

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 ۱۱ تیر - شماره ۲۰۴

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 راه اندازی 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



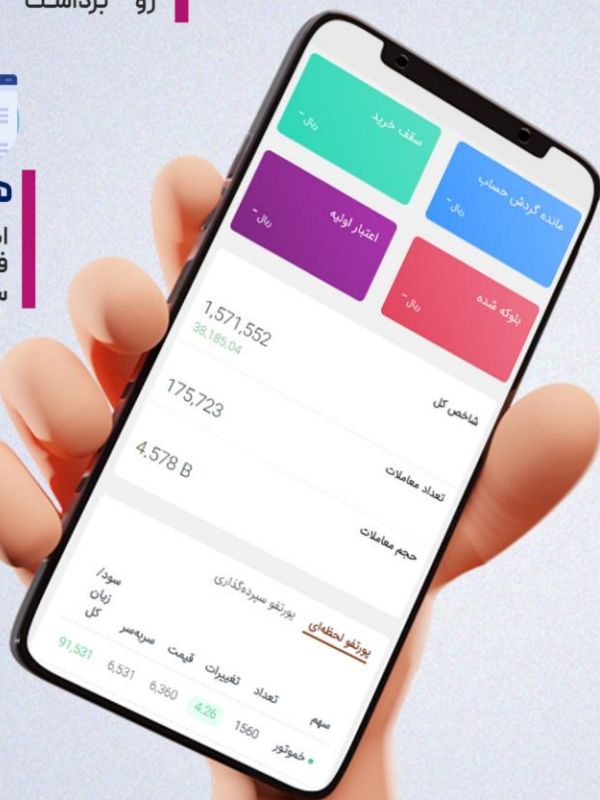
برداشت وجه آتی

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

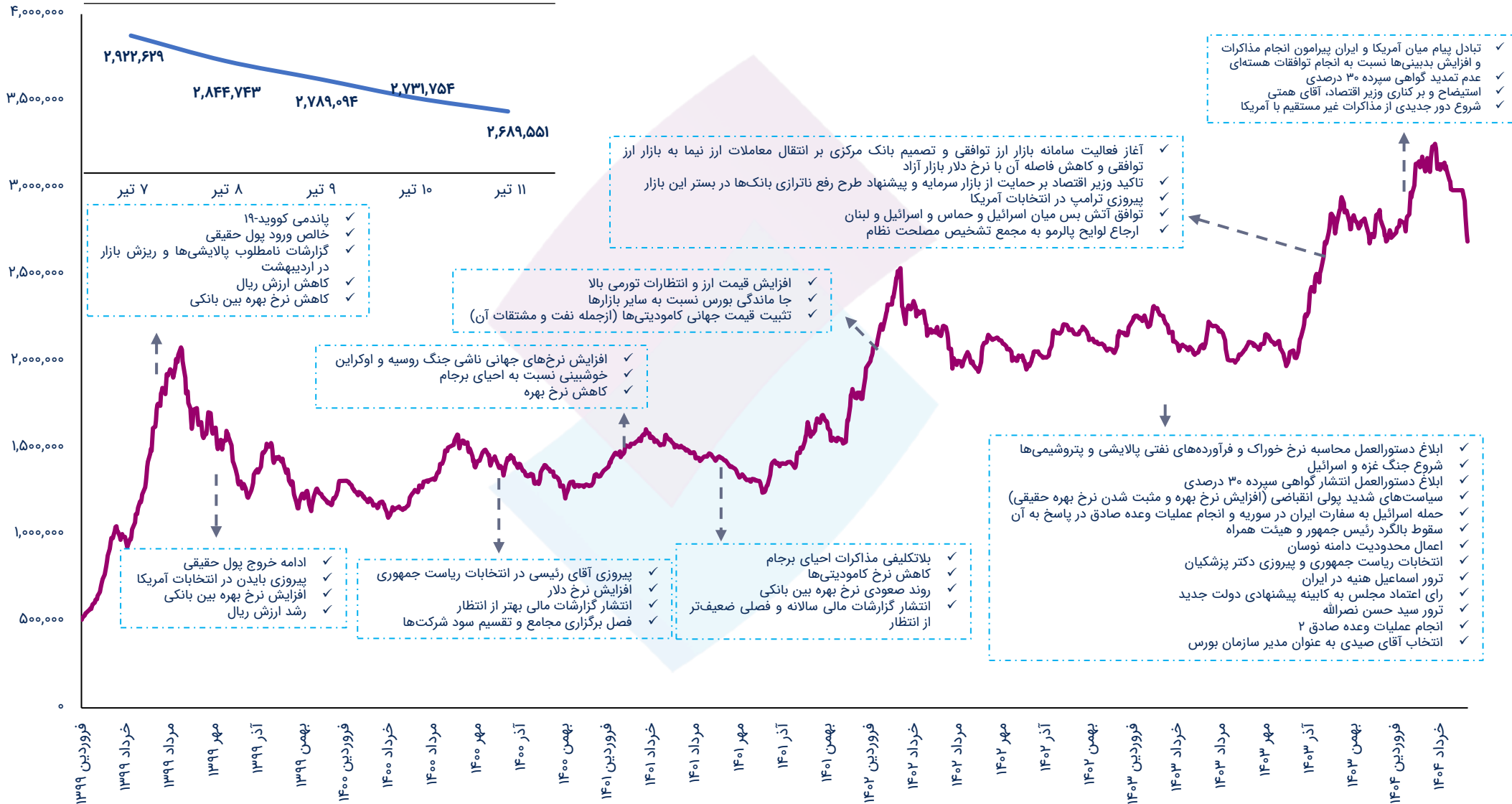
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



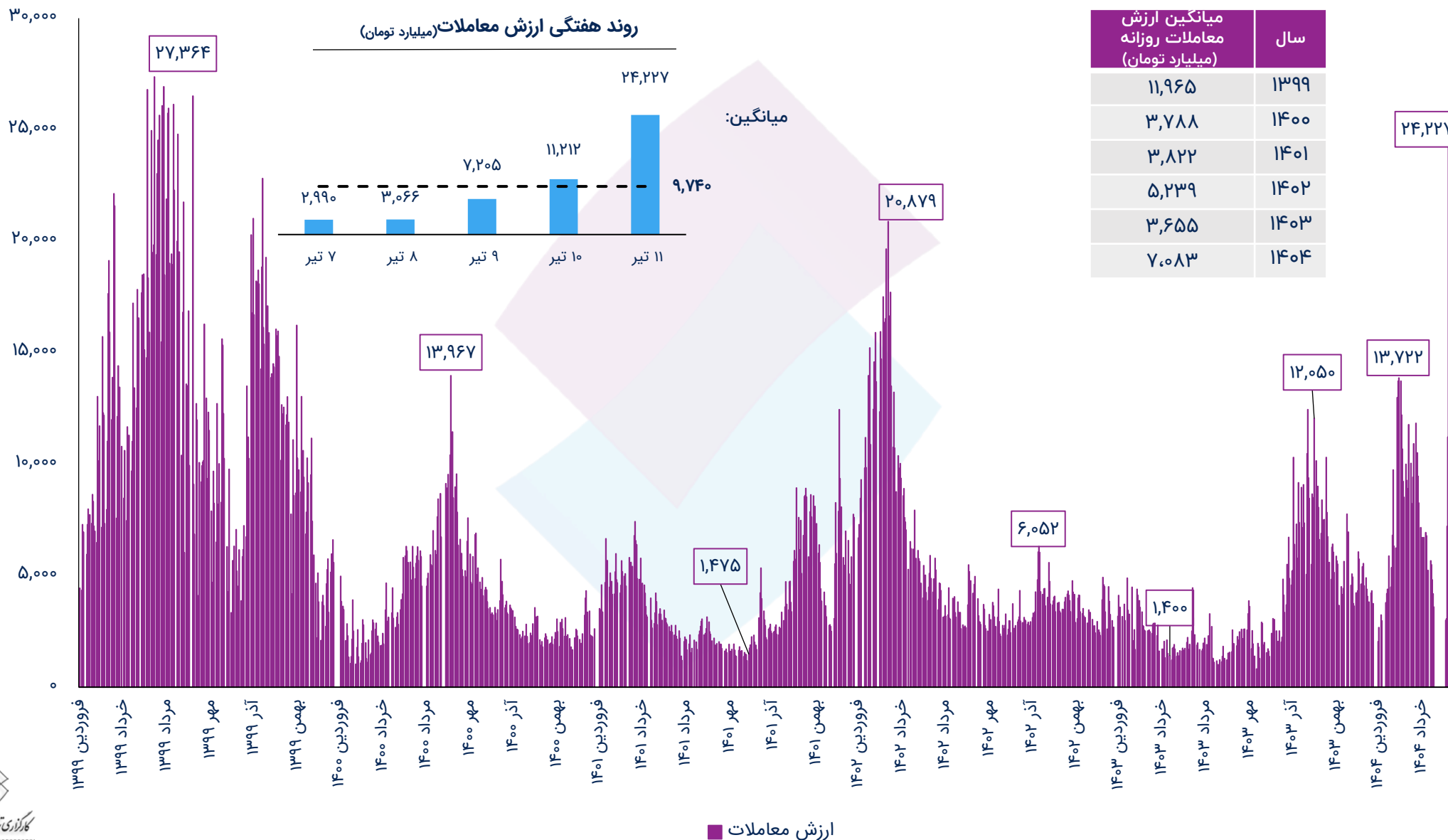
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

