

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 ۱۰ بهمن - شماره ۱۸۷

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



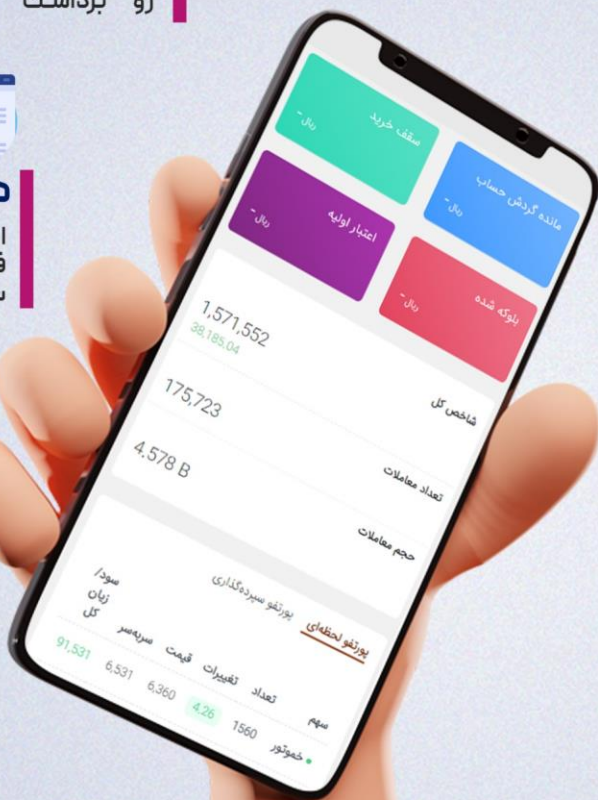
برداشت وجه آتی

درهر 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

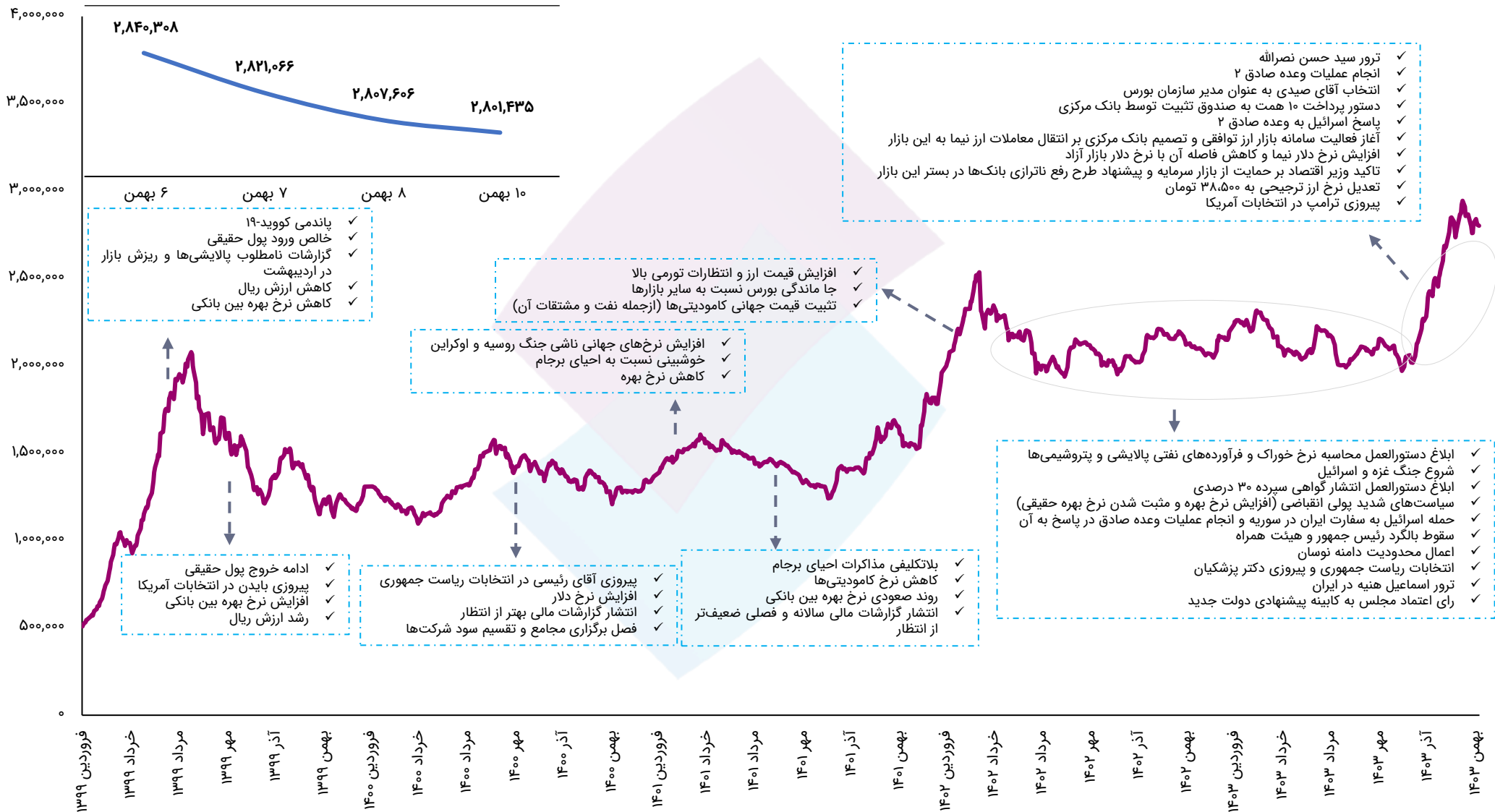
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



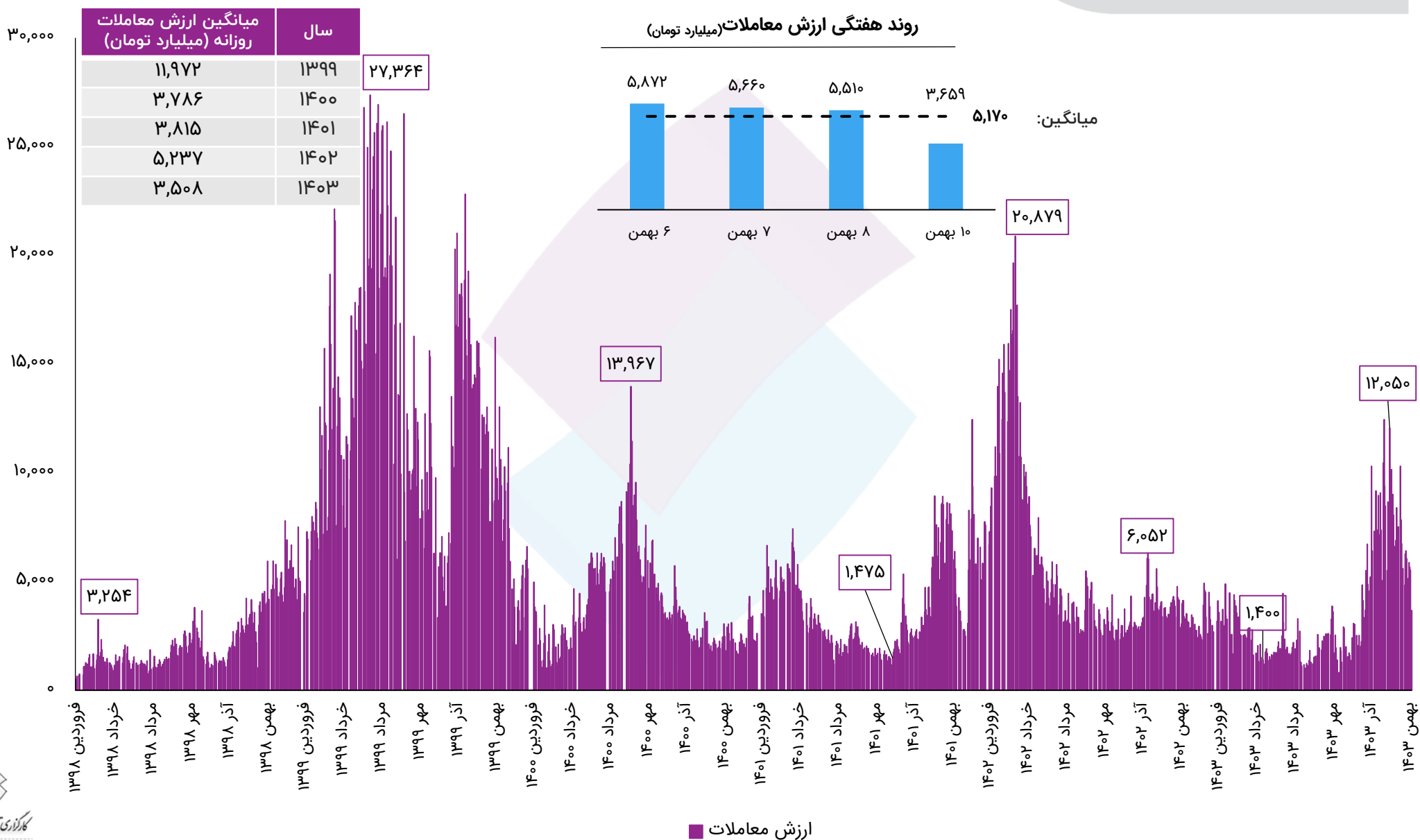
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

