳۵%
جهش	-۲.۰%	۲.۵۳%
نارنج اهرم	-۲.۴%	۲.۵۳%
بیدار	-۴.۰%	۲.۵۲%
توان	-۴.۴%	۲.۲۴%
اهرم	-۵.۲%	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

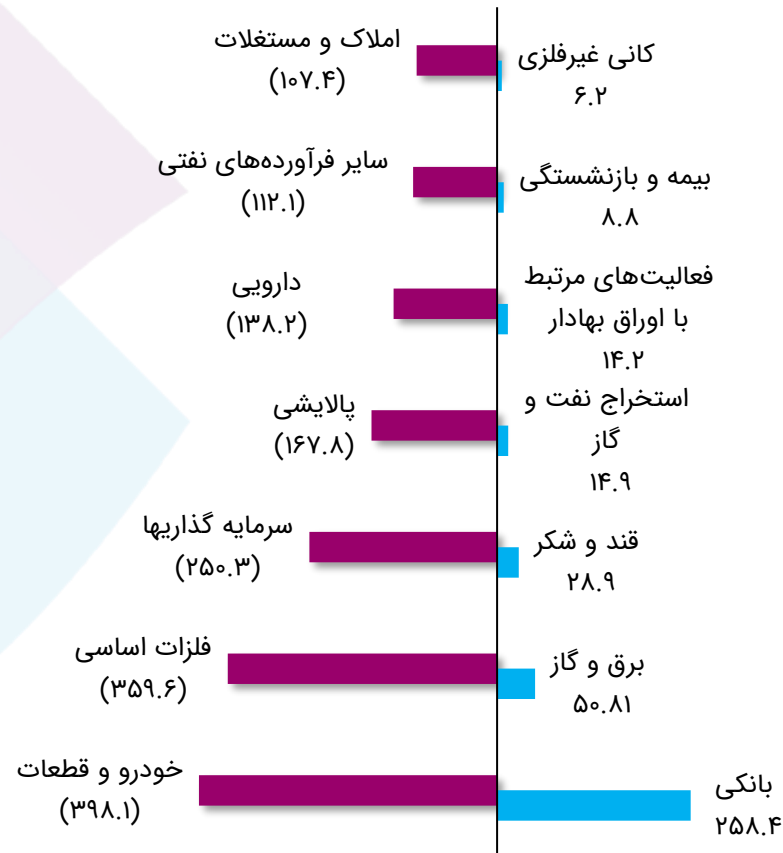
ضریب اهرمی واقعی = (خالص ارزش دارایی‌های صندوق - سپرده بانکی، اوراق و وجه نقد) / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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

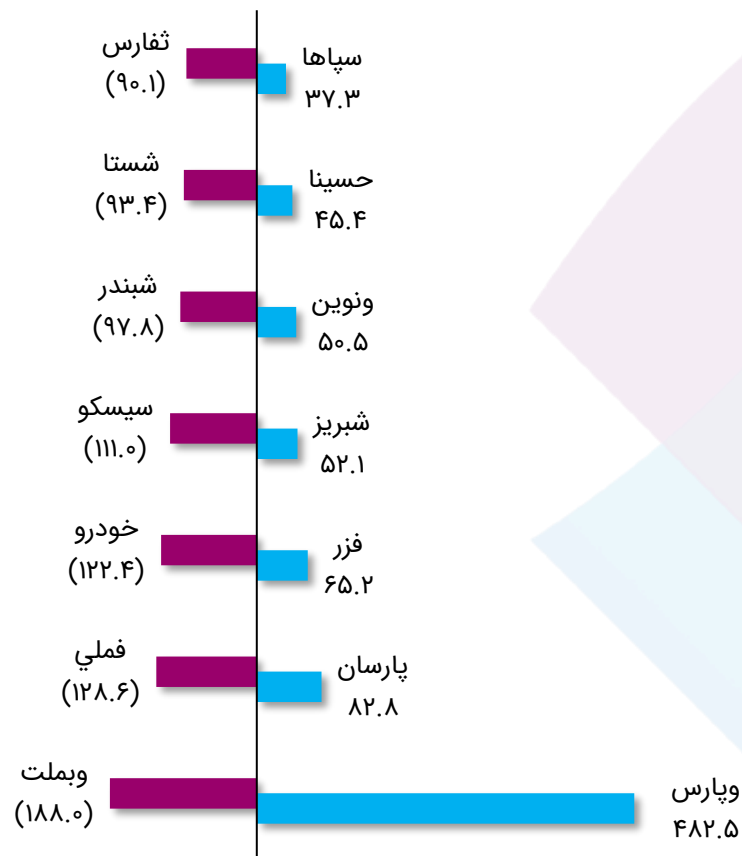
صنعت

میلیارد تومان



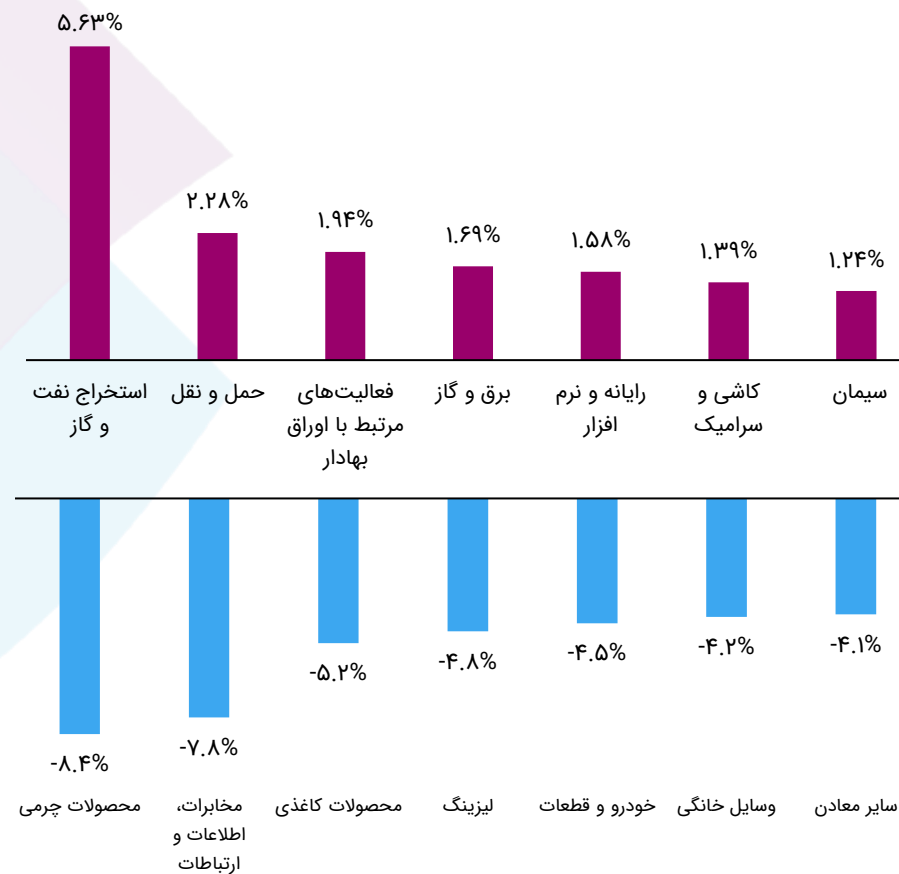
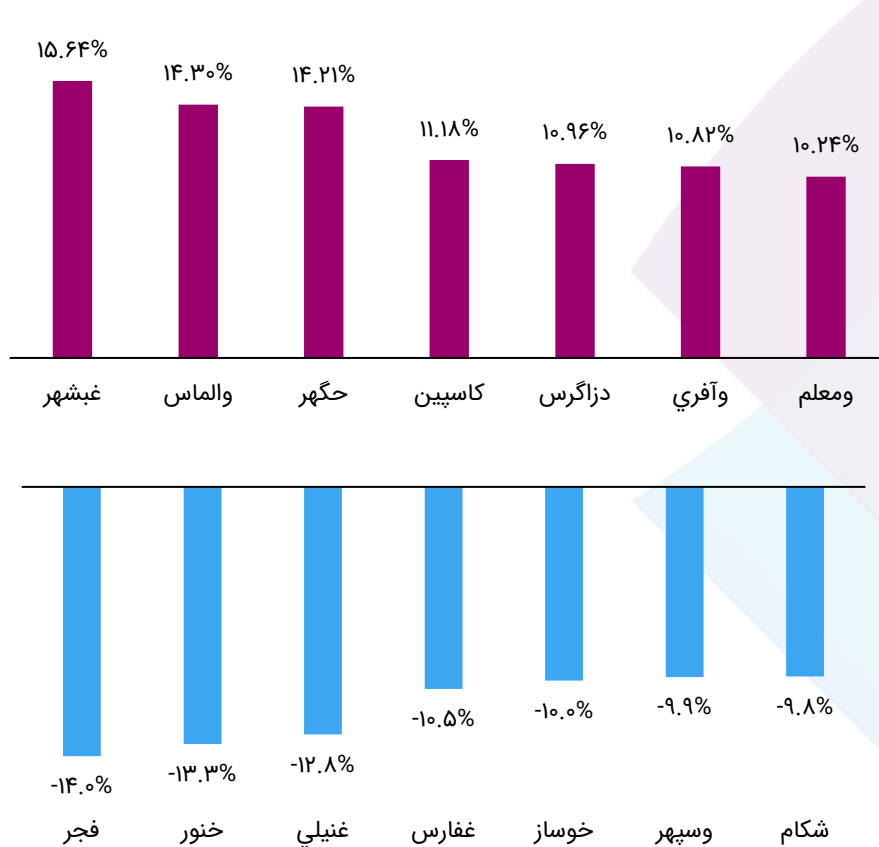
نماد