کاهش ۹.۹ درصدی شاخص کل در هفته جاری

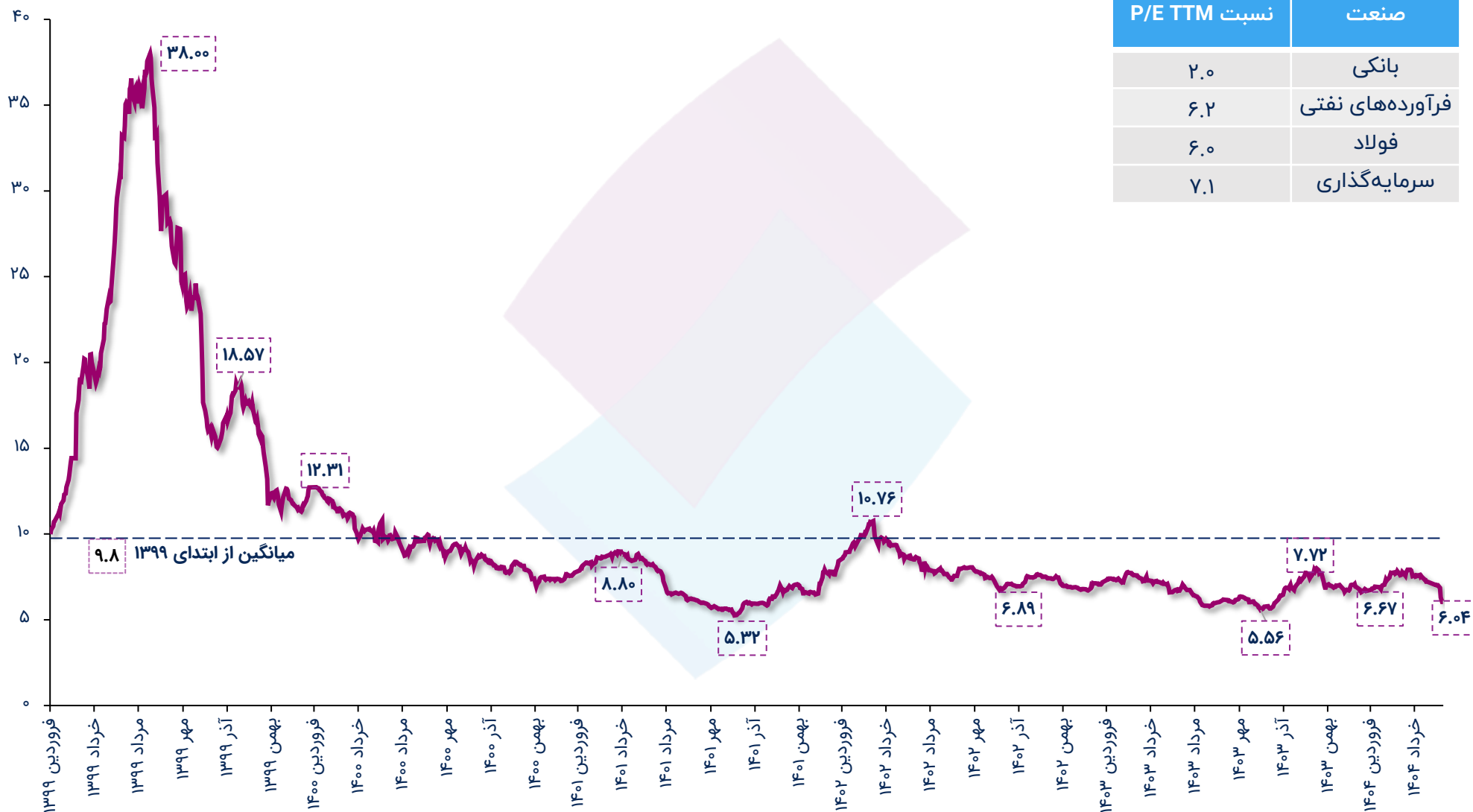
روند هفتگی شاخص کل



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

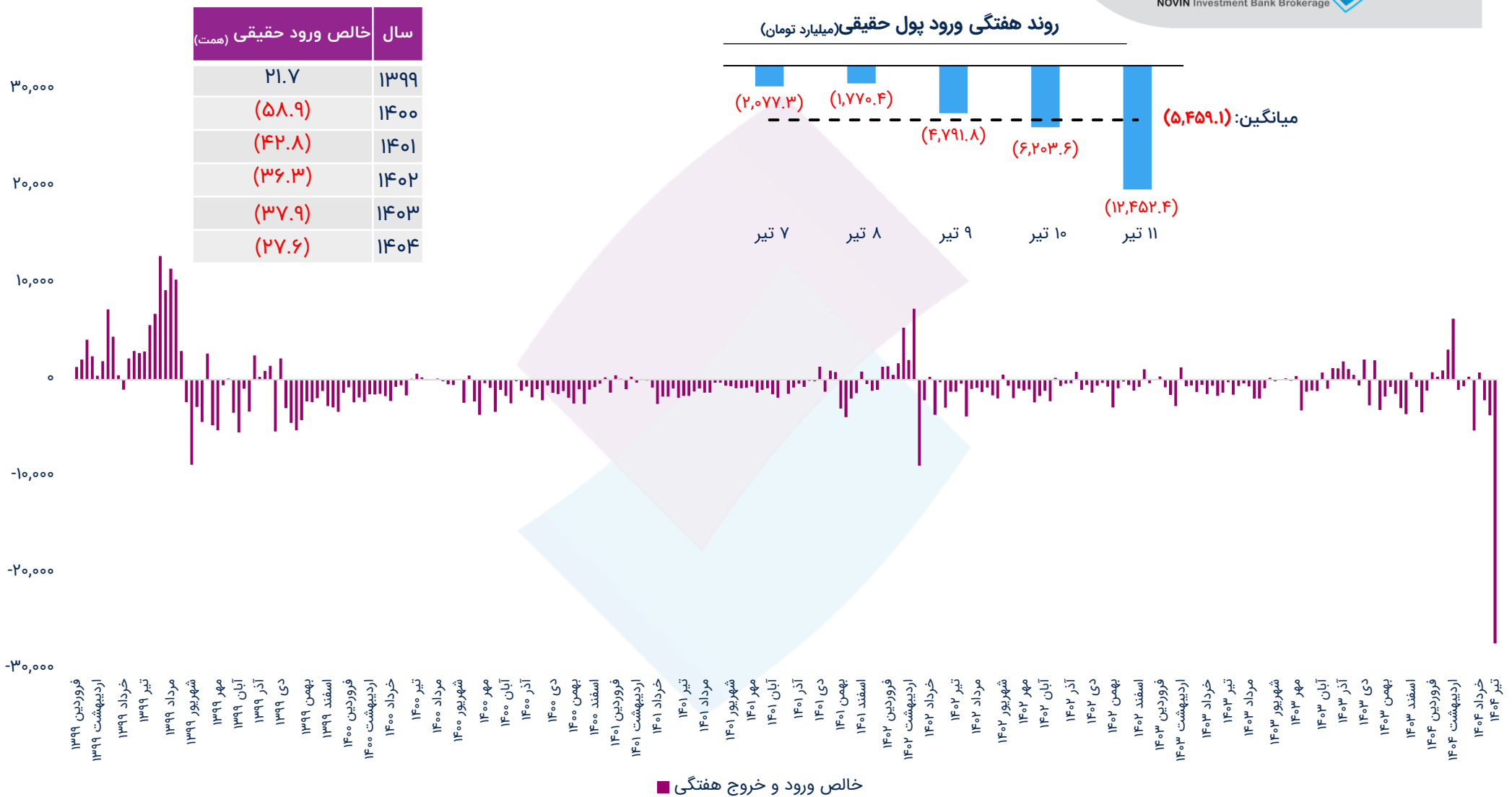


نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۰	بانکی
۶.۲	فرآورده‌های نفتی
۶.۰	فولاد
۷.۱	سرمایه‌گذاری