کاهش ۰.۵ درصدی شاخص کل در هفته جاری

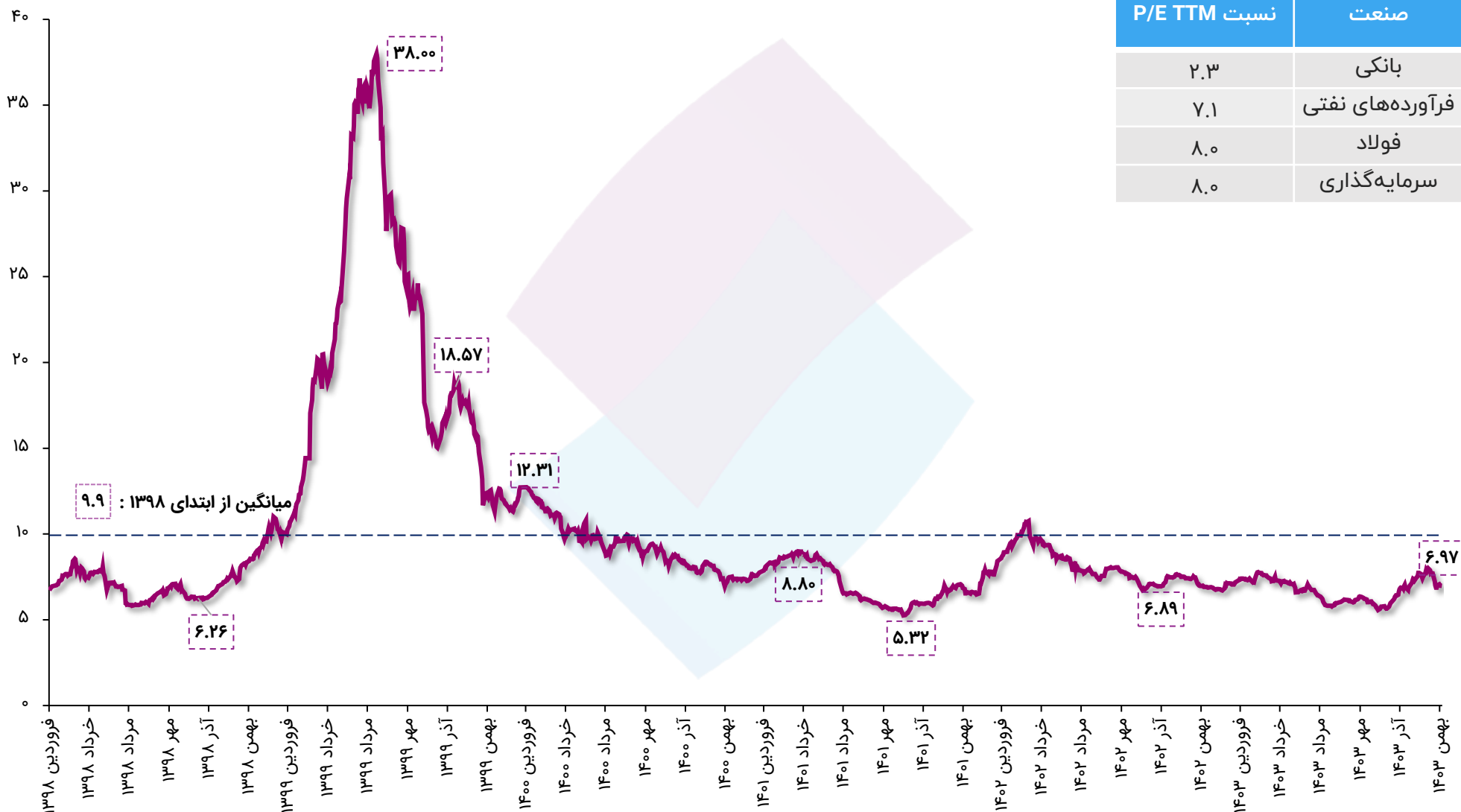
رند هفتگی شاخص کل



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



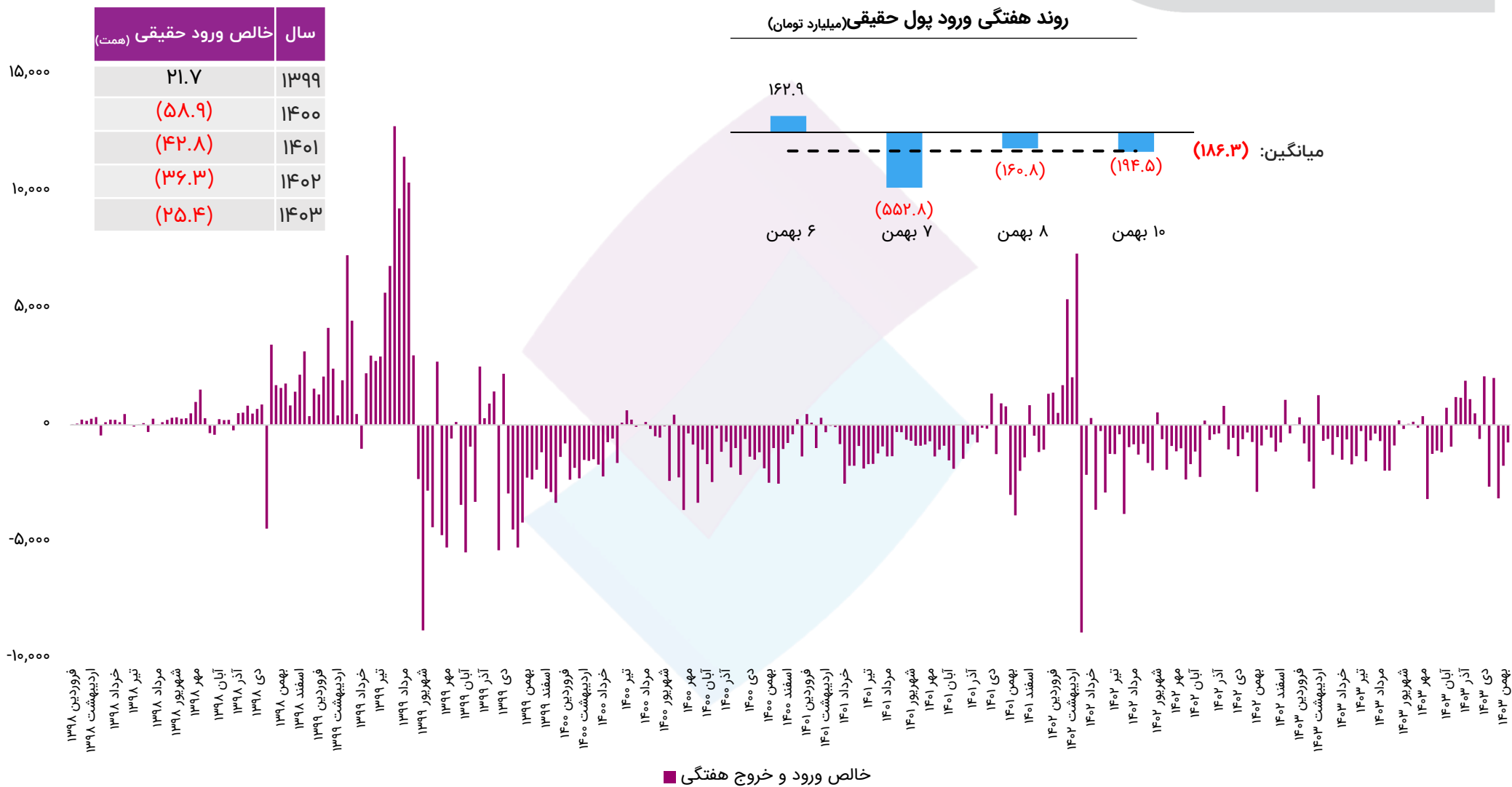
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۳	بانکی
۷.۱	فرآورده‌های نفتی
۸.۰	فولاد
۸.۰	سرمایه‌گذاری

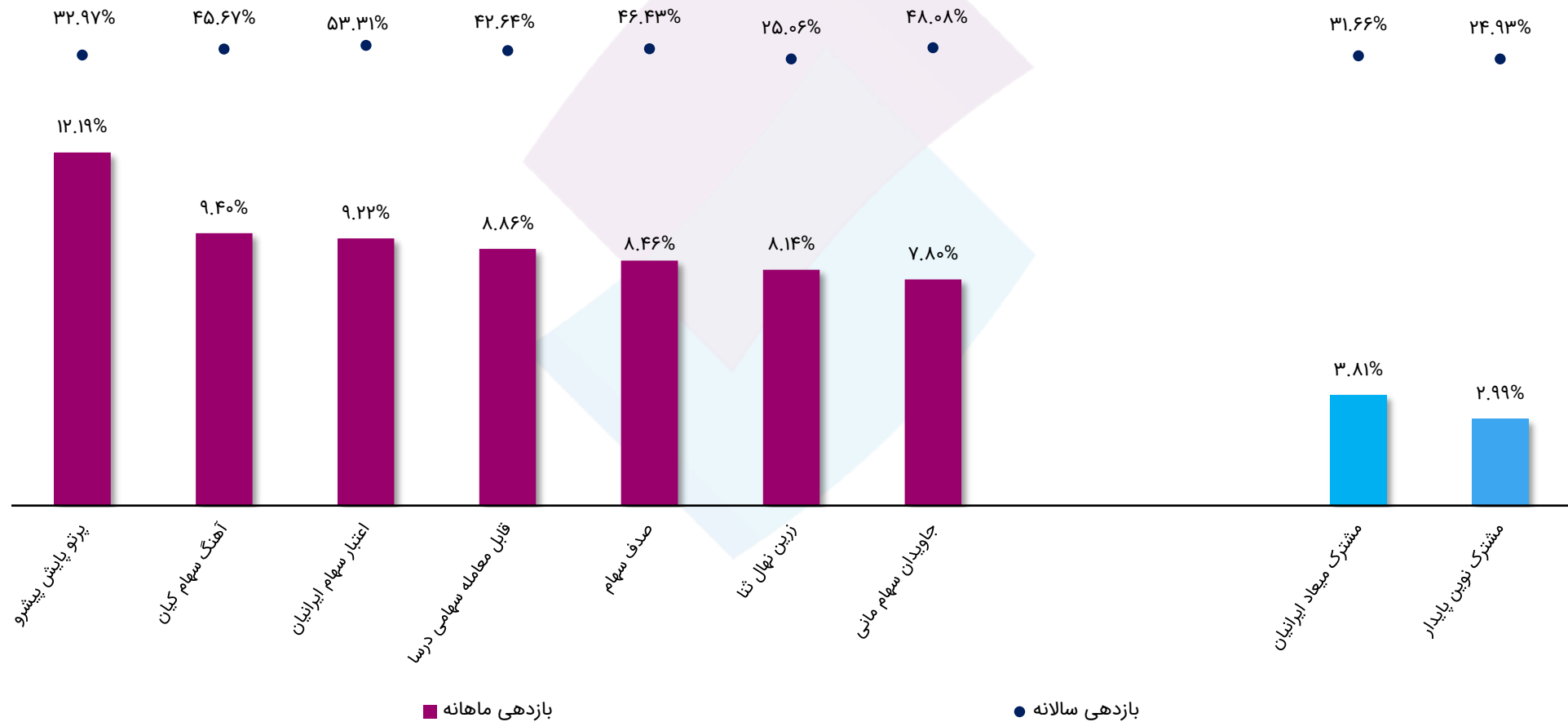
۷۴۵ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱،۷۴۹ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)