میلیارد تومان



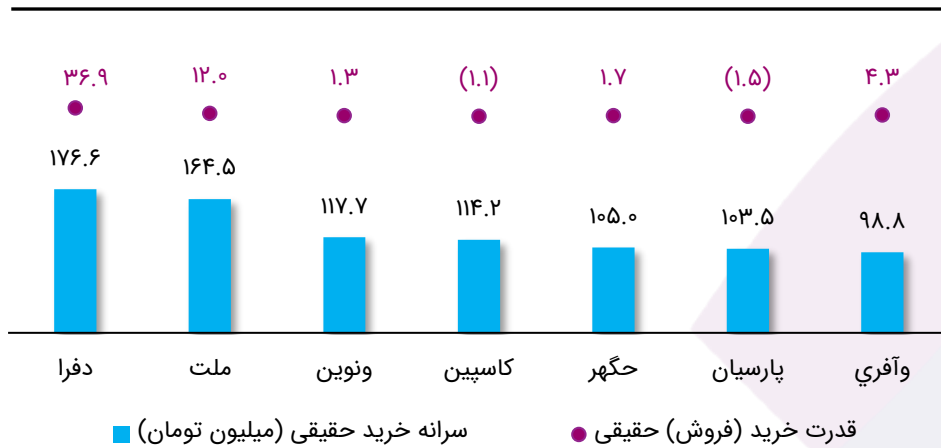
نماد

صنعت

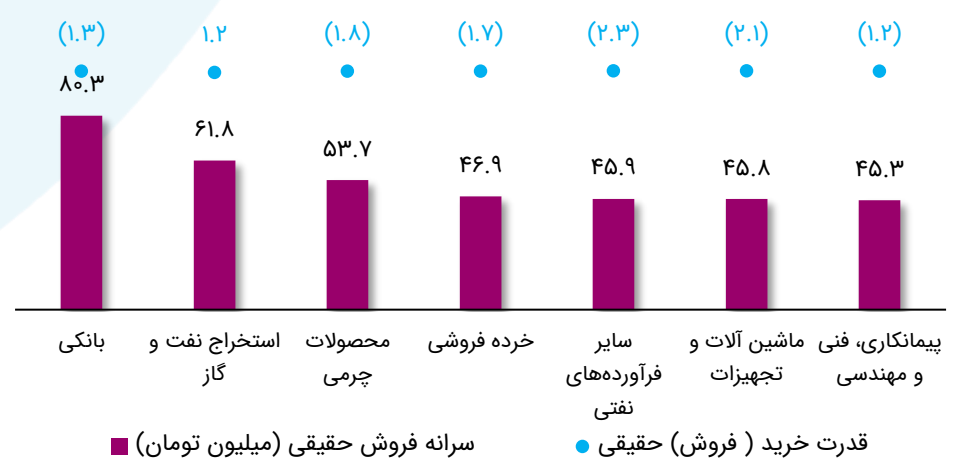
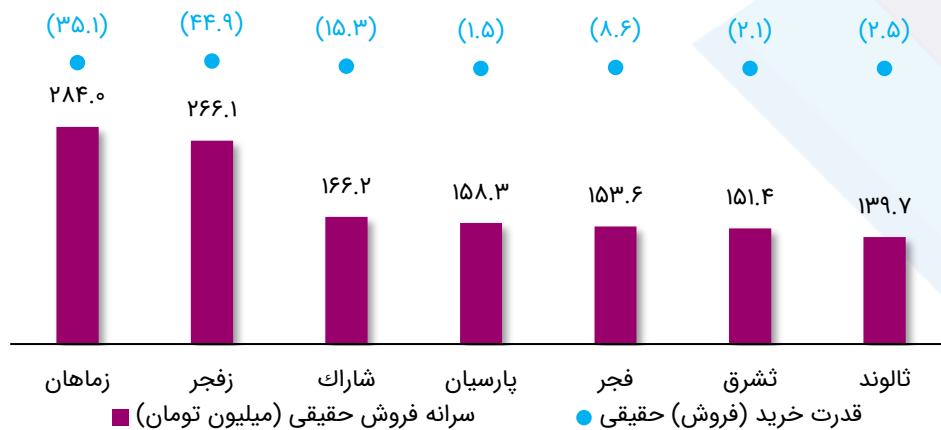
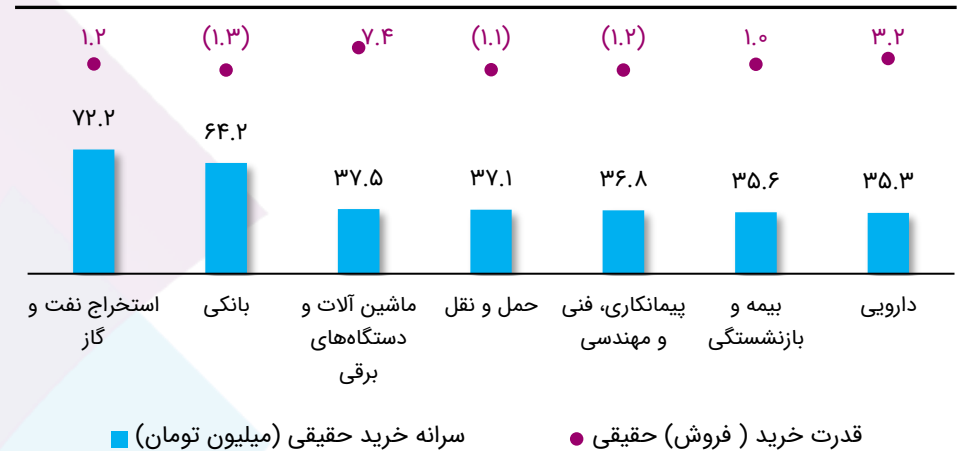