۲۷،۲۹۶ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۳،۶۹۶ میلیارد تومانی هفته گذشته



صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

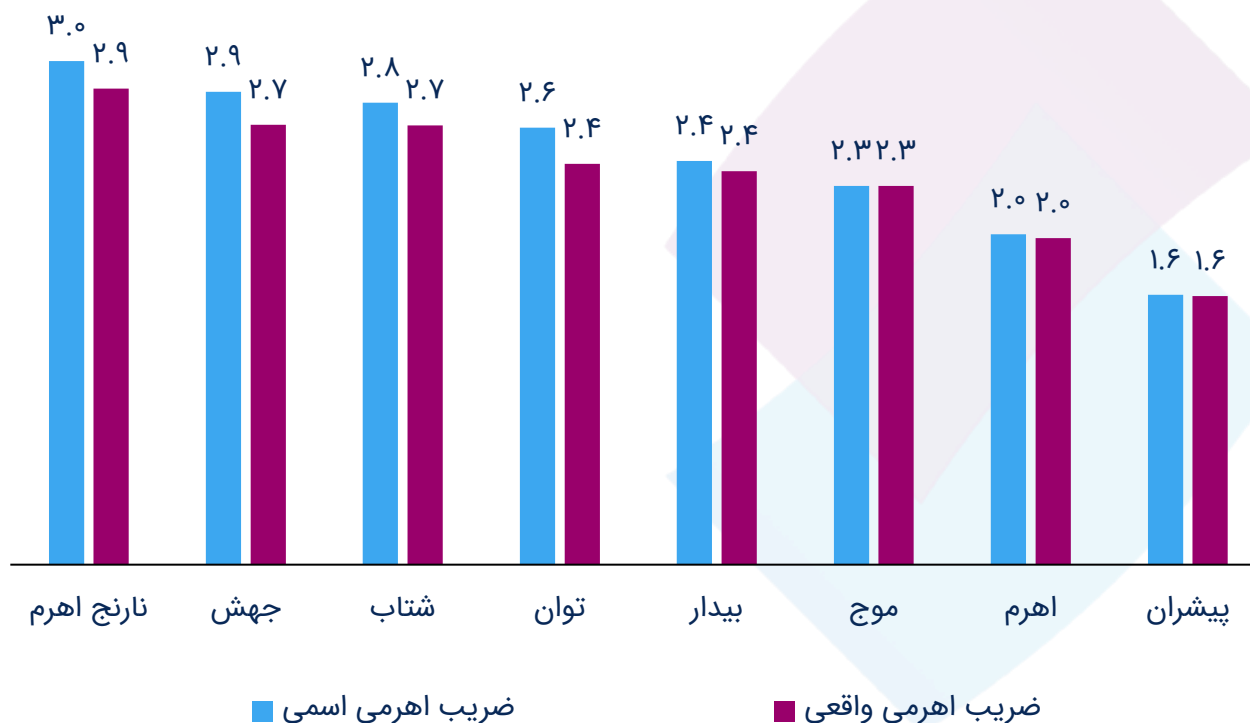
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بازدهی ماهانه

بازدهی سالانه

صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
پیشران	-۴.۳%	-
اهرم	-۳.۶%	۱.۷
بیدار	-۳.۲%	۱.۷
نارنج اهرم	-۲.۵%	۱.۷
توان	-۰.۹%	۱.۷
جهش	-۰.۳%	۱.۸
موج	-۰.۱%	۱.۷
شتاب	۲.۱%	۱.۸

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
پیشران	-۱۴.۵%	۲.۳۶%
بیدار	-۱۹.۰%	۲.۵۰%
اهرم	-۱۹.۰%	۲.۵۱%
توان	-۱۹.۰%	۲.۵۱%
موج	-۱۹.۳%	۲.۵۱%
جهش	-۱۹.۸%	۲.۵۱%
شتاب	-۲۰.۳%	۲.۵۱%
نارنج اهرم	-۲۲.۱%	۲.۵۱%

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

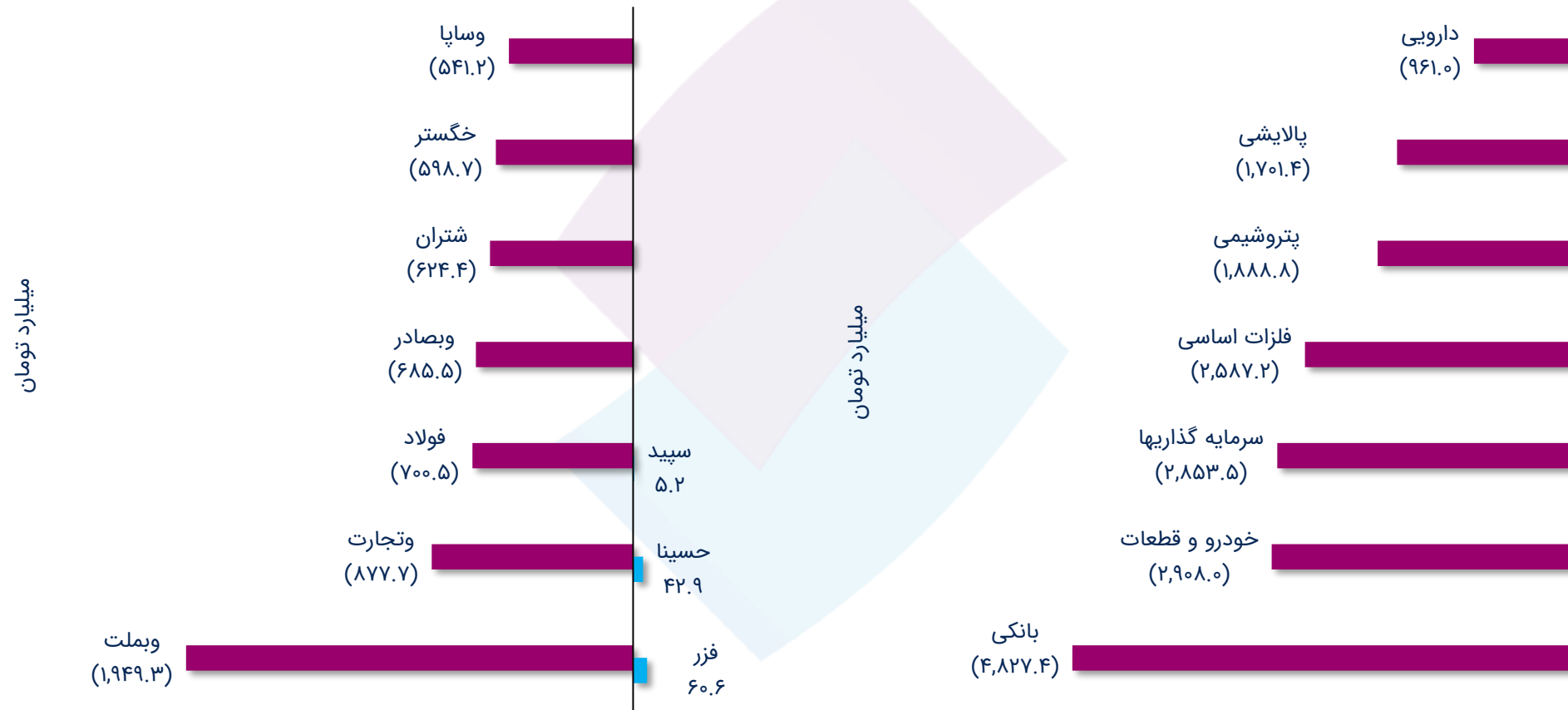
ضریب اهرمی واقعی = (خالص ارزش دارایی‌های صندوق - سپرده بانکی، اوراق و وجه نقد) / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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