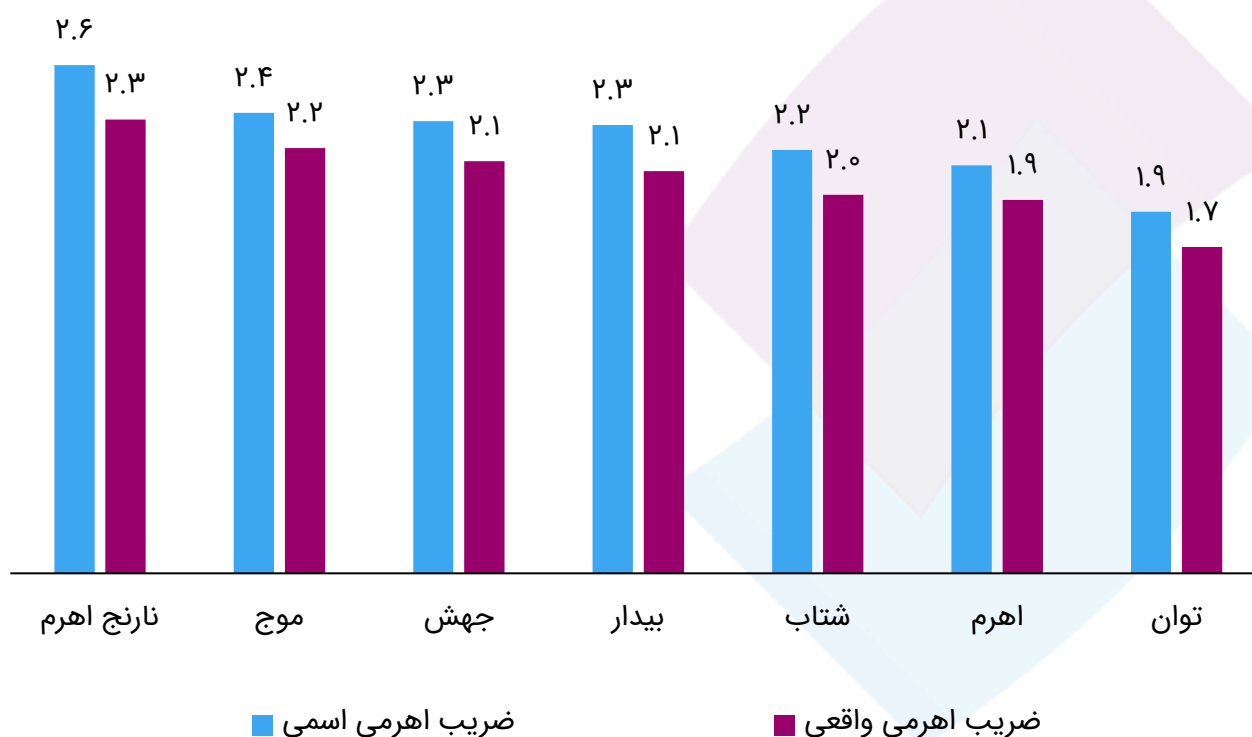


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
نارنج اهرم	-۳.۸%	۱.۵
توان	-۳.۸%	۱.۵
جهش	-۳.۵%	۱.۶
موج	-۲.۵%	۱.۵
شتاب	-۲.۵%	۱.۵
اهرم	-۱.۹%	۱.۶
بیدار	۲.۸%	۱.۵

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
شتاب	۹.۳%	۲.۳۶%
بیدار	۴.۴%	۲.۵۲%
جهش	۲.۸%	۲.۵۳%
توان	۱.۱%	۲.۲۸%
نارنج اهرم	۱.۰%	۲.۵۳%
موج	۰.۷%	۲.۵۳%
اهرم	۰.۷%	۲.۵۲%

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

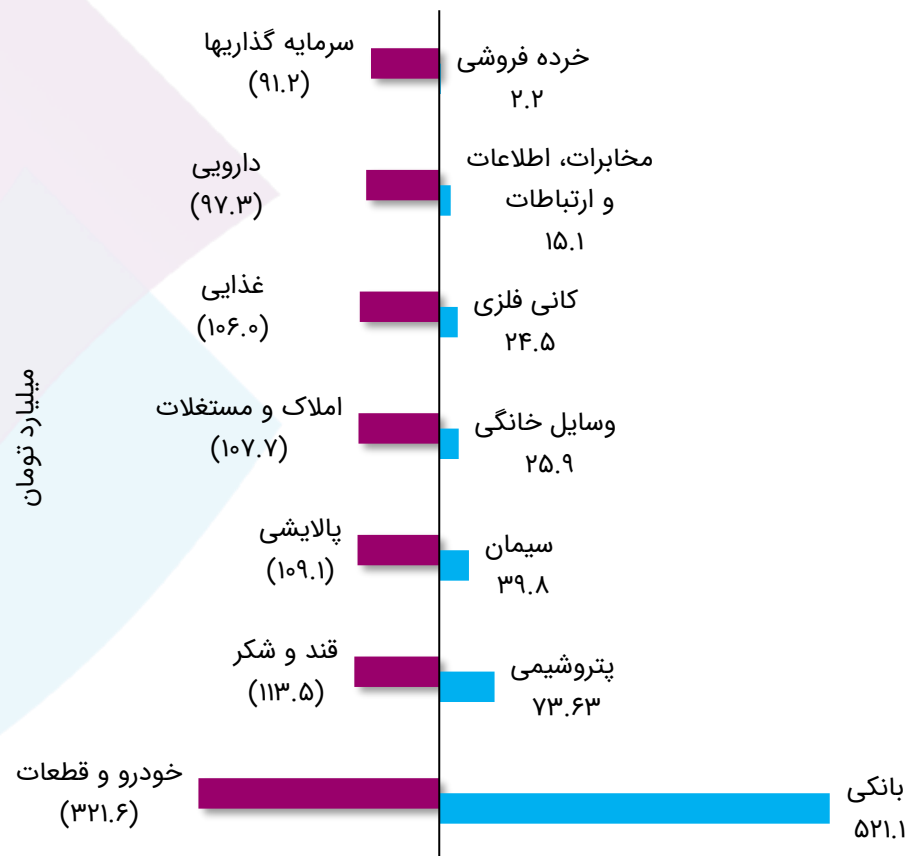
ضریب اهرمی اسمی = خالص ارزش دارایی‌های صندوق / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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.

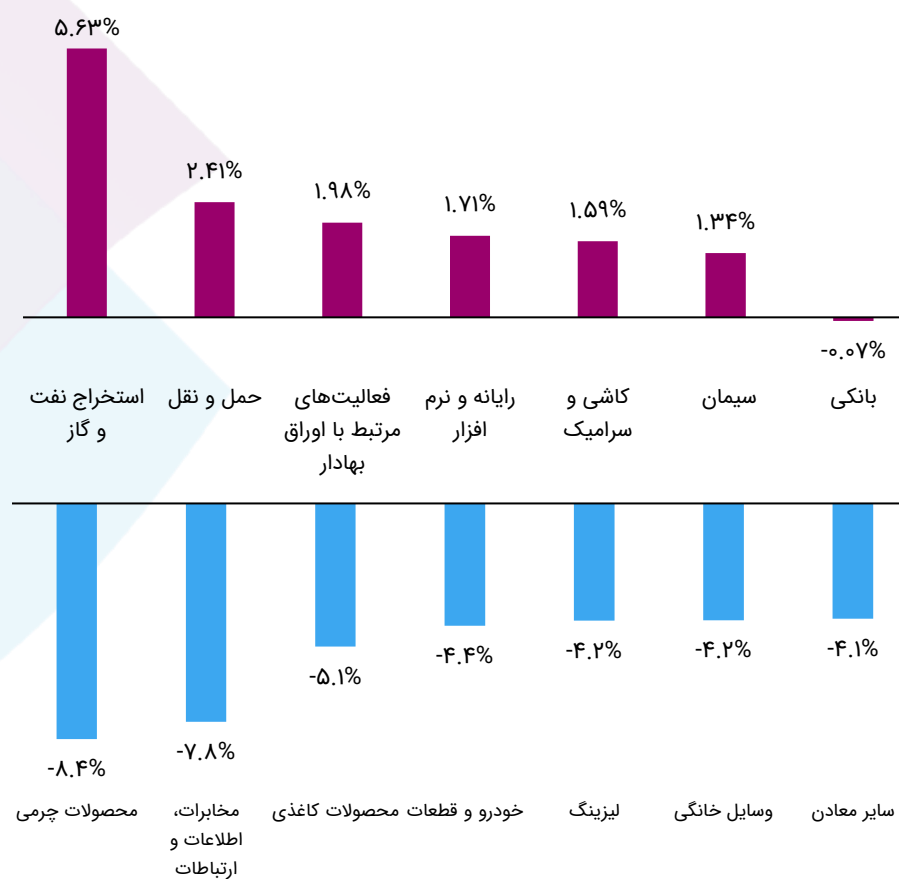
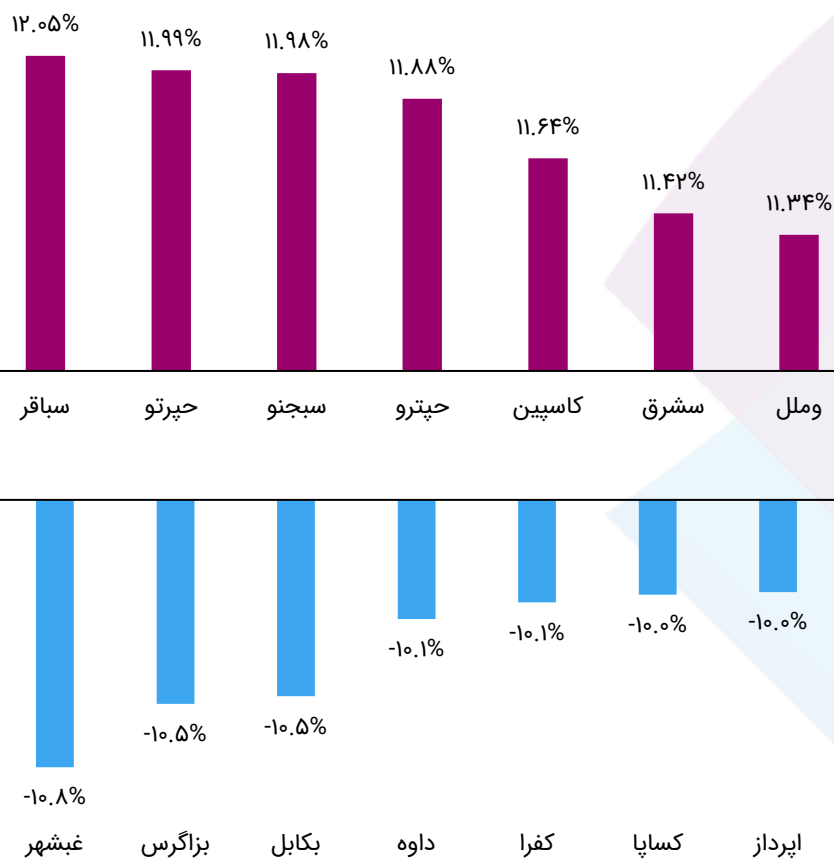
نماد