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



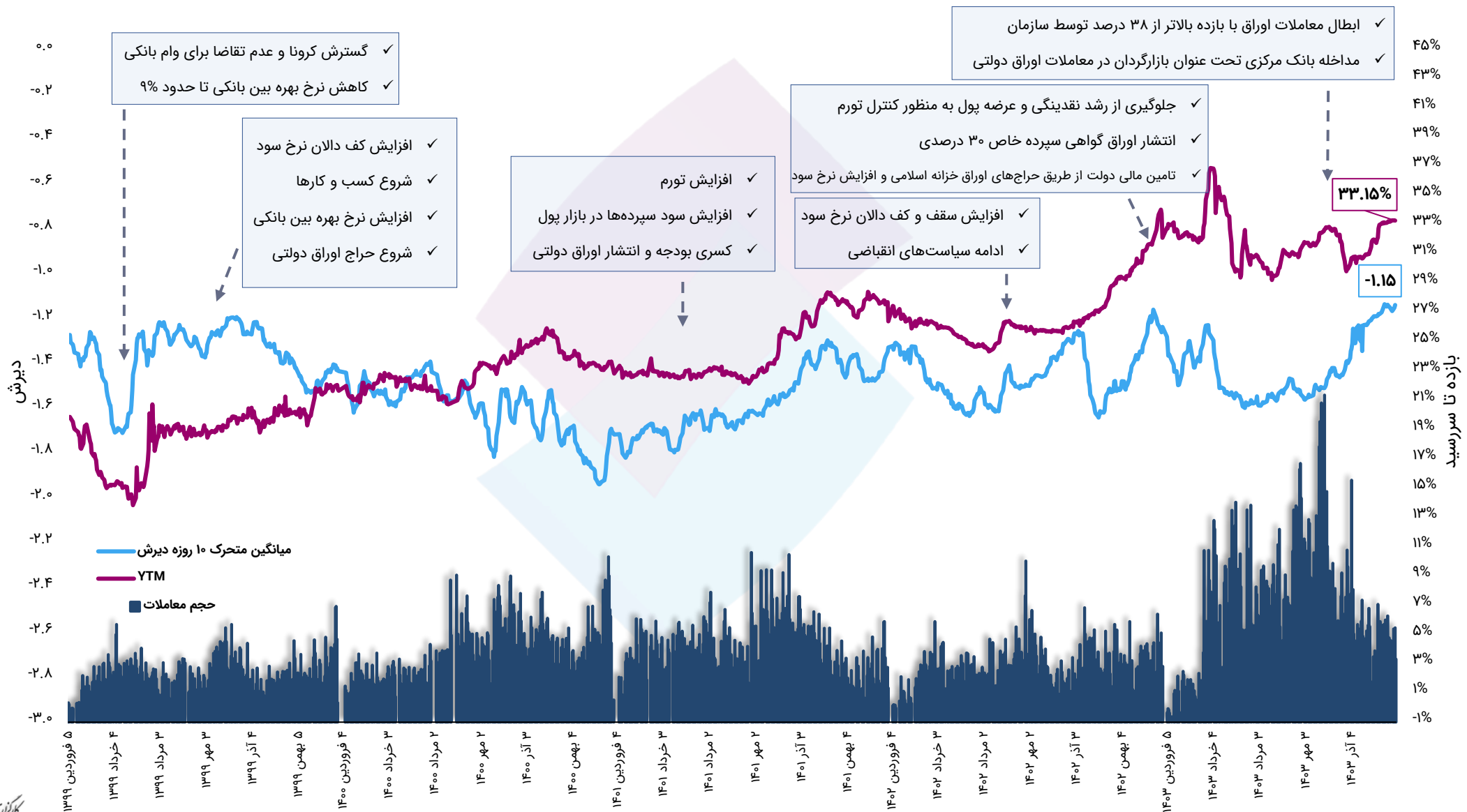
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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				
دابور	۱۸۰	۲۵۰	۳۹%	آوره نقدی سود انباشته
غمینو	۲۷۰	۵۸۵	۱۱۷%	اصلاح ساختار مالی، بهبود نسبت مالکانه
تکشا	۲۰	۸۰	۳۰۰%	اصلاح ساختار مالی
خزر	۴۹۴	۷۰۵	۴۳%	اصلاح ساختار مالی
ومعلم	۷۵۰	۱,۴۰۰	۸۷%	اصلاح ساختار مالی، توسعه سهم بازار، افزایش توانگری مالی و افزایش ظرفیت سرمایه گذاری
کایتا	۲۰	۵۰	۱۵۰%	اصلاح ساختار مالی
ومشان	۱۰۴	۲۰۸	۱۰۰%	افزایش سودآوری، اصلاح ساختار مالی و تقویت بنیه مالی شرکت، حفظ جایگاه شرکت در بازار سرمایه و امکان ارتقاء
وساپا	۱,۹۸۰	۲,۶۰۰	۳۱%	بهبود ساختار مالی و حفظ نقدینگی
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه:				
دالبر	۱,۲۰۰	۱,۴۰۰	۱۷%	آوره نقدی
صادر مجوز افزایش سرمایه				
ومعادن	۳۰,۰۰۰	۴۴,۵۰۰	۴۸%	مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر، جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر و اصلاح ساختار مالی
سپیدار	۷۰	۲۳۵	۲۳۶%	خرید و تجهیز ساختمان و تامین تجهیزات زیرساختی
خنصیر	۱۷۲	۲۶۰	۵۱%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی و بهره مندی از تخفیف مالیاتی مقرر در بند (ث) ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیرساخت ها

گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

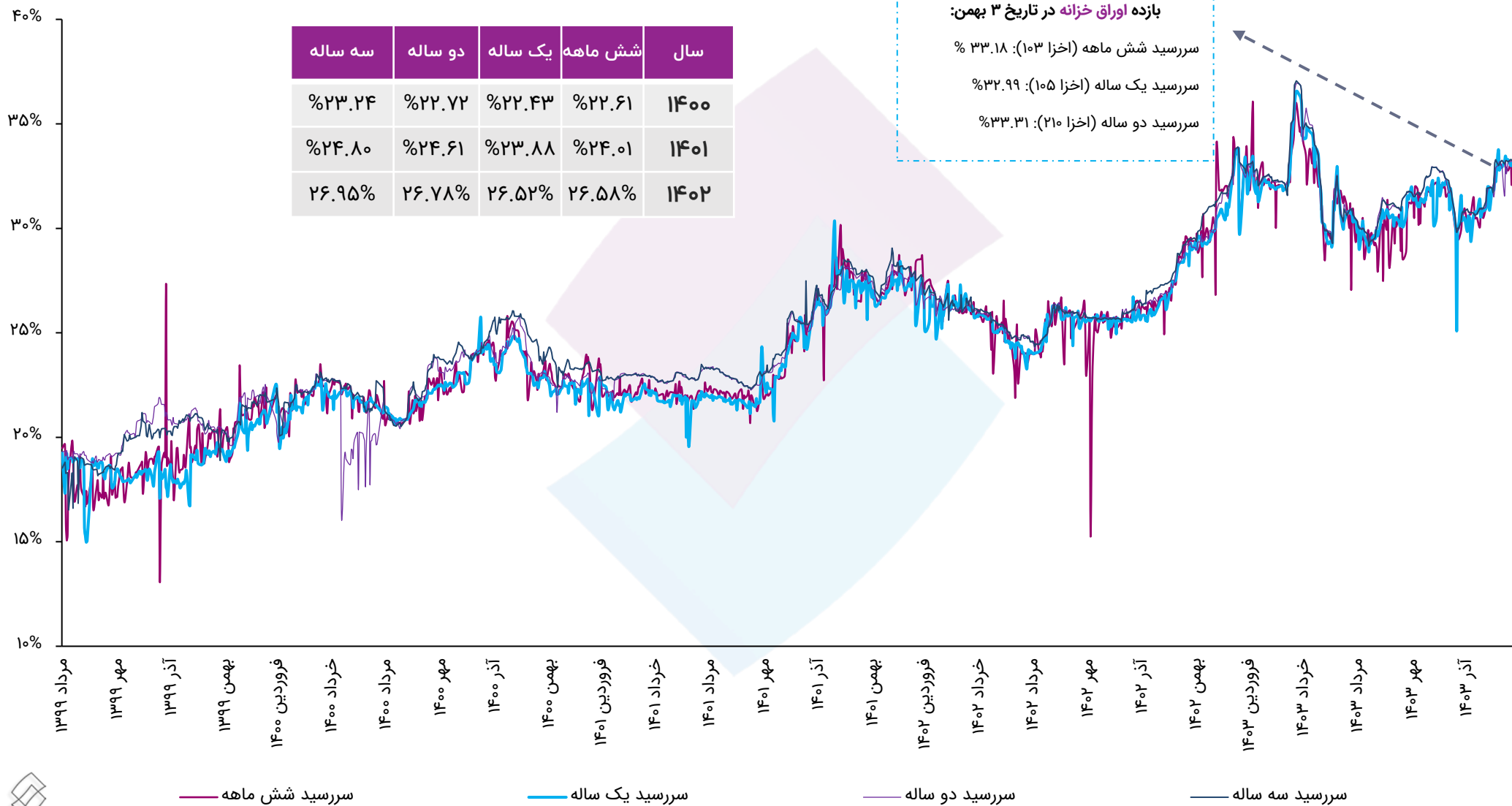
نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات محل افزایش سرمایه (درصد)	موضوع افزایش سرمایه
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه				
پسهند	۳۵	۸۶	۱۴۶%	آورده نقدی
ثقزوی	۲۰	۱۰۰	۴۰۰%	آورده نقدی
غکرووش	۲,۰۰۰	۴,۴۰۰	۱۲۰%	سود انباشته
نمرینو	۴۰	۱۵۰	۲۷۵%	سود انباشته
اعلامیه پذیره نویسی عمومی				
زگلدشت	۷۰	۳۷۰	۴۲۹%	آورده نقدی
آگهی ثبت افزایش سرمایه				
فسازان	۴۰۰	۵۰۰	۲۵%	سود انباشته
کوبر	۵۲۲	۶۳۱	۲۱%	سود انباشته
دسبحان	۵۳۳	۶۸۲	۲۸%	سود انباشته
ثپردیس	۲۰۰	۳۵۰	۷۵%	سود انباشته
ساینا	۲۵	۲۱۰	۷۴۰%	آورده نقدی
تکاردان	۲,۵۰۰	۳,۰۰۰	۲۰%	سود انباشته
شکام	۷۷۰	۱,۲۲۰	۵۸%	سود انباشته