نماد

صنعت



نماد

صنعت

۰.۴۵%

-۰.۱۲%

-۰.۲۶%

-۰.۳۶%

-۰.۳۸%

-۰.۴۹%

-۰.۶۰%

فزر

ولتجار

محتشم

سپ

خوساز

ثامان

چپرتو

-۱۸.۲%
خسایا

-۱۴.۰%
ولپارس

-۱۳.۹%
دالبر

-۱۳.۹%
خکرمان

-۱۳.۸%
شمس

-۱۳.۸%
پارسان

-۱۳.۷%
پخش

-۳.۴۴%

-۵.۸۵%

-۵.۹۷%

-۶.۱۰%

-۶.۴۸%

-۶.۸۹%

-۶.۹۳%

منسوجات

ماشین آلات و
دستگاه‌های
برقی

مخابرات،
اطلاعات و
ارتباطات

تأمین سرمایه

املاک و
مستغلات

پیمانکاری، فنی
و مهندسی

خرده فروشی

-۱۲.۴%

-۱۱.۹%

-۱۱.۵%

-۱۱.۰%

-۱۰.۹%

-۱۰.۸%

-۱۰.۶%

خودرو و
قطعات

ماشین آلات
و تجهیزات

سرمایه
گذارها

پالایشی

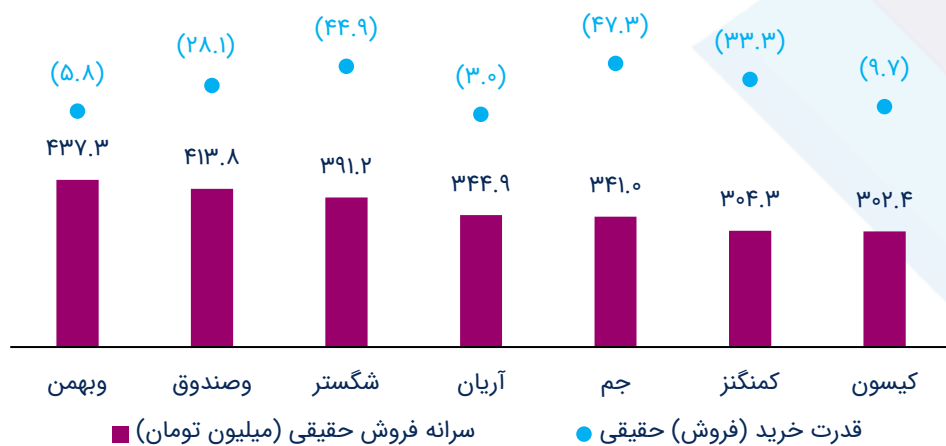
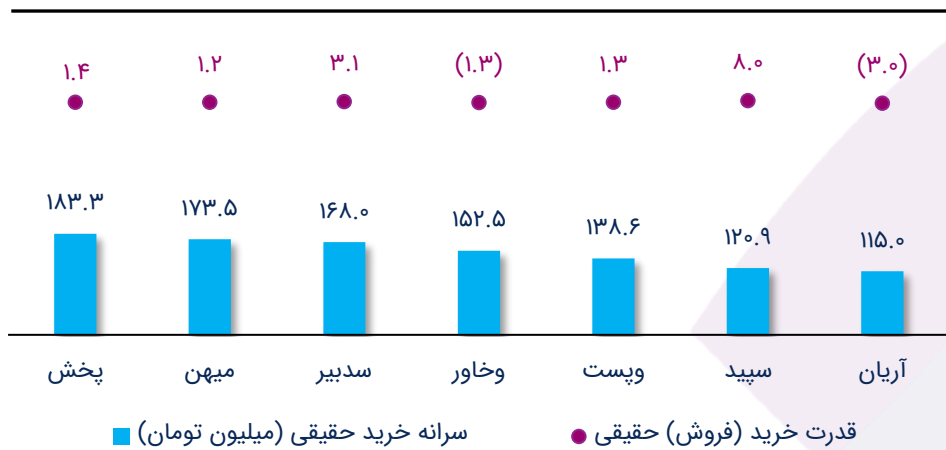
برق و گاز

زراعت و
خدمات
وابسته

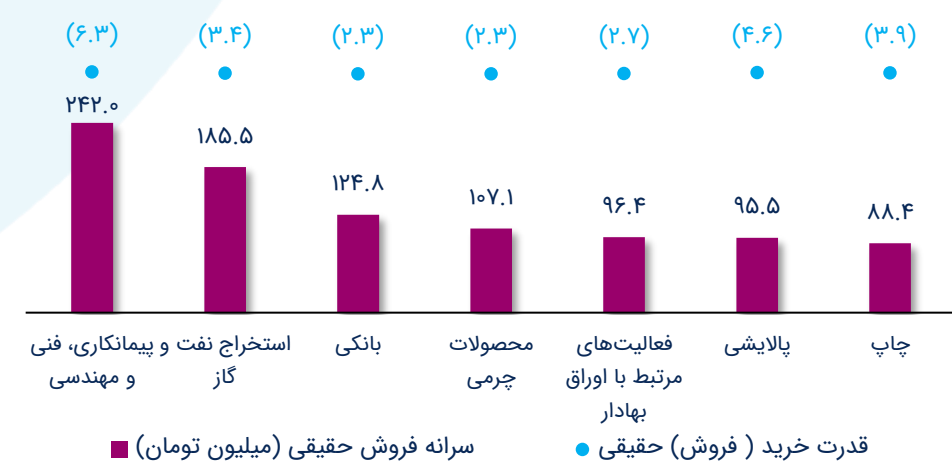
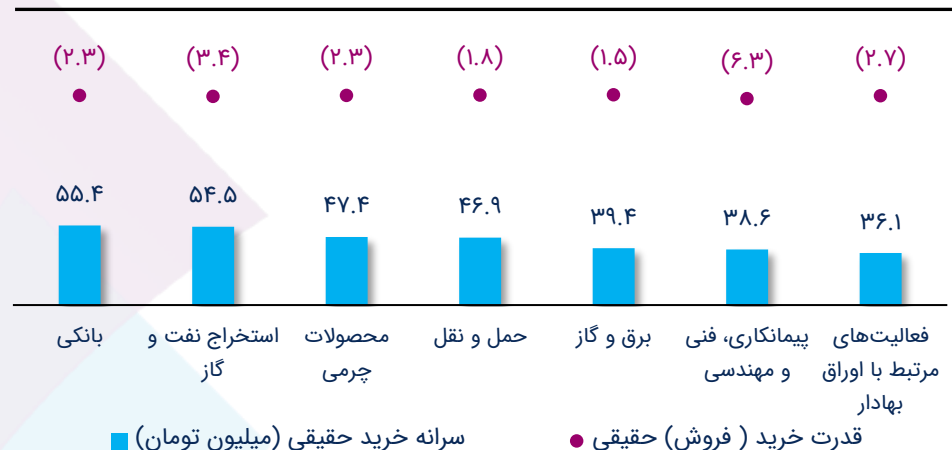
استخراج
نفت و گاز

بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت

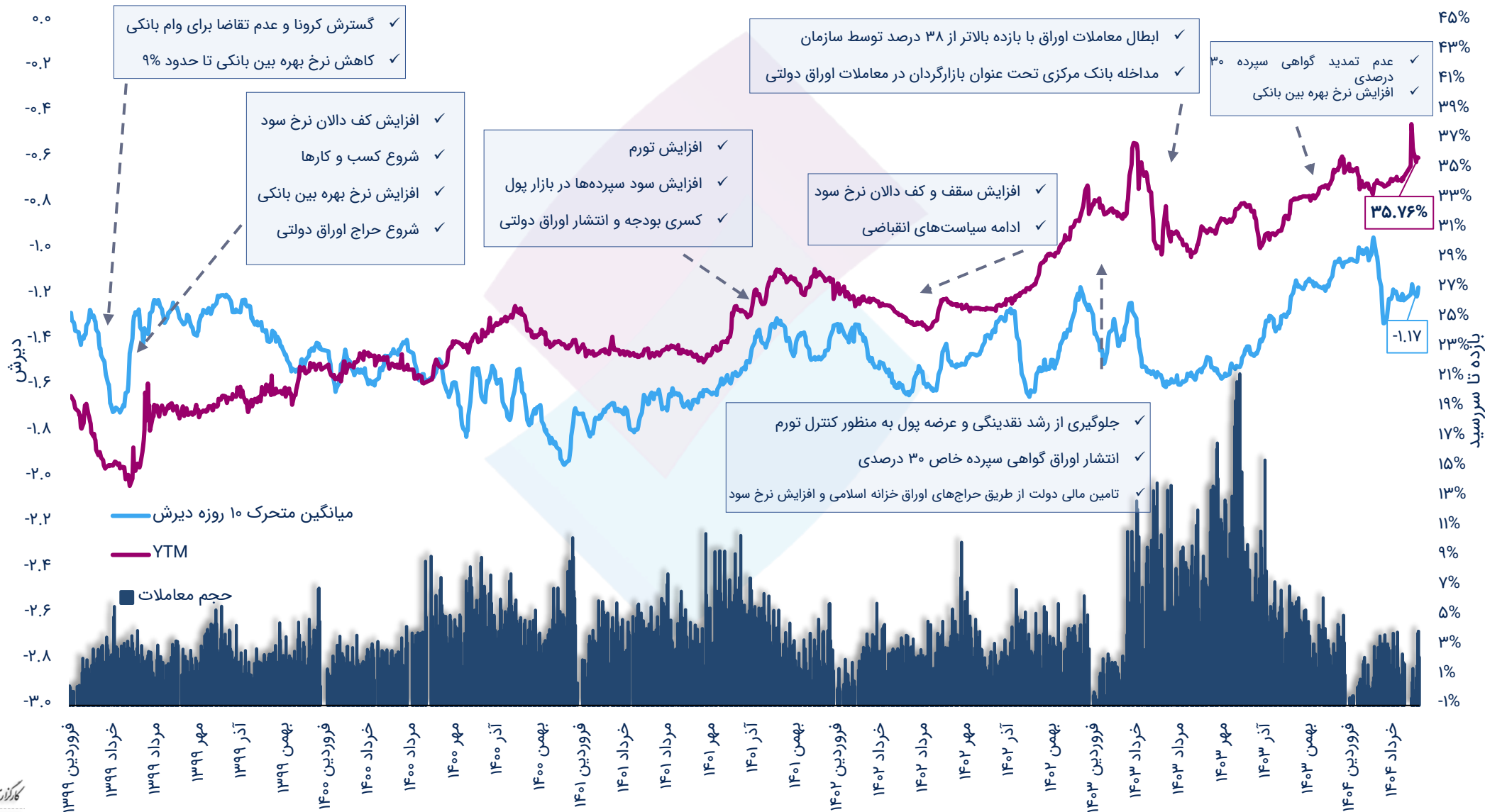


گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه					
انرژی	۲۷۰	۴۰۵	۵۰%	سود انباشته سایر اندوخته	رعایت مصوبه هیئت مدیره محترم سازمان بورس و اوراق بهادار در خصوص تعیین حداقل سرمایه مطلوب بورس ها
پارسیان	۱,۶۰۰	۵,۰۰۰	۲۱۳%	سود انباشته سایر اندوخته	اصلاح ساختار مالی
آردینه	۲۰۰	۱,۳۴۵	۵۷۳%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی ۲- تقویت سرمایه در گردش مورد نیاز شرکت از محل تجدید ارزیابی سرمایه گذاری ها و سرفصل زمین دارایی های ثابت
ومهان	۴,۵۰۰	۶,۰۰۰	۳۳%	سود انباشته	جبران مخارج سرمایه گذاری ها و استفاده از فرصت های بازار سرمایه
فاراک	۲,۴۷۰	۲,۸۰۰	۱۳%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی شرکت
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه					
پی پاد	۴۲۰	۷۰۰	۶۷%	آورده نقدی	خرید دارایی های ثابت
صدور مجوز افزایش سرمایه					
دلر	۲۲۵	۹۲۲	۳۱۰% (سود انباشته ۵۲%) (تجدید ارزیابی ۴۸%)		اصلاح ساختار مالی، تامین سرمایه در گردش و جلوگیری از خروج وجه نقد
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه					
کحافظ	۹۸۴	۲,۲۰۱	۱۲۴%	تجدید ارزیابی	اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالای ایرانی

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
حززر	۳۶۰	۱,۲۶۰	۲۵۰%	آورده نقدی	تامین مالی بخشی از پروژه ساخت یک فروند شناور و جبران مخارج گذشته بابت سرمایه‌گذاری در شرکت فرعی
قمرو	۴۰۰	۵۰۰	۲۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی
حکشتی	۸,۲۵۰	۱۱,۶۰۰	۴۱%	سود انباشته	جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه پذیر فرعی

کاهش ۰.۳۹ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۵.۷۶ درصد



بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

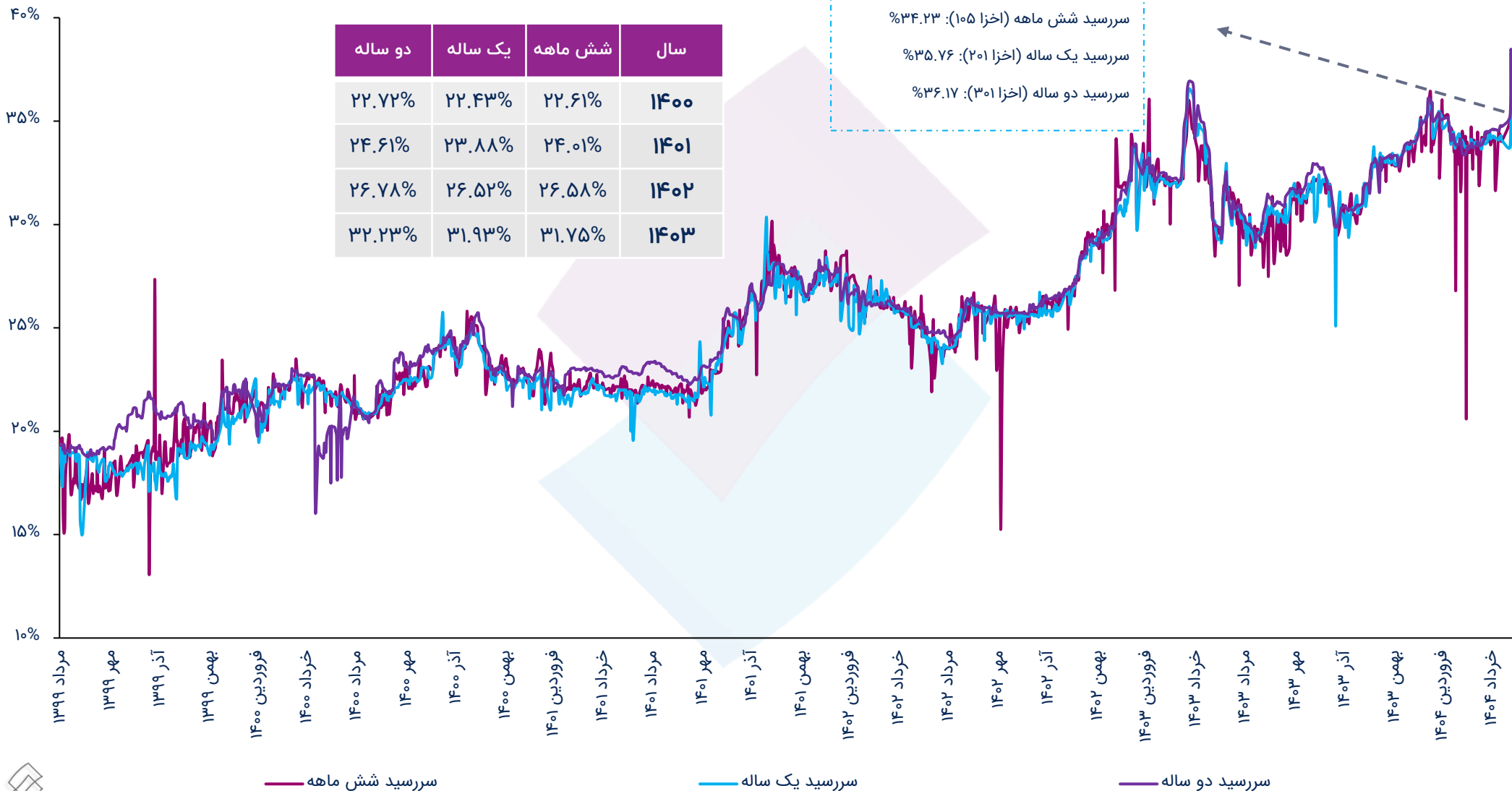
بازده اوراق خزانه در تاریخ ۱۱ تیر:

سررسید شش ماهه (اخزا ۱۰۵): ۳۴.۲۳٪

سررسید یک ساله (اخزا ۲۰۱): ۳۵.۷۶٪

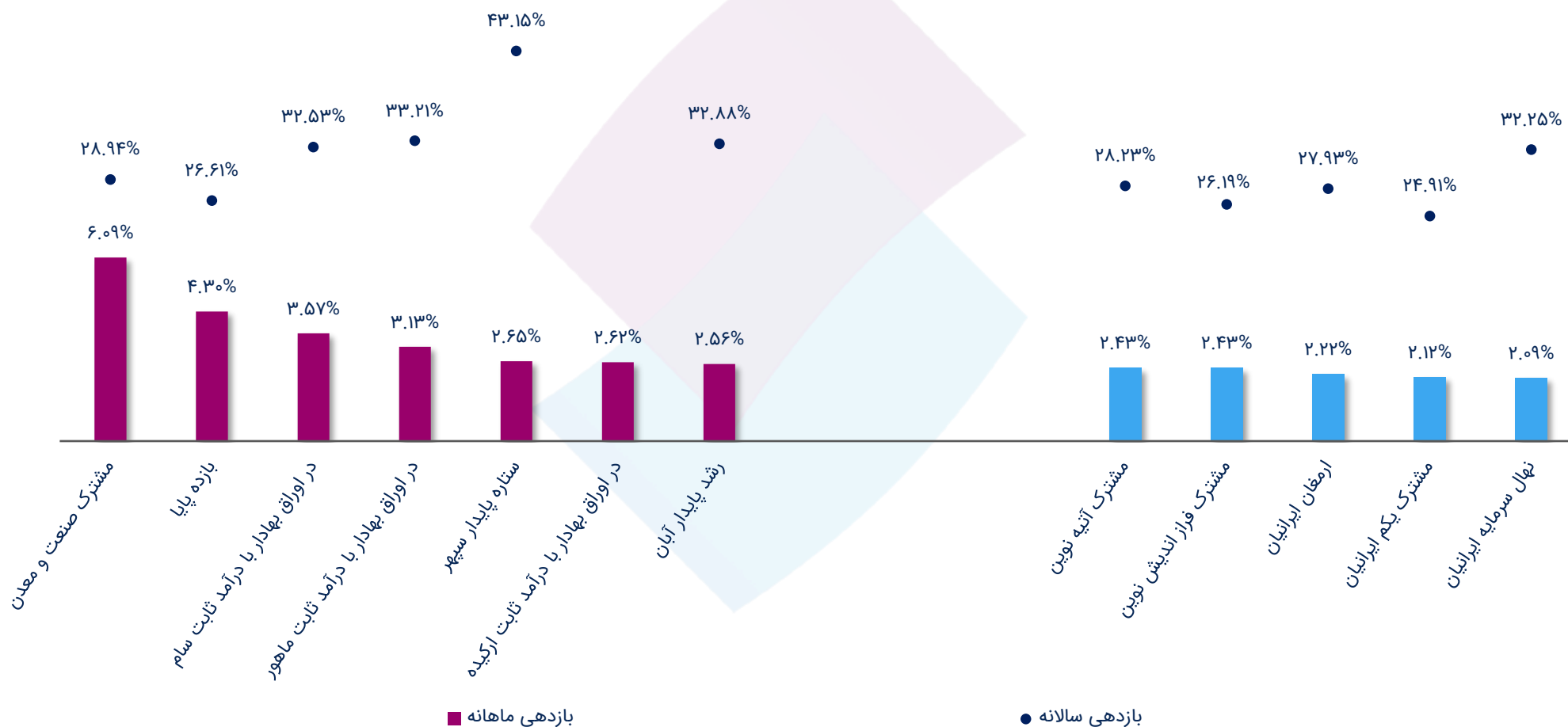
سررسید دو ساله (اخزا ۳۰۱): ۳۶.۱۷٪

سال	شش ماهه	یک ساله	دو ساله
۱۴۰۰	۲۲.۶۱٪	۲۲.۴۳٪	۲۲.۷۲٪
۱۴۰۱	۲۴.۰۱٪	۲۳.۸۸٪	۲۴.۶۱٪
۱۴۰۲	۲۶.۵۸٪	۲۶.۵۲٪	۲۶.۷۸٪
۱۴۰۳	۳۱.۷۵٪	۳۱.۹۳٪	۳۲.۲۳٪