صنعت



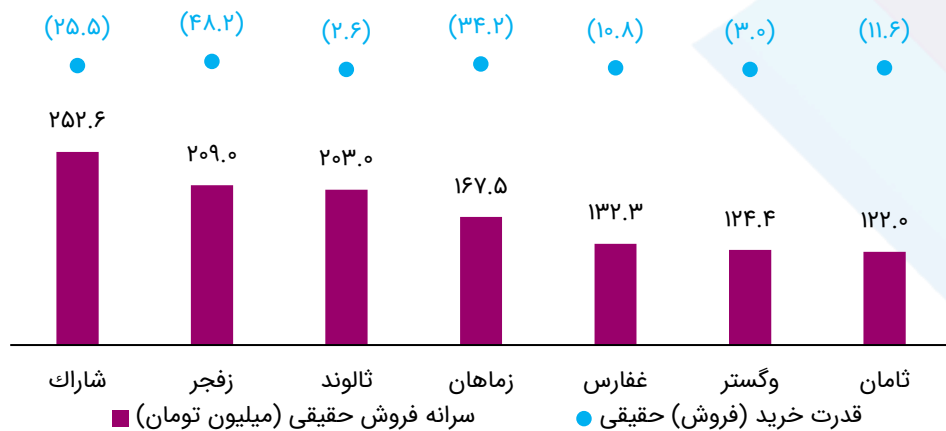
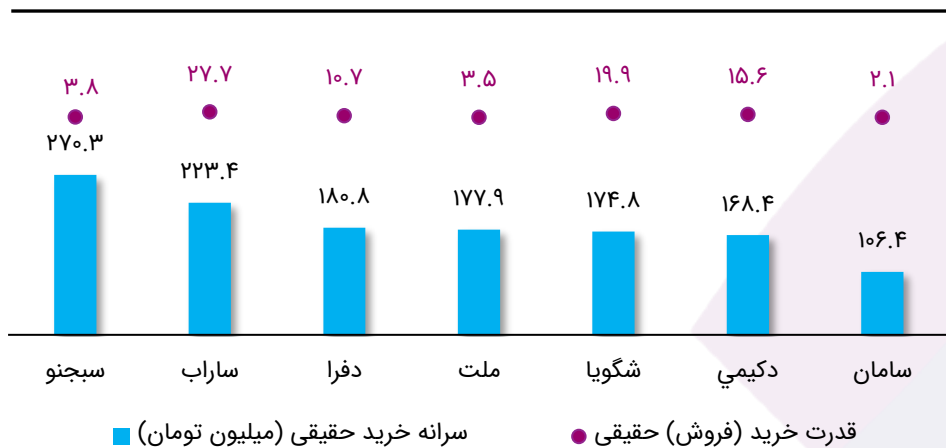
نماد

صنعت

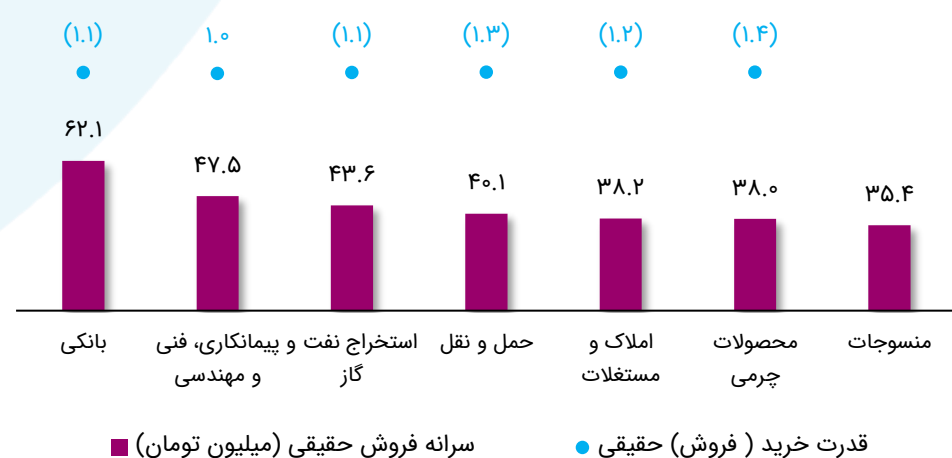
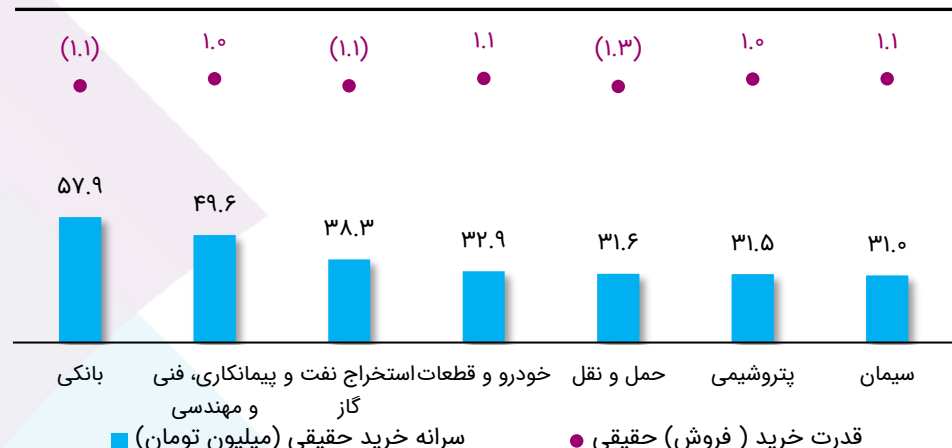


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



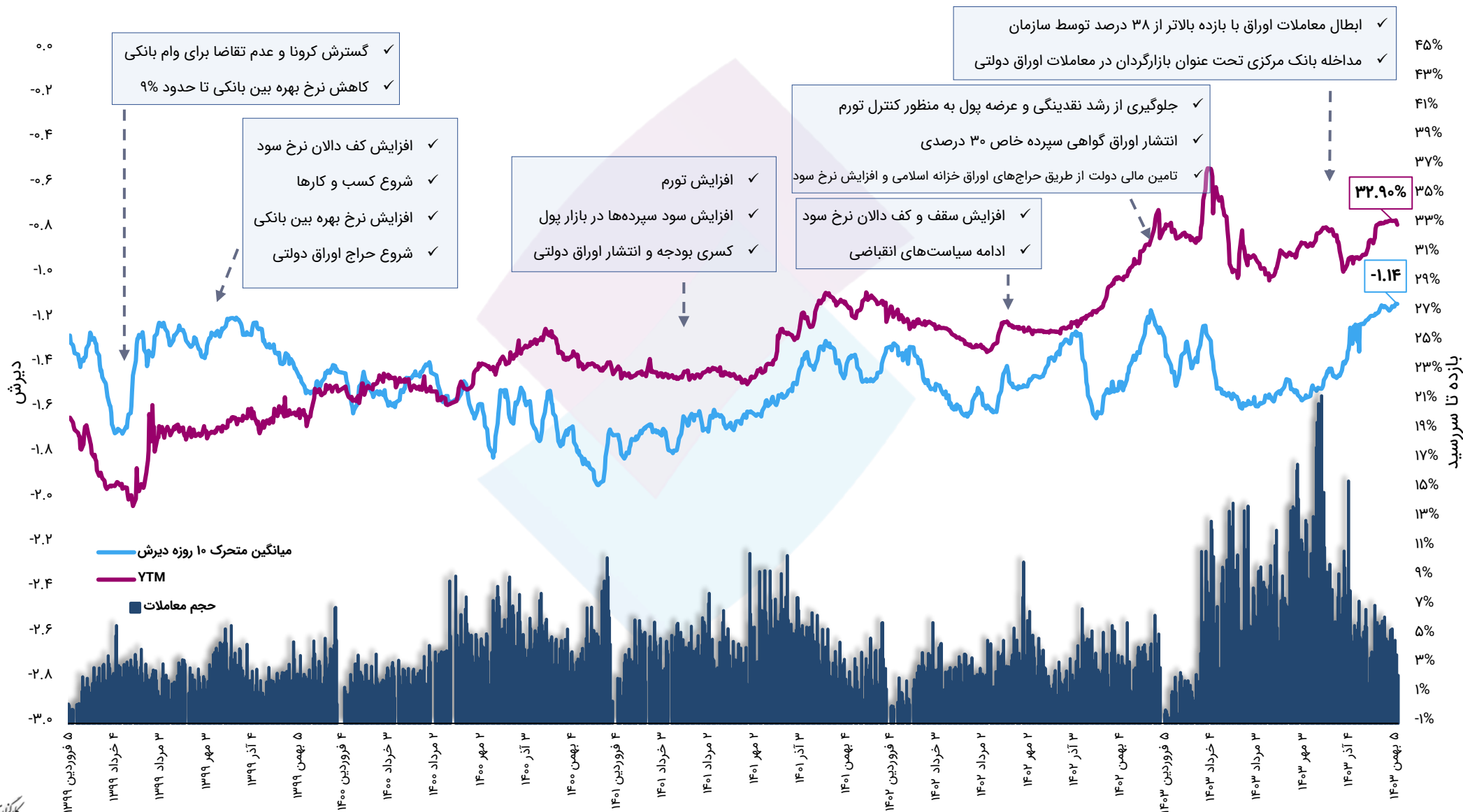
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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				
خپویش	۱۷۶	۵۵۷	۲۱۶%	اصلاح ساختار مالی
تپمی	۶۶۰	۹۹۰	۵۰%	اصلاح ساختار مالی، مشارکت و تامین منابع مالی جهت افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر
تملت	۳,۵۰۰	۵,۰۰۰	۴۳%	تقویت ساختار مالی، بهبود نسبت کفایت سرمایه و افزایش توان مالی جهت توسعه فعالیت های تامین مالی
های وب	۶,۰۰۰	۷,۱۴۰	۱۹%	اصلاح ساختار مالی و عدم خروج نقدینگی و همچنین استفاده از معافیت مالیاتی بر اساس مفاد بند (ث) ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیرساخت ها
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه				
خدیزل	۳,۴۹۸	۵,۸۷۳	۶۸%	اصلاح ساختار مالی
شبصیر	۴۵۰	۶۵۰	۴۴%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی
مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام:				
دبالک	۹۲	۱۸۲	۹۸%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام از تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۰۴ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۲/۰۳ است.
اعلامیه پذیره نویسی عمومی:				
دیران	۱۳۳	۱۷۸	۳۴%	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۰۷ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۱ است.
دتولید	۱۲۰	۳۰۰	۱۵۰%	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج وجه نقد و حفظ و تقویت سرمایه در گردش شرکت مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۰۷ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۱ است.
حرهشا	۲	۲۰	۱۲۳۳%	تجهیز ناوگان حمل و نقل و تامین سرمایه در گردش مهلت پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۱۴ تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۰ است.

گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

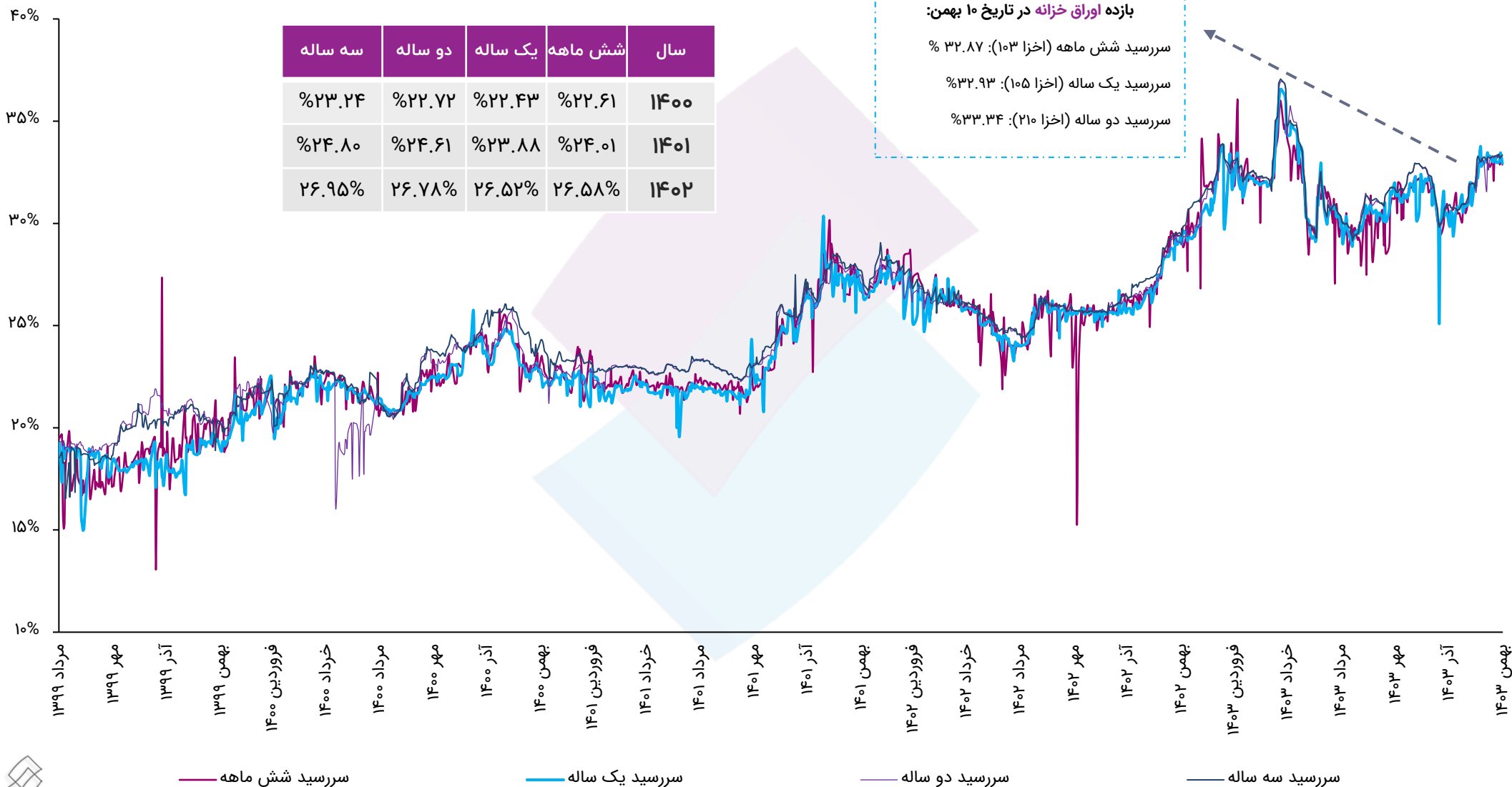
نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
نیان	۱۴۳	۶۲۴	۳۳۶%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی و حفظ نقدینگی جهت حفظ ظرفیت تولید
بموتو	۲,۰۱۵	۲,۶۰۰	۲۹%	آورده نقدی	بهبود ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد و تقویت سرمایه در گردش شرکت
قزوین	۲۰۷	۴۰۰	۹۳%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج وجه نقد و تامین سرمایه در گردش جهت تولید شکر سفید
زنجان	۶۱۳	۸۷۵	۴۳%	آورده نقدی	تکمیل احداث کارخانه اوره و آمونیاک
وصنا	۸۱۵	۱,۱۶۵	۴۳%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی

کاهش ۰.۲۵ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۹ درصد

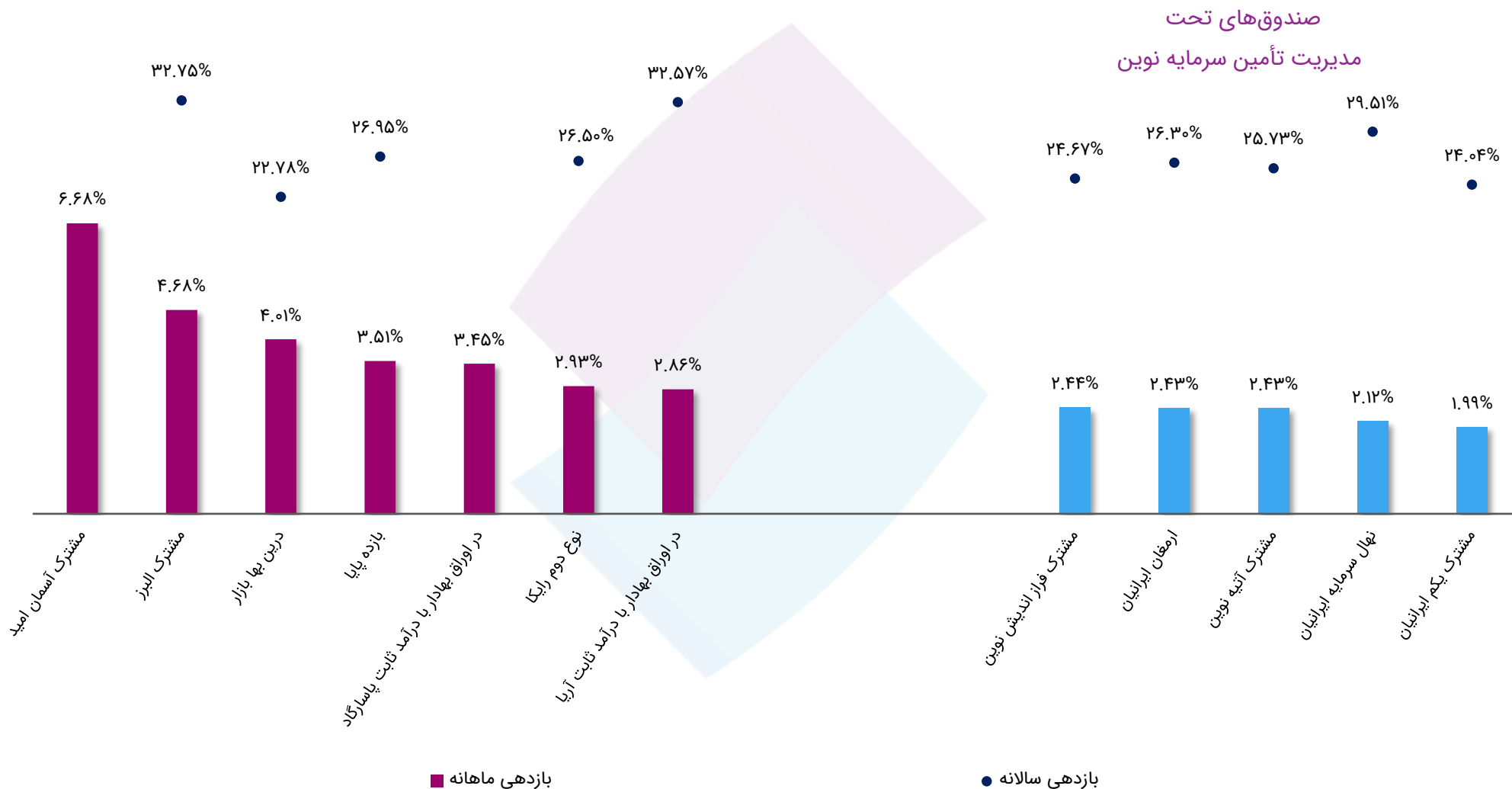


بازده تا سررسید

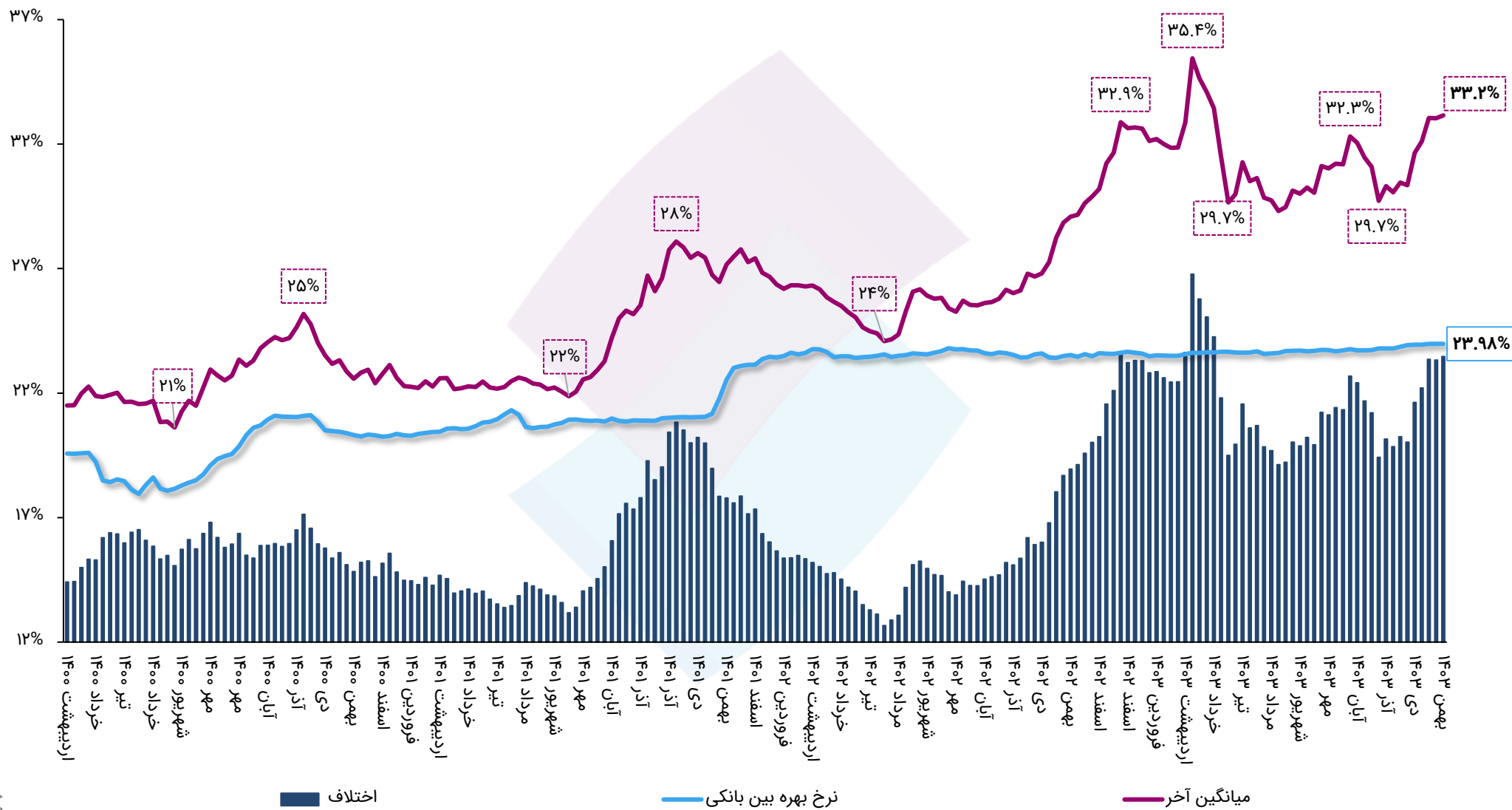
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