افزایش ۰.۰۷ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۳.۱۵ درصد

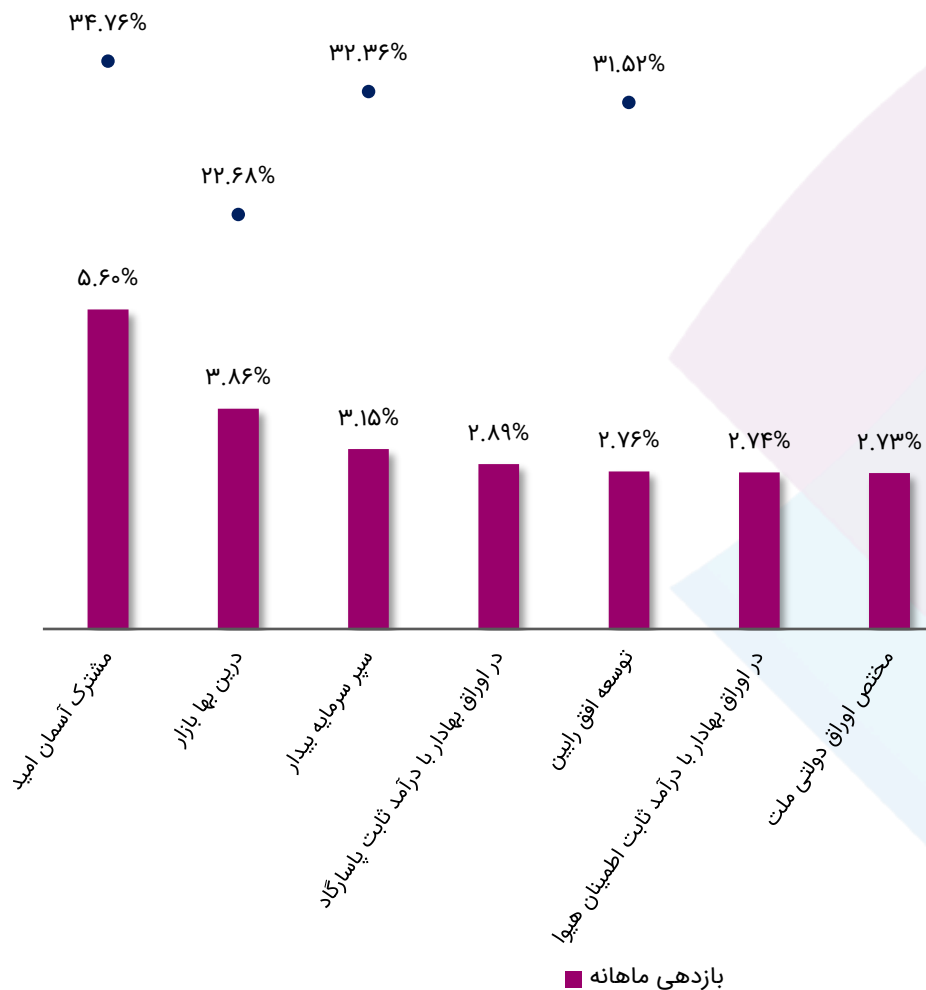


بازده تا سررسید

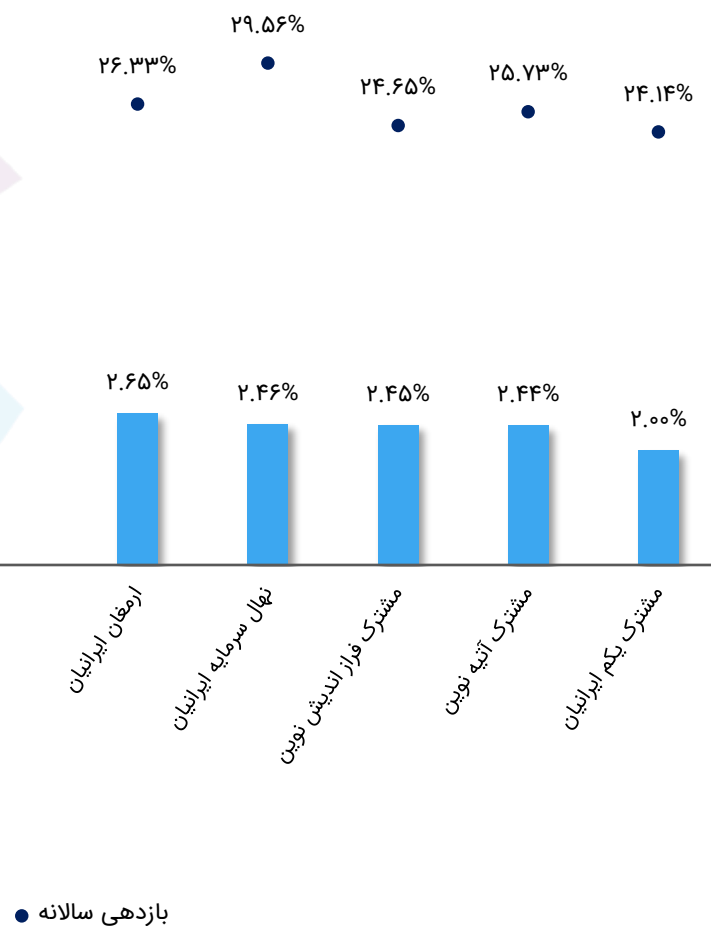
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