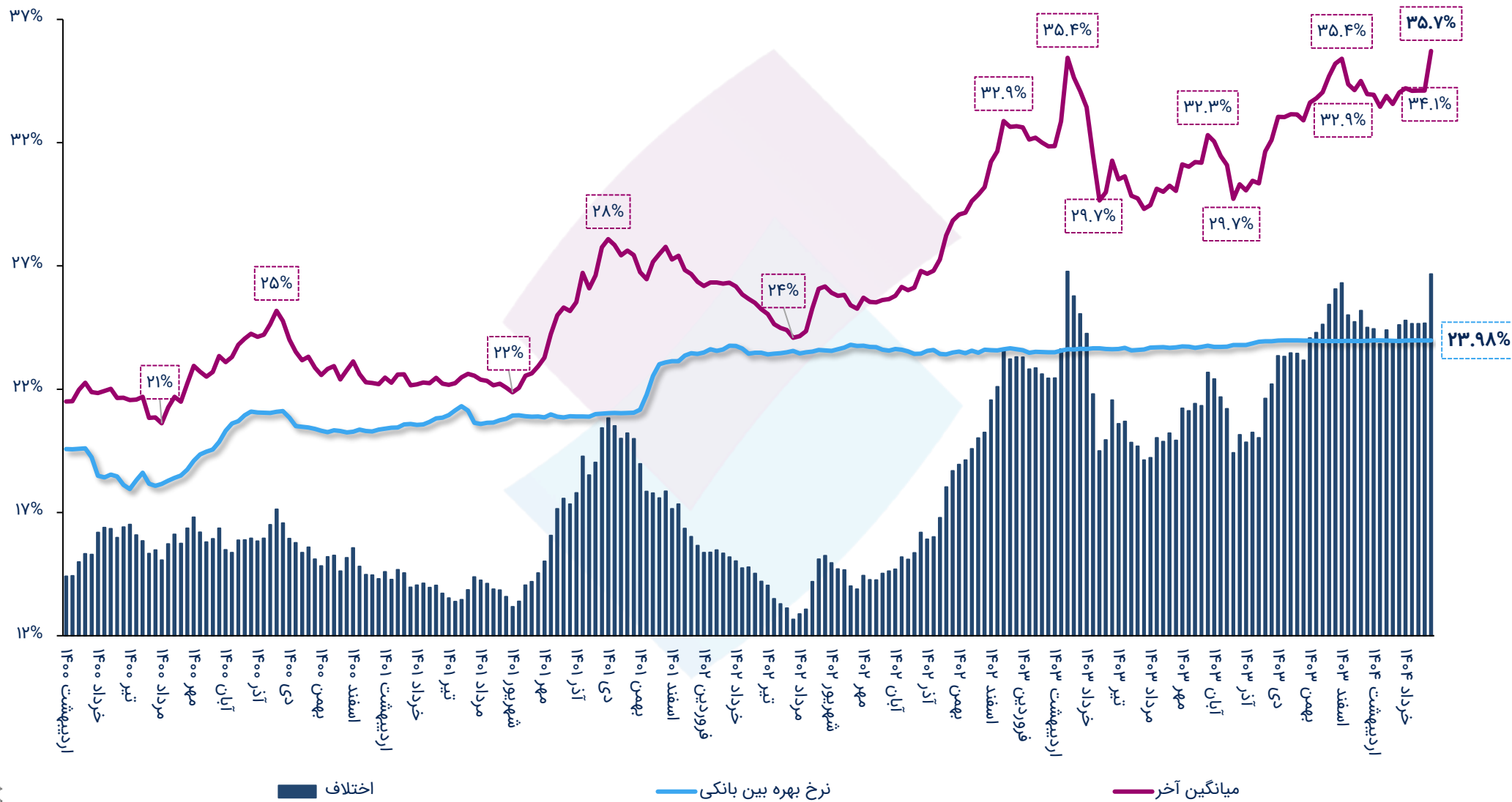


صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



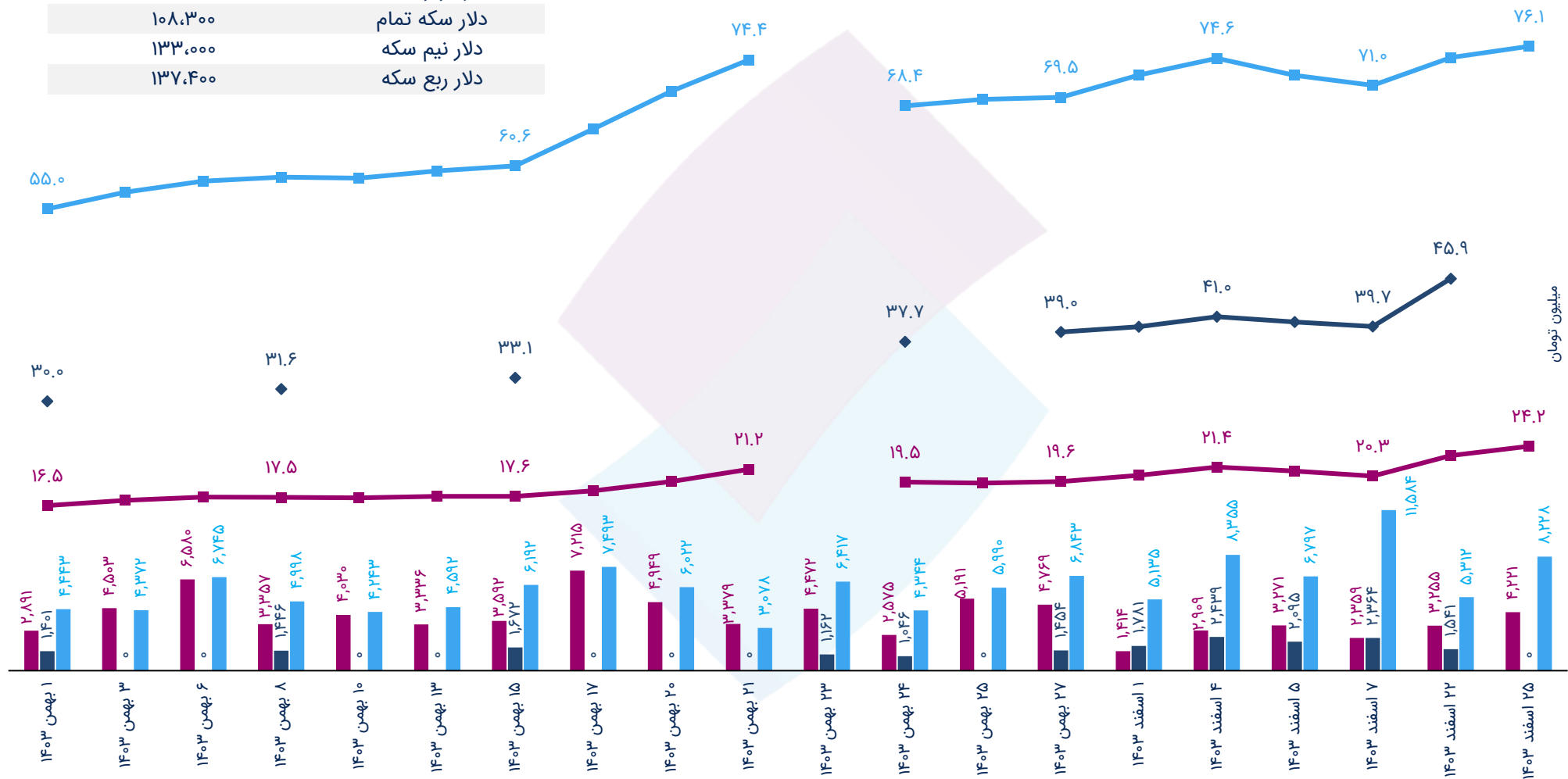
افزایش ۰.۰۱ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۹۸ درصد و اجرای سومین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به مبلغ ۱۴.۸ همت



معامله ۹۴۳ هزار و ۷۲۷ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ
مبلغ (تومان)

۷۰,۶۷۶	دلار مرکز مبادله
۱۰۸,۳۰۰	دلار سکه تمام
۱۳۳,۰۰۰	دلار نیم سکه
۱۳۷,۴۰۰	دلار ربع سکه



تعداد سکه ربع معامله شده

تعداد سکه نیم معامله شده

تعداد سکه تمام معامله شده

قیمت ربع سکه

قیمت نیم سکه

قیمت سکه تمام

در حراج ۲۳ بهمن قیمت ها اطلاع رسانی نشده اند.

معامله ۱۹ هزار و ۳۰۱ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

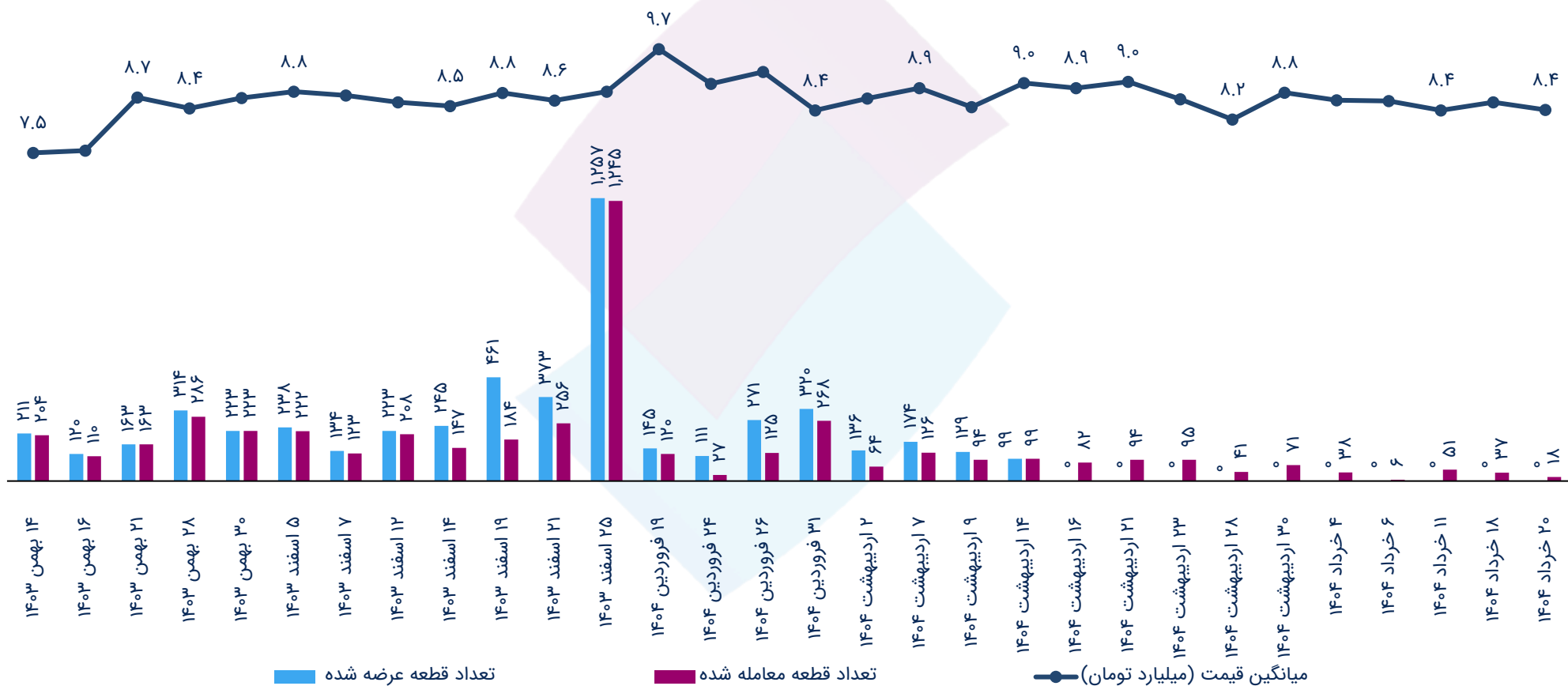
آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

۷۱,۱۳۱

دلار مرکز مبادله

۷۸,۵۰۰

دلار شمش طلا مرکز مبادله



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

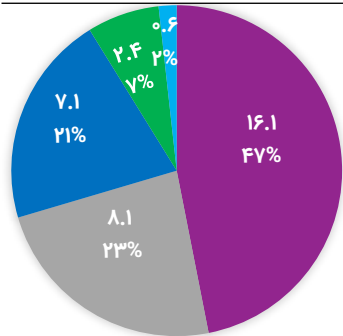
در روزهای حراجی که تعداد قطعه عرضه شده برابر با صفر است، در اطلاعیه مربوطه تعداد آن مشخص نگردیده.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