ثبات نرخ بهره بین بانکی در رقم ۲۳.۹۸ درصد و اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخريد به مبلغ ۲۲۲ همت



معامله ۷۶۶ هزار و ۶۱۱ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

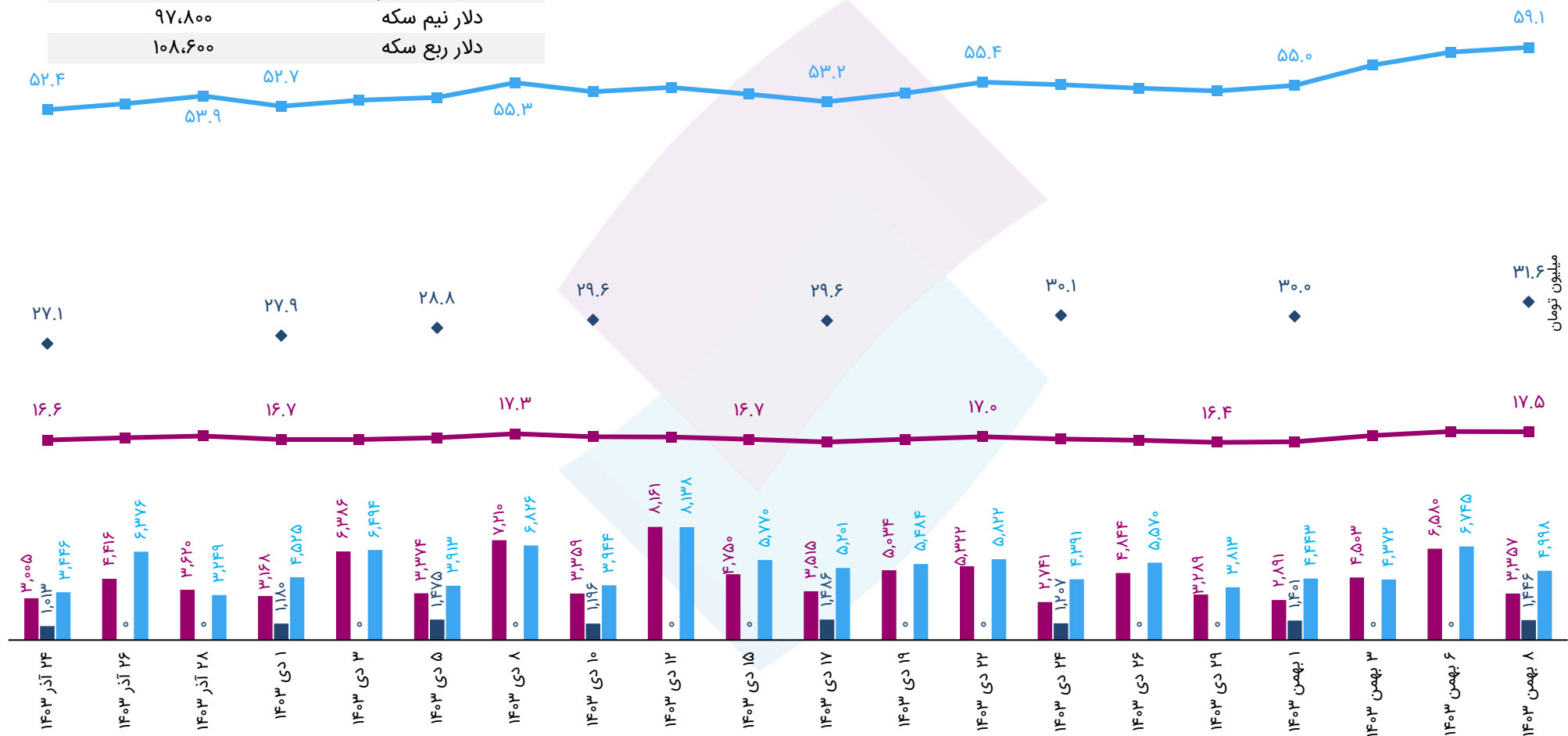
آخرین نرخ
مبلغ (تومان)

۶۸،۷۰۳ دلار مرکز مبادله

۹۱،۷۰۰ دلار سکه تمام

۹۷،۸۰۰ دلار سکه نیم

۱۰۸،۶۰۰ دلار ربع سکه



معامله ۱۴ هزار و ۴۷۴ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

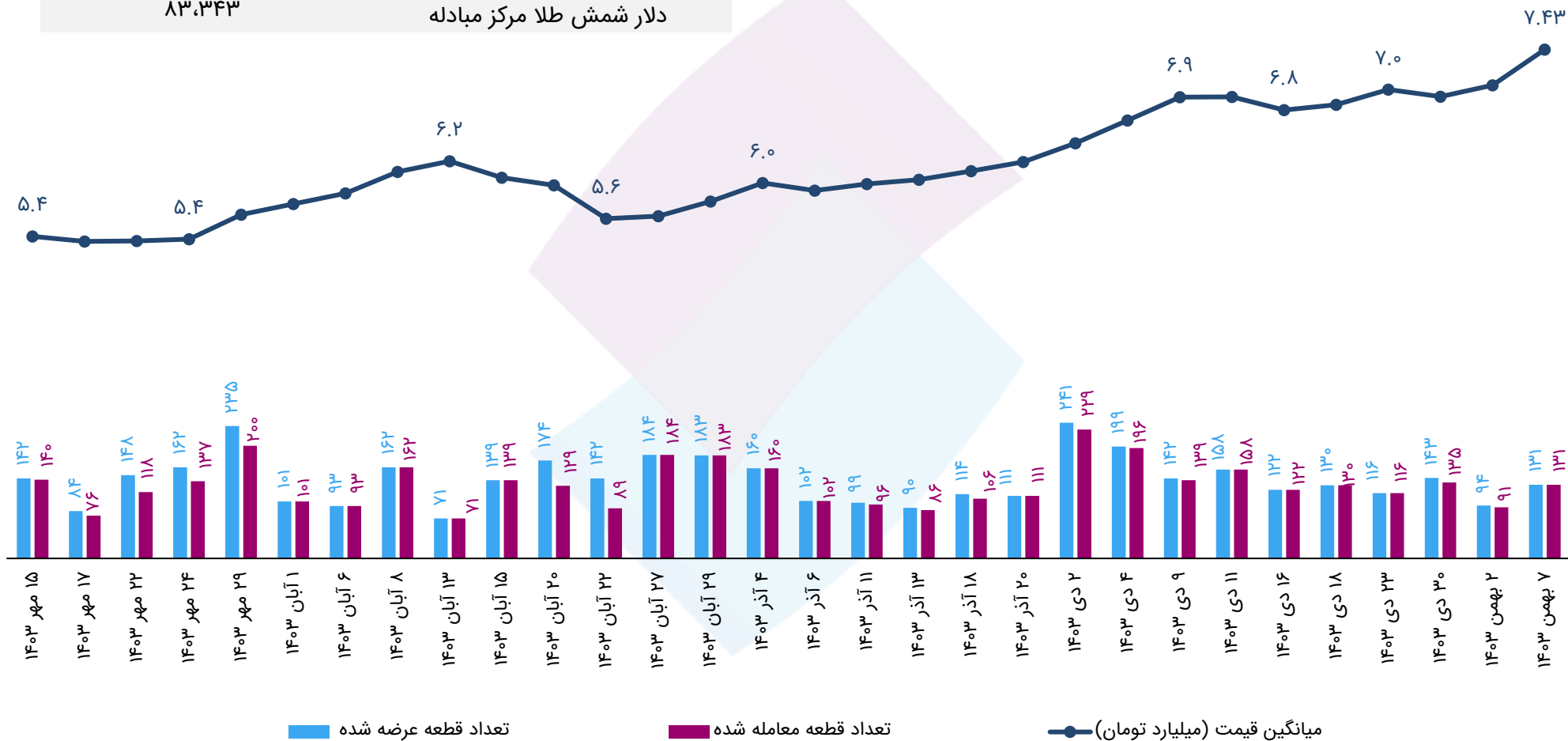
آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

۶۸،۷۷۱

دلار مرکز مبادله

۸۳،۳۴۳

دلار شمش طلا مرکز مبادله



میانگین قیمت (میلیارد تومان)

تعداد قطعه معامله شده

تعداد قطعه عرضه شده

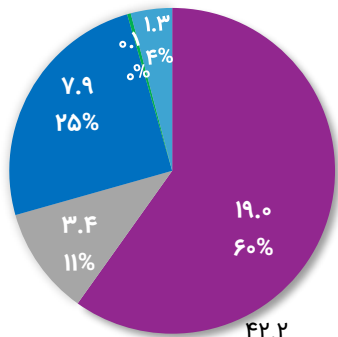
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلوگرمی بوده است.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