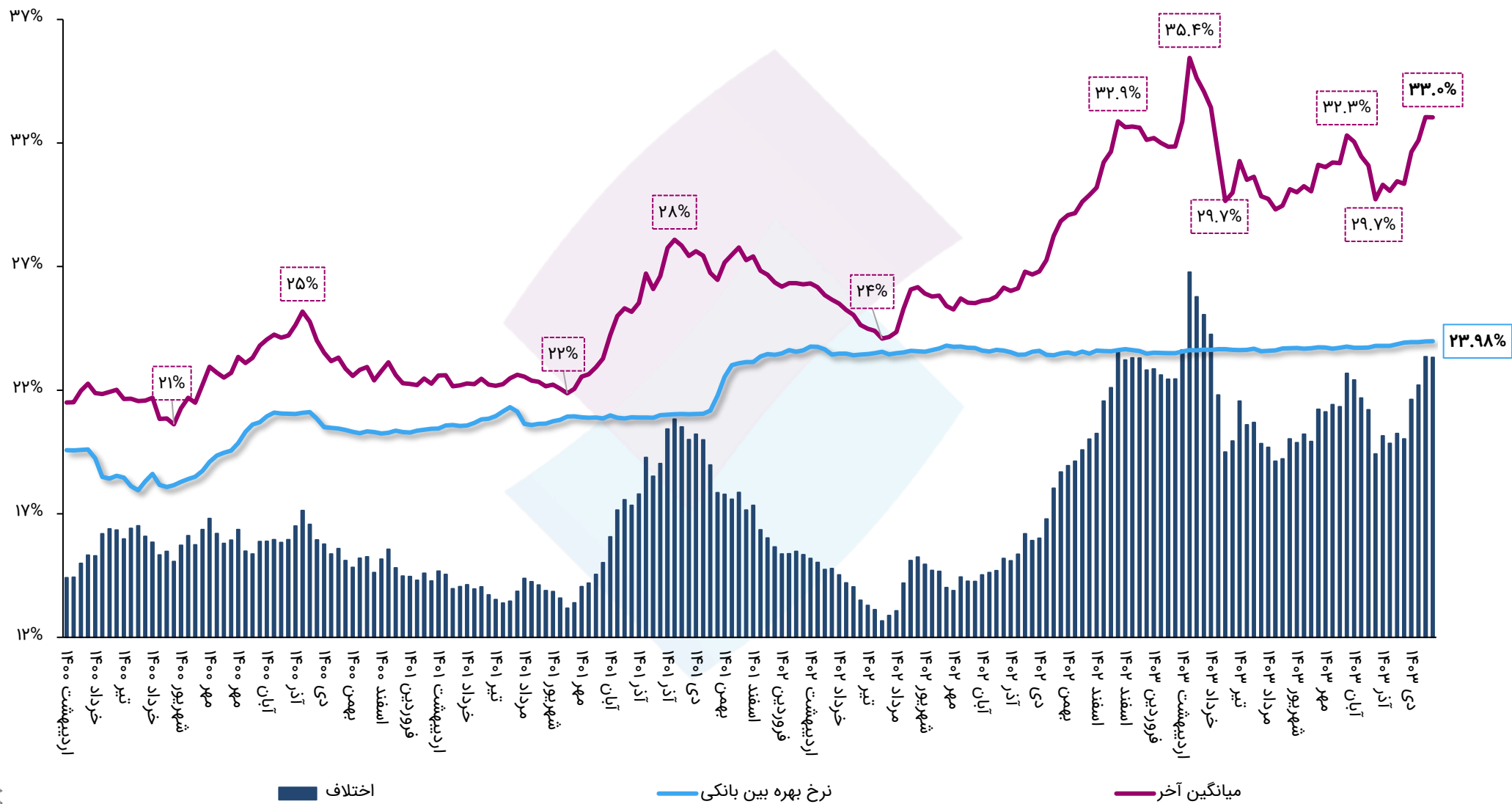


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

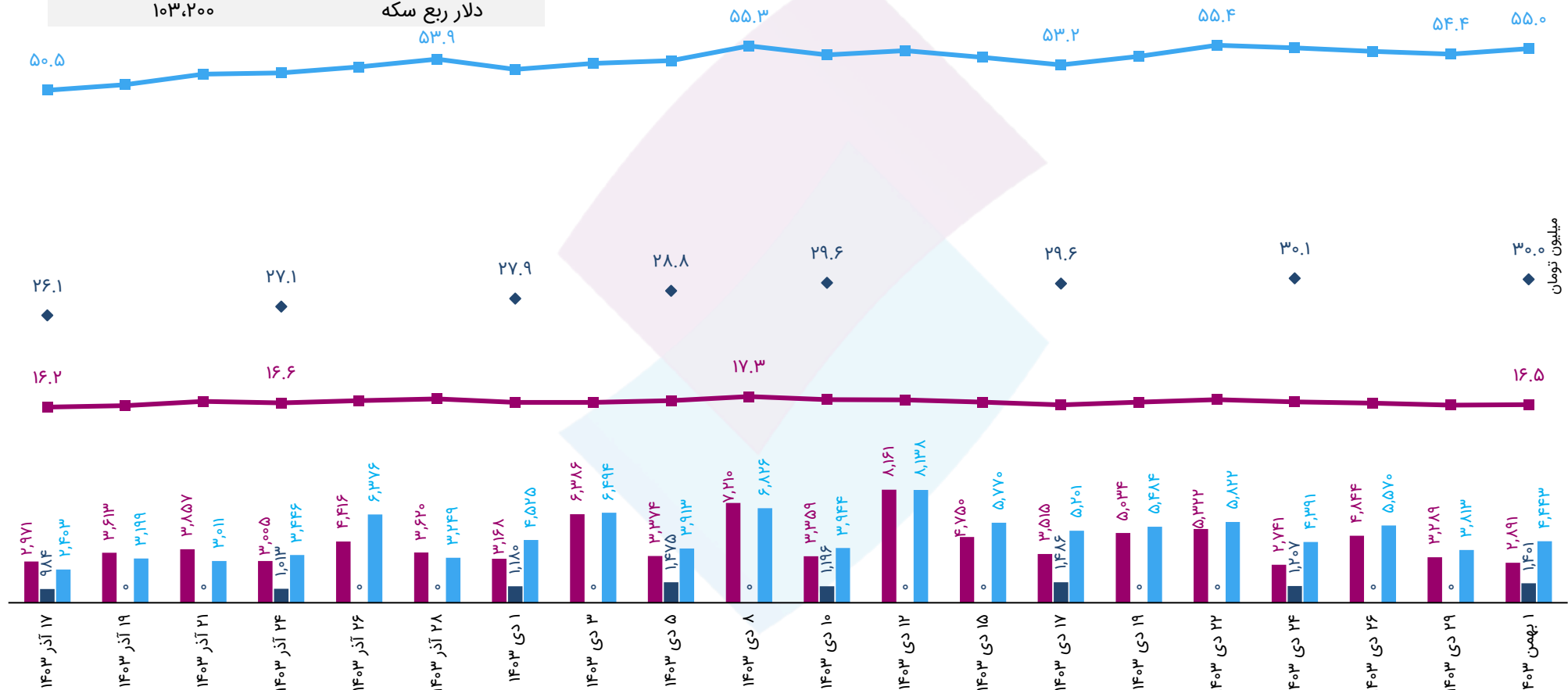




معامله ۷۳۴ هزار و ۶۱۰ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

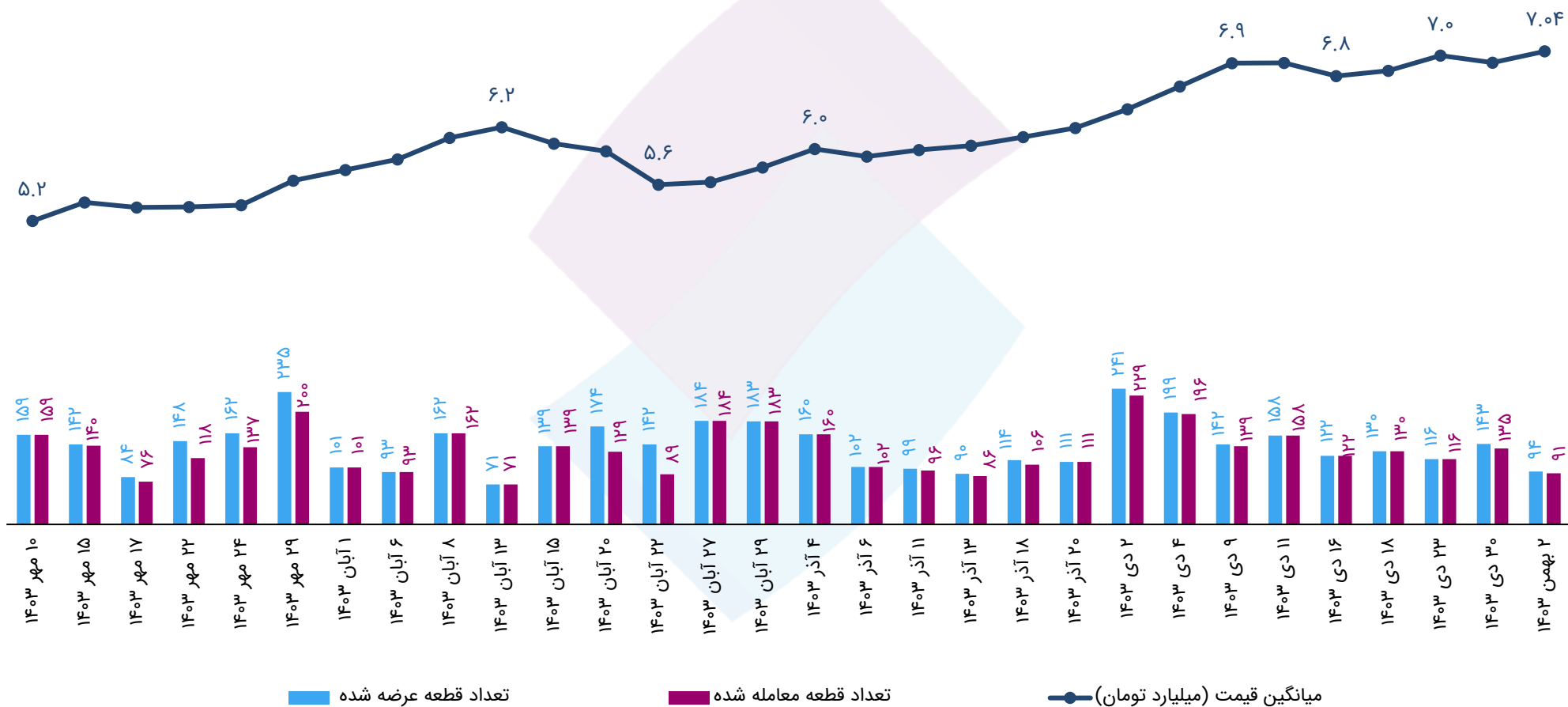
۶۸،۵۱۸	دلار مرکز مبادله
۸۶،۲۰۰	دلار سکه تمام
۹۴،۰۰۰	دلار نیم سکه
۱۰۳،۲۰۰	دلار ربع سکه