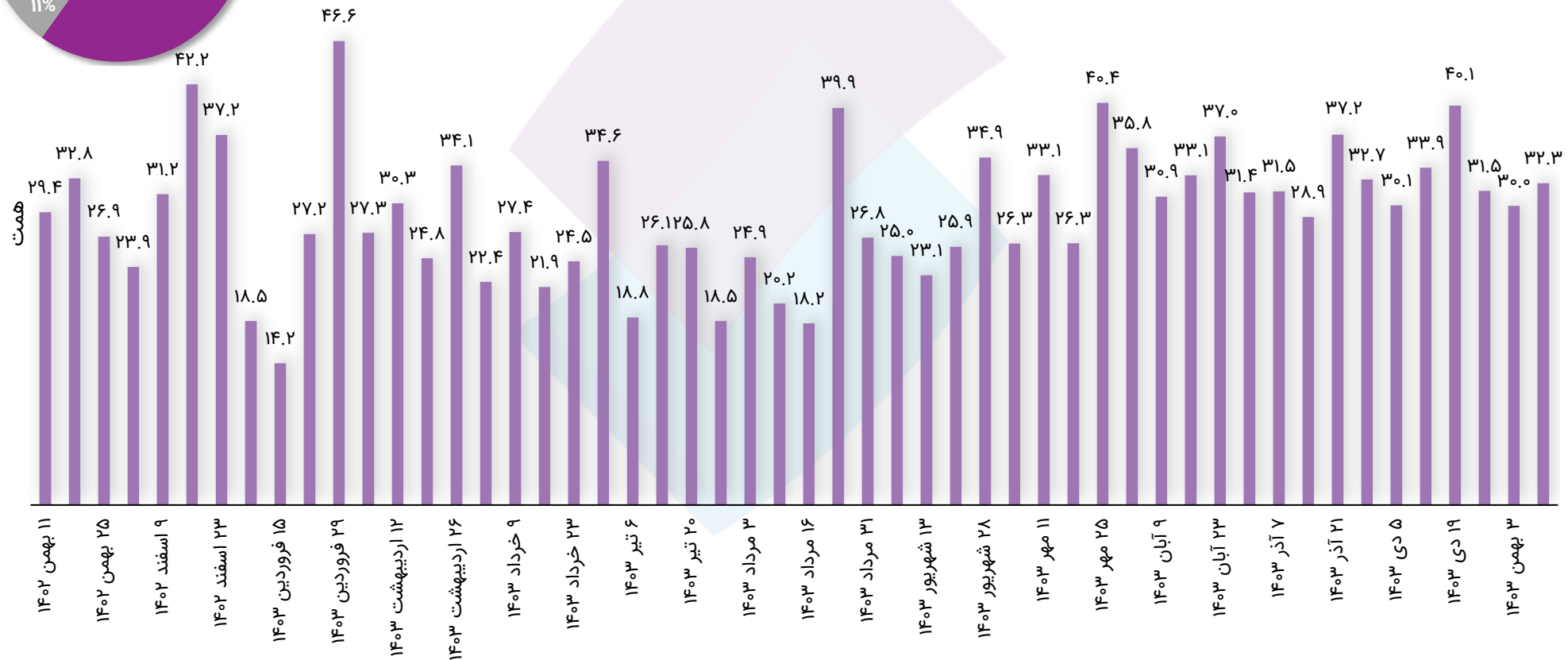
سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۵.۴%	۲,۰۳۶	۵.۷%	۲,۶۰۹	۰.۱%	۲,۷۵۶	۲,۷۵۸	طلا (دلار/انس)
۸۱.۴%	۳۳۵,۶۰۰	۷.۲%	۵۶۸,۲۰۰	۳.۲%	۵۹۰,۱۰۰	۶۰۸,۹۰۰	سکه (هزار ریال)
۶۰.۲%	۴۲۹,۲۱۹	۳.۱%	۶۶۶,۹۲۹	۰.۴%	۶۸۴,۶۸۱	۶۸۷,۴۴۲	دلار اسکناس (ریال)
۶۹.۲%	۳۹۵,۲۲۷	۳.۱%	۶۴۸,۷۶۴	۰.۴%	۶۶۶,۰۳۲	۶۶۸,۷۱۸	دلار حواله (ریال)
-۶.۵%	۸۳	۴.۳%	۷۴	-۲.۱%	۷۹	۷۷	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۳۸.۶%	۴۲,۹۵۳	۱۰.۶%	۹۲,۶۴۳	-۱.۱%	۱۰۳,۶۵۳	۱۰۲,۴۸۳	بیت کوین (دلار)
۵.۱%	۸,۴۶۱	۰.۷%	۸,۸۳۲	-۲.۵%	۹,۱۲۳	۸,۸۹۰	مس LME (دلار/تن)
۷.۹%	۲,۵۴۵	-۹.۲%	۳,۰۲۶	-۳.۷%	۲,۸۵۱	۲,۷۴۶	روی LME (دلار/تن)
-۱۷.۰%	۵۱۳	-۳.۹%	۴۴۳	-۱.۰%	۴۳۰	۴۲۶	بیلت CIS (دلار/تن)
-۷.۷%	۴۵۵	-۷.۷%	۴۵۵	-۲.۸%	۴۳۲	۴۲۰	بیلت ایران (دلار/تن)
۴.۹%	۲۸۷	-۱.۰%	۳۰۴	-۱.۳%	۳۰۵	۳۰۱	متانول CFR (\$/mt)
۸.۴%	۳۶۱	۱۲.۰%	۳۵۰	۱.۶%	۳۸۵	۳۹۱	سبذ اوره (mt/\$)
۴۷.۳%	۲.۲۶	-۱.۸%	۳.۳۹	-۱۵.۹%	۳.۹۶	۳.۳۳	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



- تالار صنعتی
- تالار پتروشیمی
- تالار حراج باز
- تالار فرآورده های نفتی
- تالار سیمان



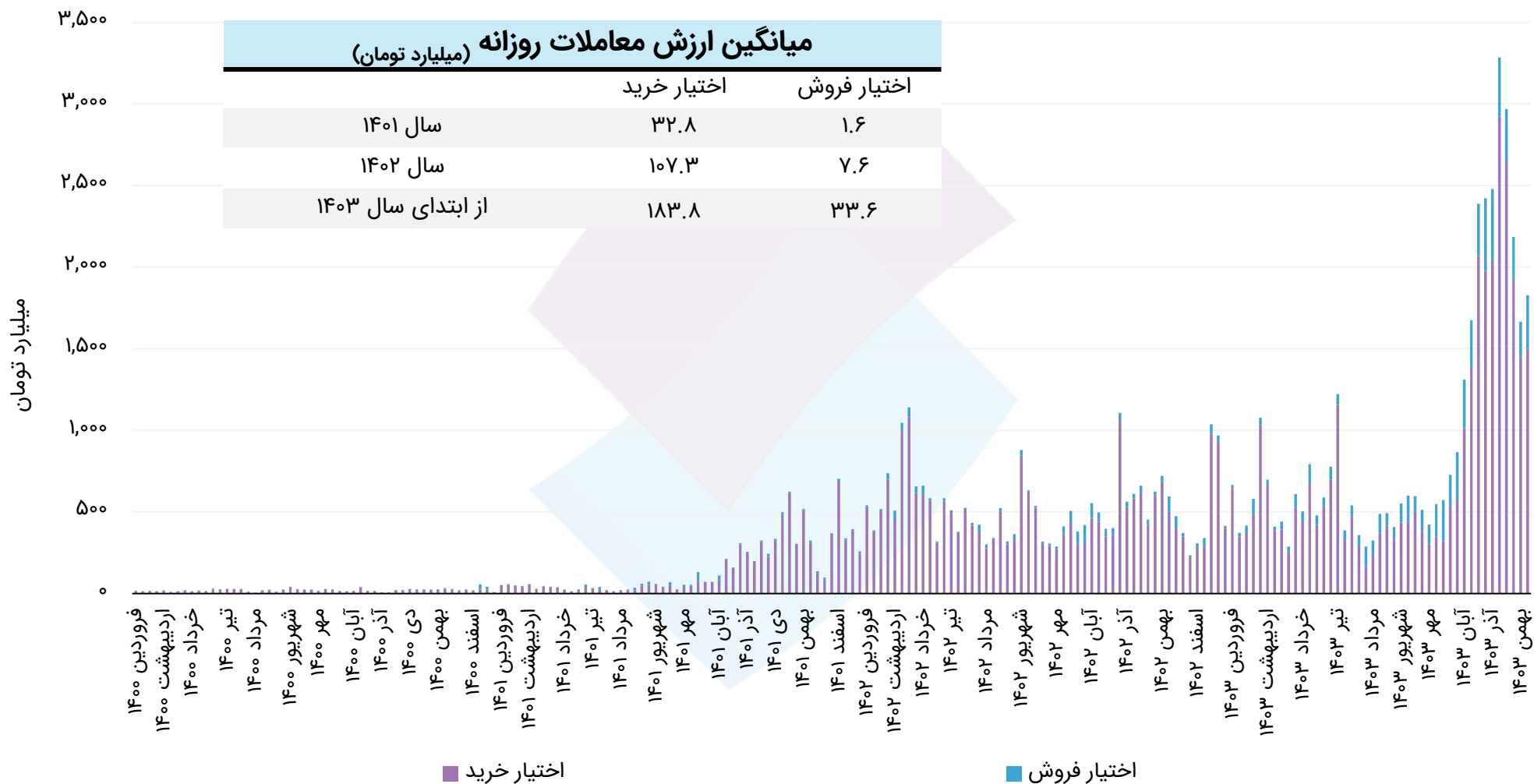
ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

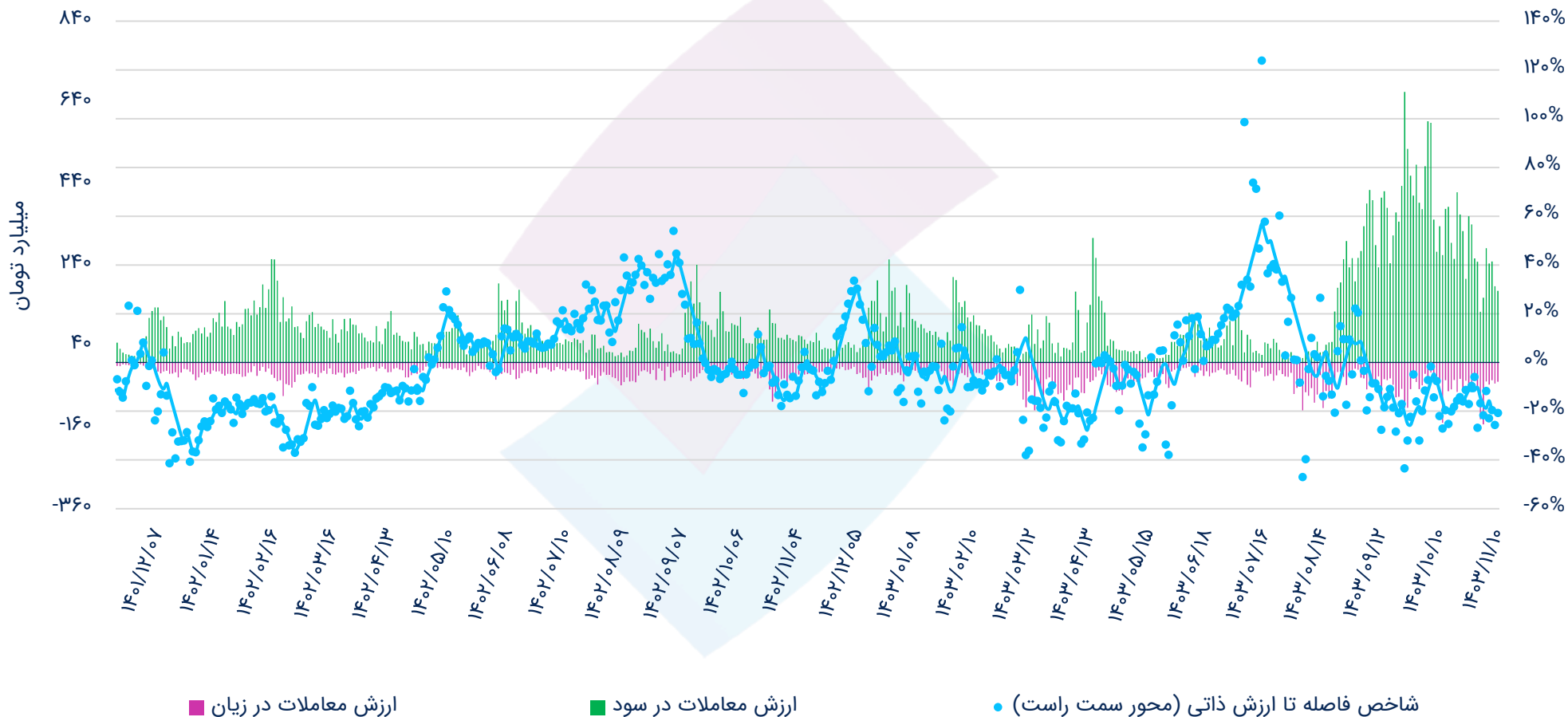
شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۶.۵	۹۵,۶۵۰	پارس فولاد سبزواری، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد غدیر نی ریز، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صنعت فولاد شادگان، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، توسعه آهن و فولاد گل گهر
پلی پروپیلن نساجی	۷۵.۵	۱۰,۷۷۳	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
سیمان	۱.۵	۱,۱۷۶,۶۳۴	بین‌المللی 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
شمش آلومینیوم	۲۱۸.۹	۵,۸۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم مهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
شمش بلوم	۲۶.۸	۱۶۵,۴۲۵	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، مجتمع فولاد خراسان، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، فولاد کویر دامغان
کنسانتره سنگ آهن	۴.۰	۱۴۰,۰۰۰	توسعه معدنی و صنعتی صابانور، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، معادن سنگ آهن احیای سپاهان، صنعتی معدنی پایا فولاد کویر یزد
گندله سنگ آهن	۵.۸	۵۲۲,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گل گهر، صنعتی و معدنی اپال پارسین سنگان، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، 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	۶۰۲.۳	۳,۰۴۰	ملی صنایع مس ایران، تماس
میلگرد	۳۰.۶	۵۶,۵۸۰	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمذ ابرکوه، فولاد سپهر ایرانیان، 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
ورق گالوانیزه	۴۹.۲	۲۳,۴۰۰	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، فولاد دشتستان (مجتمع نورد گالوانیزه دشتستان راد)
وکیوم باتوم	۲۴.۴	۱۱۸,۵۰۰	پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز
مس مفتول	۶۷۹.۷	۲,۱۴۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، صنایع مس کاوه
ورق سرد	۴۲.۷	۴۶,۹۵۰	فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
تختال	۲۷.۶	۴۰,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب
خودرو	۳,۹۴۳.۵	۲۱۰ (دستگاه)	بهمن دیزل، سیباموتور



روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

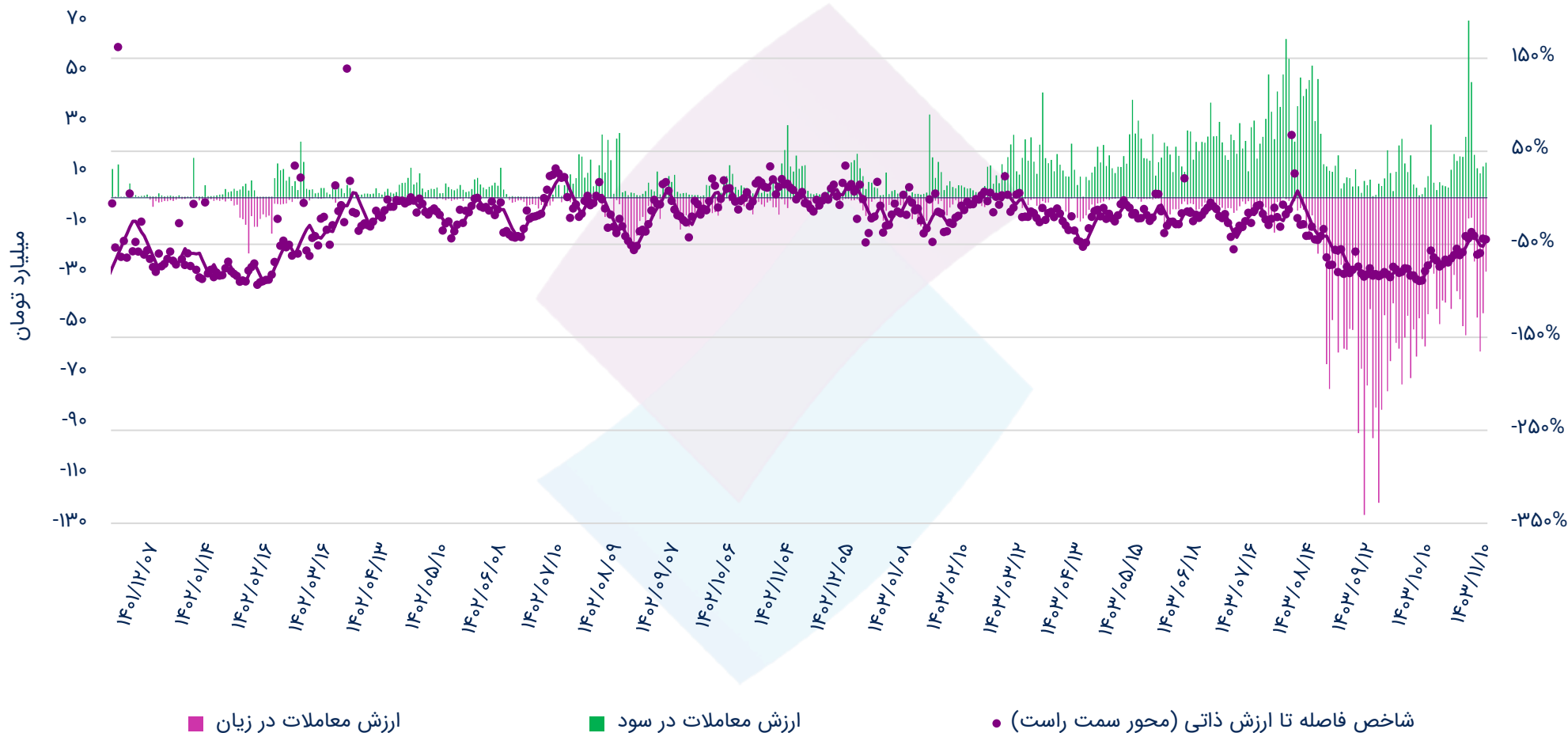


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

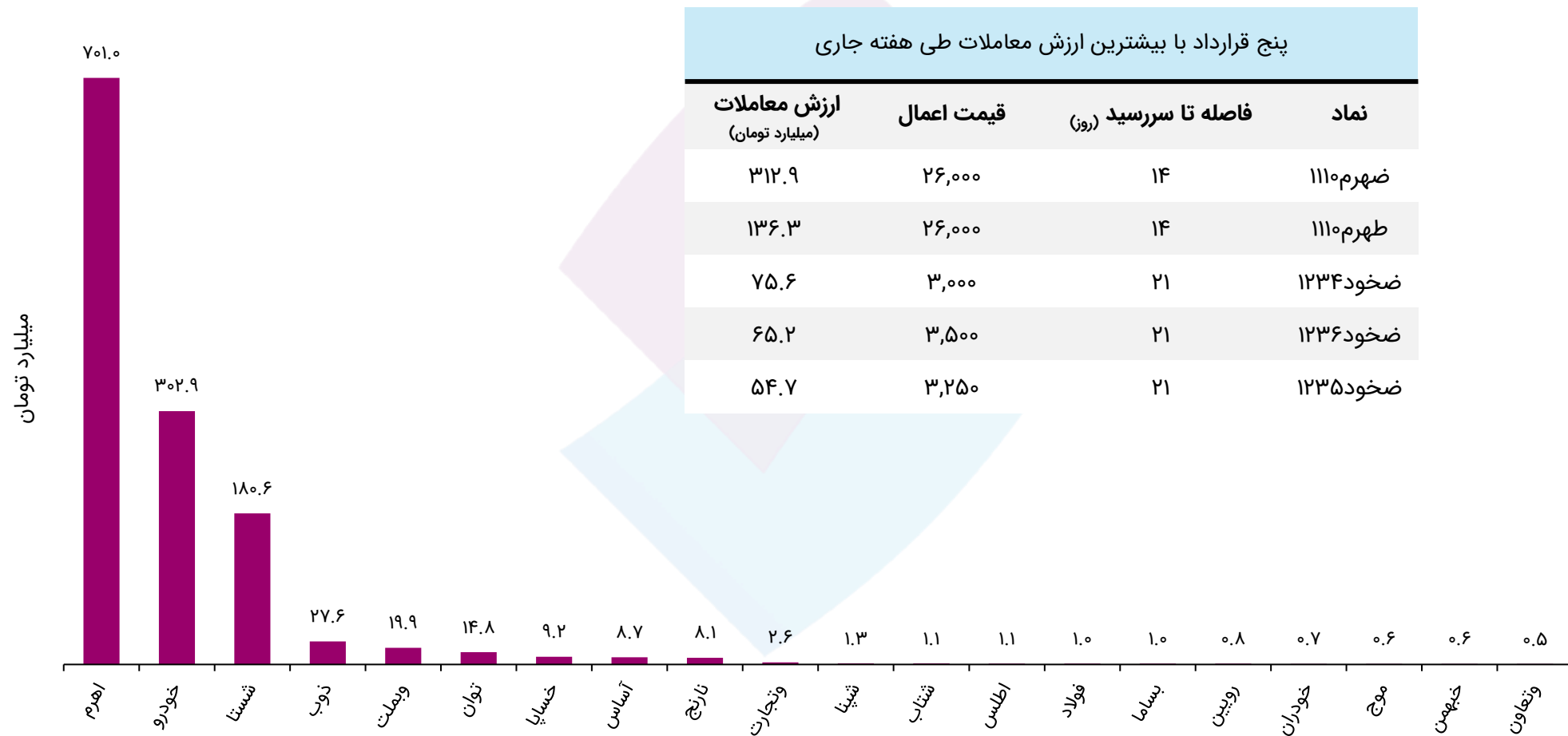
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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)