قیمت سکه تمام — قیمت سکه نیم — تعداد سکه تمام معامله شده — تعداد سکه نیم معامله شده — تعداد سکه ربع معامله شده

معامله ۱۴ هزار و ۳۴۳ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)	در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۶۸،۵۱۹	
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۷۹،۹۱۶	



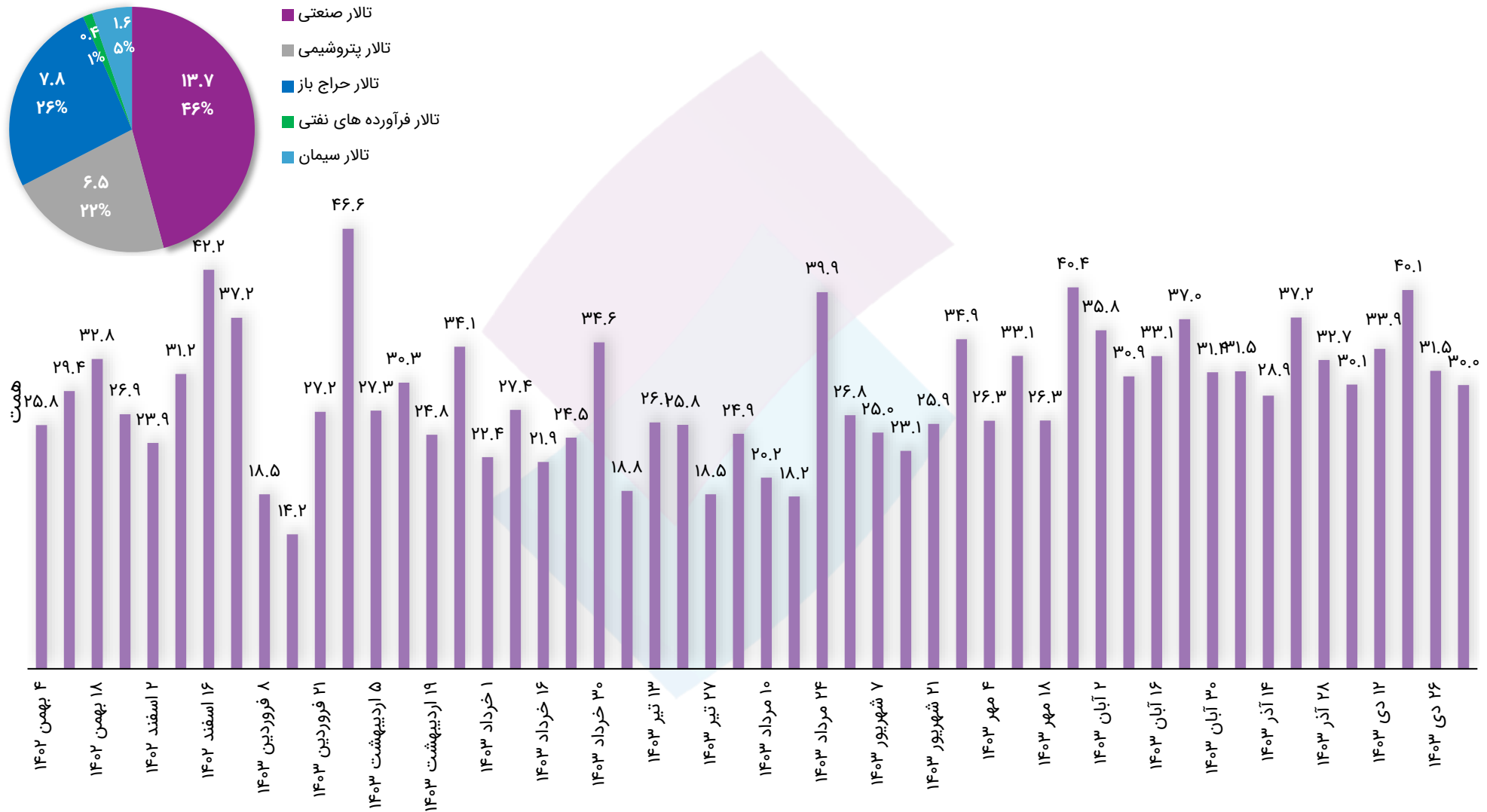
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۵.۷%	۲,۰۲۹	۵.۴%	۲,۶۱۲	۲.۲%	۲,۶۹۵	۲,۷۵۴	طلا (دلار/انس)
۸۱.۲%	۳۲۶,۱۰۰	۷.۳%	۵۵۰,۷۵۰	۵.۳%	۵۶۱,۲۵۰	۵۹۰,۹۵۰	سکه (هزار ریال)
۵۹.۵%	۴۲۹,۲۲۸	۴.۳%	۶۵۶,۳۰۲	-۰.۱%	۶۸۵,۵۳۳	۶۸۴,۶۸۱	دلار اسکناس (ریال)
۶۸.۵%	۳۹۵,۲۳۶	۴.۳%	۶۳۸,۴۲۶	-۰.۱%	۶۶۶,۸۶۱	۶۶۶,۰۳۲	دلار حواله (ریال)
-۰.۲%	۸۰	۹.۱%	۷۳	-۳.۰%	۸۲	۸۰	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۶۲.۹%	۳۹,۸۴۶	۱۰.۶%	۹۴,۶۸۶	۴.۲%	۱۰۰,۵۰۴	۱۰۴,۷۴۷	بیت کوین (دلار)
۹.۵%	۸,۲۸۳	۲.۶%	۸,۸۳۸	۰.۵%	۹,۰۱۹	۹,۰۶۶	مس LME (دلار/تن)
۱۵.۷%	۲,۴۹۴	-۳.۷%	۲,۹۹۶	۳.۴%	۲,۷۹۱	۲,۸۸۷	روی LME (دلار/تن)
-۱۶.۴%	۵۱۴	-۲.۰%	۴۳۹	-۱.۲%	۴۳۶	۴۳۰	بیلت CIS (دلار/تن)
-۵.۱%	۴۵۵	-۵.۱%	۴۵۵	-۲.۷%	۴۴۴	۴۳۲	بیلت ایران (دلار/تن)
۹.۰%	۲۷۹	۰.۰%	۳۰۴	-۱.۰%	۳۰۷	۳۰۴	متانول CFR (\$/mt)
۱۳.۹%	۳۳۸	۱۰.۳%	۳۵۰	۵.۶%	۳۶۵	۳۸۵	سبب اوره (mt/\$)
۷۵.۳%	۲.۱۵	۳۰.۴%	۲.۸۹	-۷.۶%	۴.۰۸	۳.۷۷	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



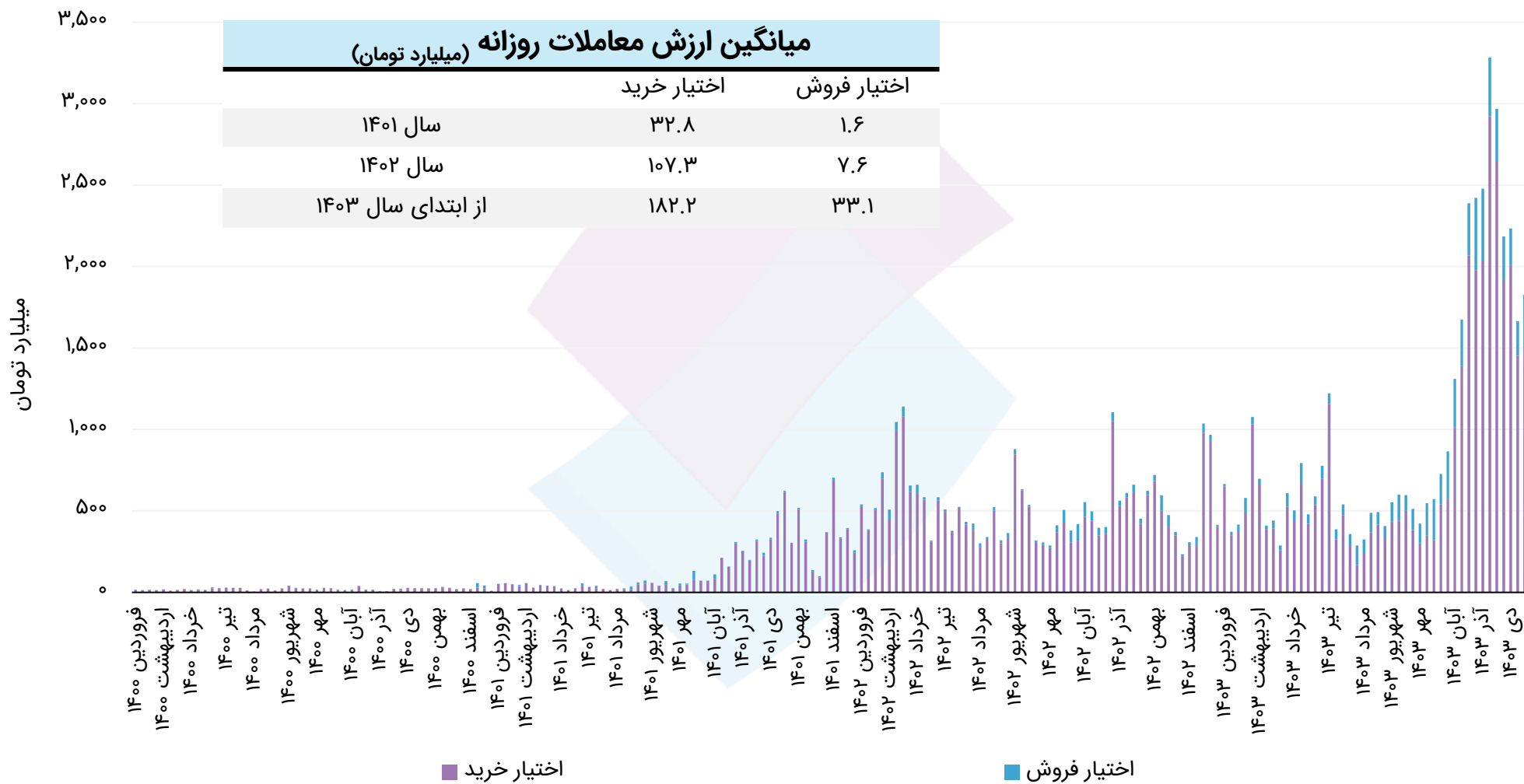
ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

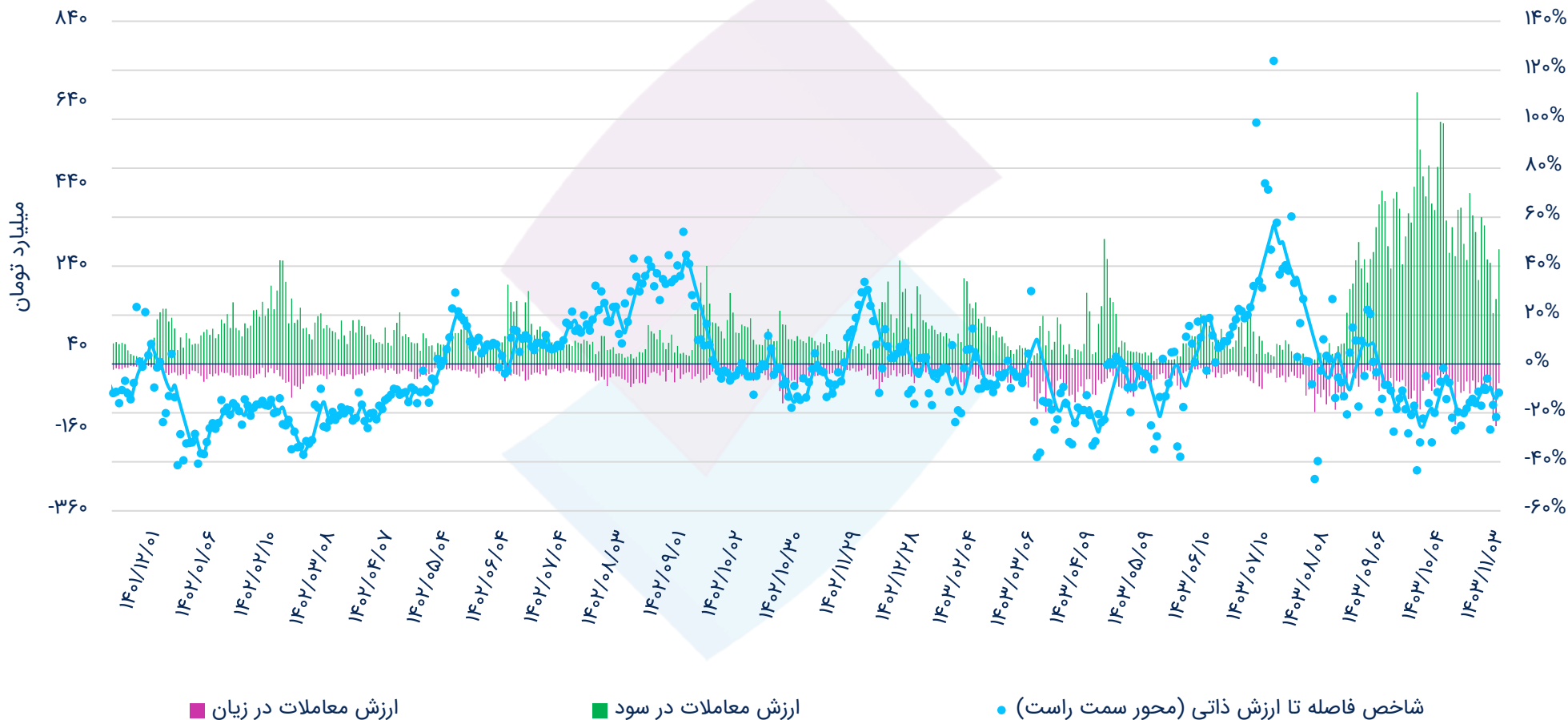
شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۵.۸	۵۲,۰۰۰	پارس فولاد سبزواری، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد غدیر نی ریز، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر
پلی اتیلن ترفتالات	۶۵.۰	۹,۵۲۶	پتروشیمی تندگویان، Wankai New Materials Co.,Ltd
پلی پروپیلن نساجی	۷۳.۱	۱۰,۹۷۹	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۵	۱,۱۷۳,۴۵۴	بین المللی ساروج بوشهر، توسعه گستر هلال خاورمیانه (سیمان مارگون)، ساروج اصفهان، سیمان آبیگ، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان آرنا 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	۲۱۲.۷	۴,۶۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۶.۳	۹۶,۱۲۰	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، تولید فولاد تارا شمش یزد، مجتمع فولاد البرز ناب آرش، صنایع نورد حدید صدرا، مجتمع فولاد شمش نگین مشهد
کنسانتره سنگ آهن	۴.۱	۲۳۷,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، توسعه معدنی و صنعتی صبانور، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان
گندله سنگ آهن	۵.۶	۴۸۷,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، توسعه معدنی و صنعتی صبانور، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنایع معدنی فولاد سنگان خراسان، صنعتی و معدنی توسعه فراگیر سناباد (صنعتی و معدنی توسعه ملی)
مس کاتد	۵۷۵.۳	۳,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
میلگرد	۳۰.۷	۵۶,۷۷۴	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، فولاد آذربایجان، ذوب آهن آرمان آسیا، فولاد آلیاژی ایران
ورق گالوانیزه	۴۸.۱	۱۳,۶۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تاراز چهارمحال، صنایع هفت الماس، گروه صنعتی دانیال استیل، مجتمع فولادی روی اندودکاوه
وکیوم باتوم	۲۳.۲	۱۰۵,۰۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز
مس مفتول	۶۸۰.۵	۱,۹۴۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، صنایع شکوه مس قم، صنایع مس کاوه
ورق سرد	۴۲.۷	۳۳,۹۰۰	فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
تختال	۲۷.۱	۳۵,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب، فولاد جهان آرا اروند



روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

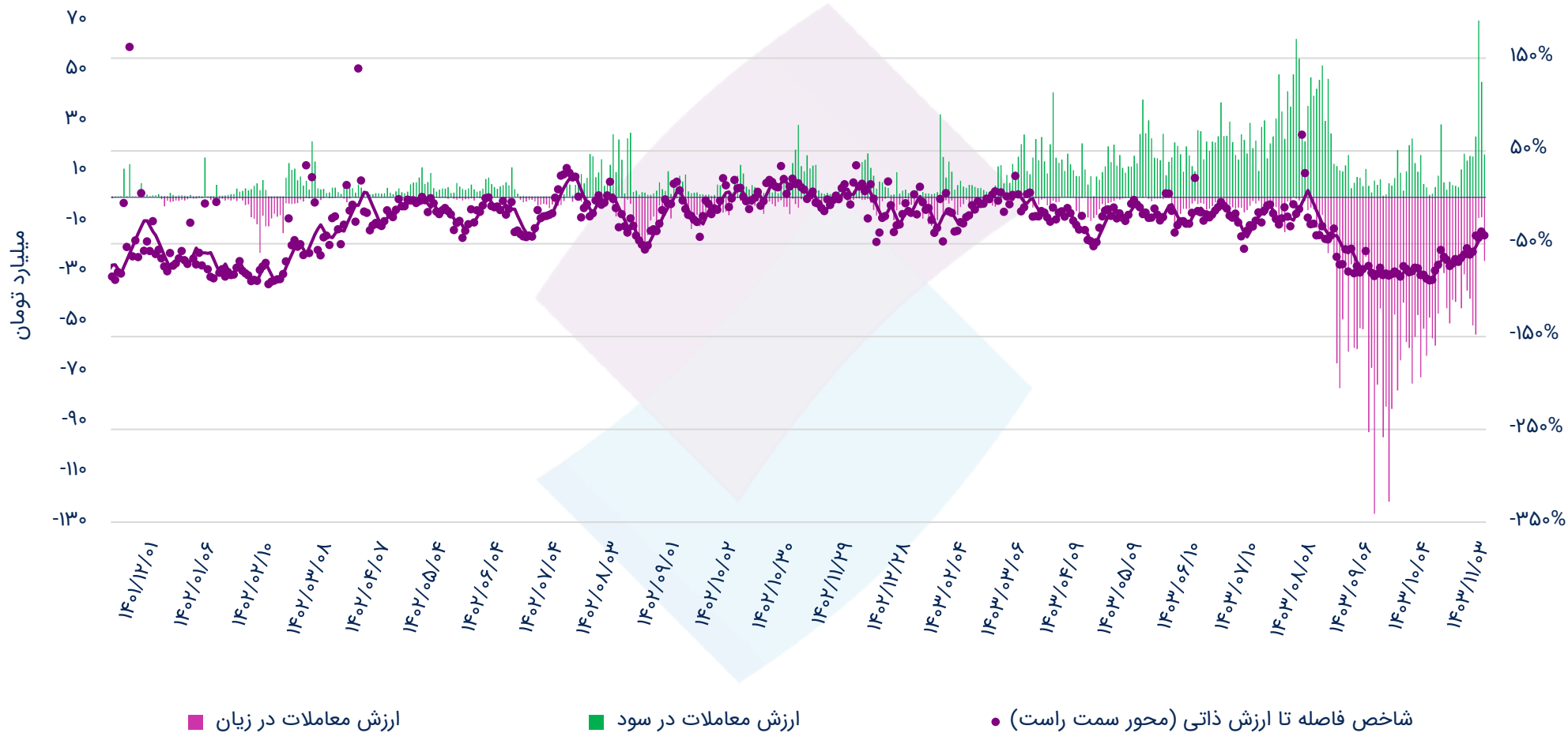


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

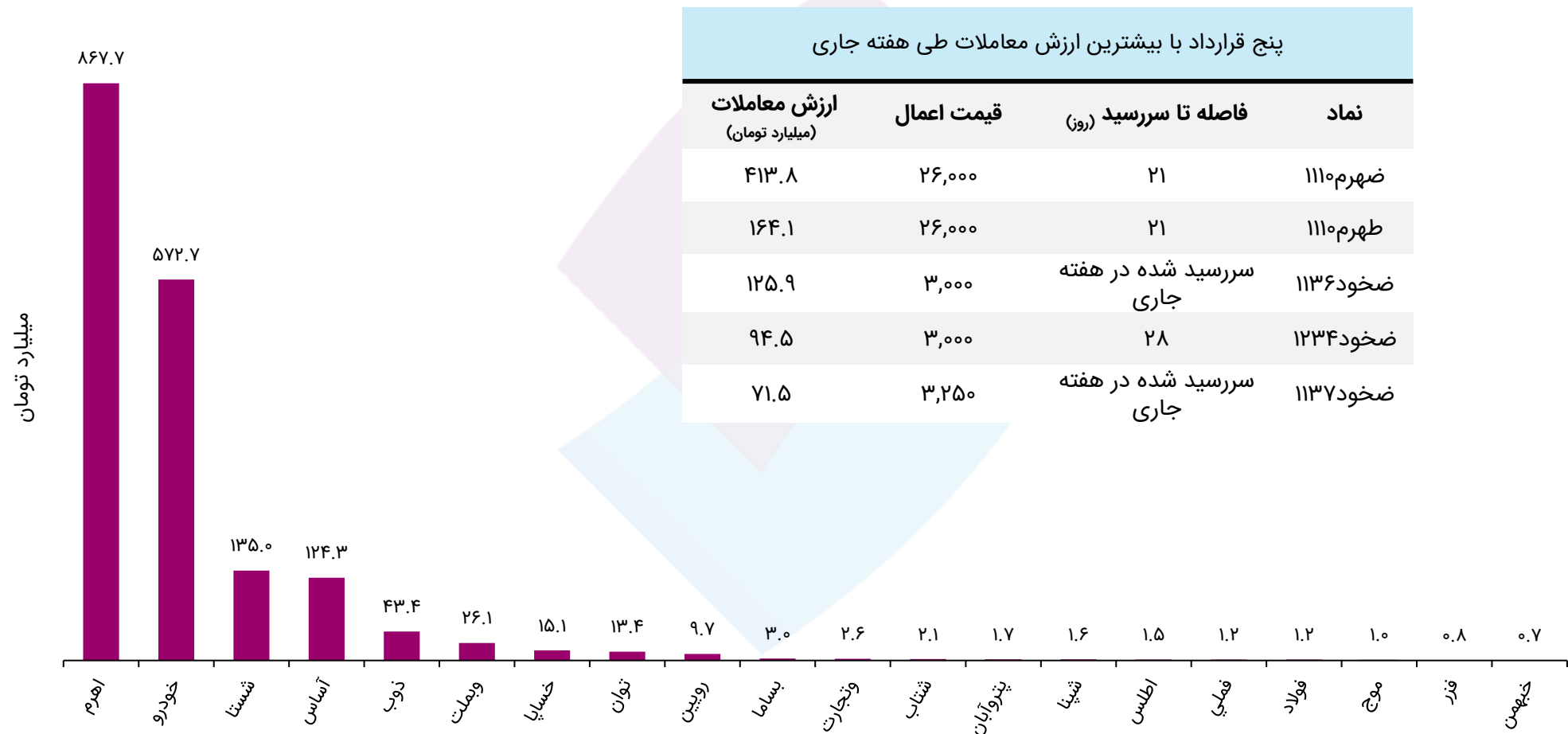
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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)