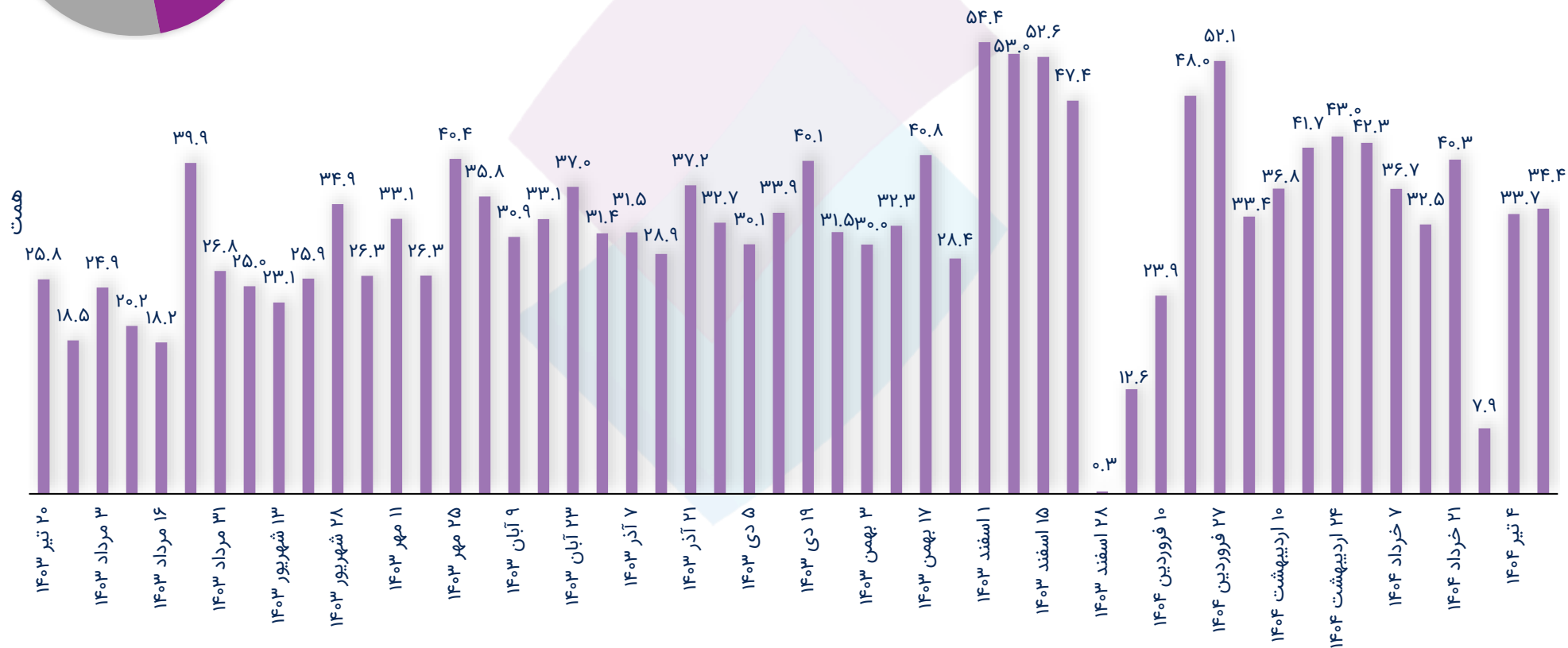
سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۴۳.۰%	۲,۳۲۹	-۱.۵%	۳,۳۸۱	-۰.۱%	۳,۳۳۳	۳,۳۳۱	طلا (دلار/انس)
۹۴.۶%	۴۲۹,۰۳۰	۱۴.۳%	۷۳۰,۱۰۰	۱۰.۰%	۷۵۹,۱۰۰	۸۳۴,۸۰۰	سکه (هزار ریال)
۵۴.۳%	۴۶۱,۶۷۰	۰.۰%	۷۱۱,۹۷۷	-۰.۱%	۷۱۲,۷۱۱	۷۱۲,۲۷۲	دلار اسکنا (ریال)
۶۰.۷%	۴۳۱,۰۶۴	۰.۰%	۶۹۲,۵۸۵	-۰.۱%	۶۹۳,۲۹۹	۶۹۲,۸۷۲	دلار حواله (ریال)
-۲۲.۲%	۸۷	۴.۲%	۶۵	-۰.۵%	۶۸	۶۷	نفت برنت (دلار/بشکه)
۷۹.۰%	۶۰,۱۳۶	۱.۷%	۱۰۵,۸۸۲	۰.۳%	۱۰۷,۳۶۱	۱۰۷,۶۶۱	بیت کوین (دلار)
۵.۴%	۹,۵۴۷	۴.۲%	۹,۶۵۰	۲.۶%	۹,۸۰۹	۱۰,۰۶۰	مس LME (دلار/تن)
-۵.۳%	۲,۸۷۱	۲.۵%	۲,۶۵۳	۱.۰%	۲,۶۹۱	۲,۷۱۸	روی LME (دلار/تن)
-۱۲.۷%	۴۹۷	-۱.۴%	۴۴۰	-۰.۱%	۴۳۴	۴۳۴	بیلت CIS (دلار/تن)
۲.۰%	۴۲۰	۲.۰%	۴۲۰	-۰.۴%	۴۳۰	۴۲۸	بیلت ایران (دلار/تن)
-۱۰.۳%	۲۹۲	۲.۳%	۲۵۶	۰.۰%	۲۶۲	۲۶۲	متانول CFR (\$/mt)
۳۰.۵%	۳۳۲	۱۲.۵%	۳۸۵	۷.۳%	۴۰۳	۴۳۳	سبب اوره (\$/mt)
۶۴.۶%	۲.۰۶	۱۳.۰%	۳	۰.۰%	۳.۳۹	۳.۳۹	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



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



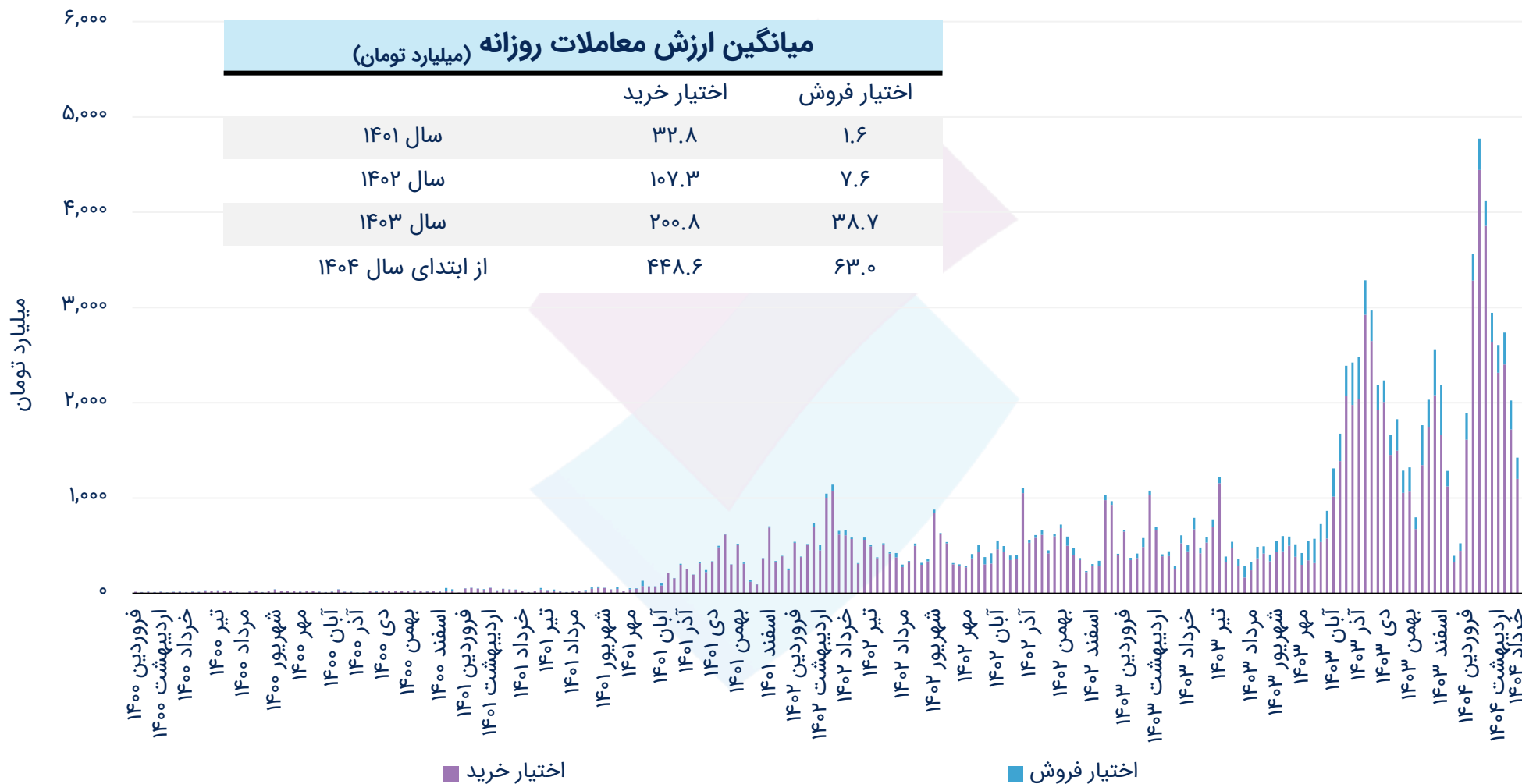
ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

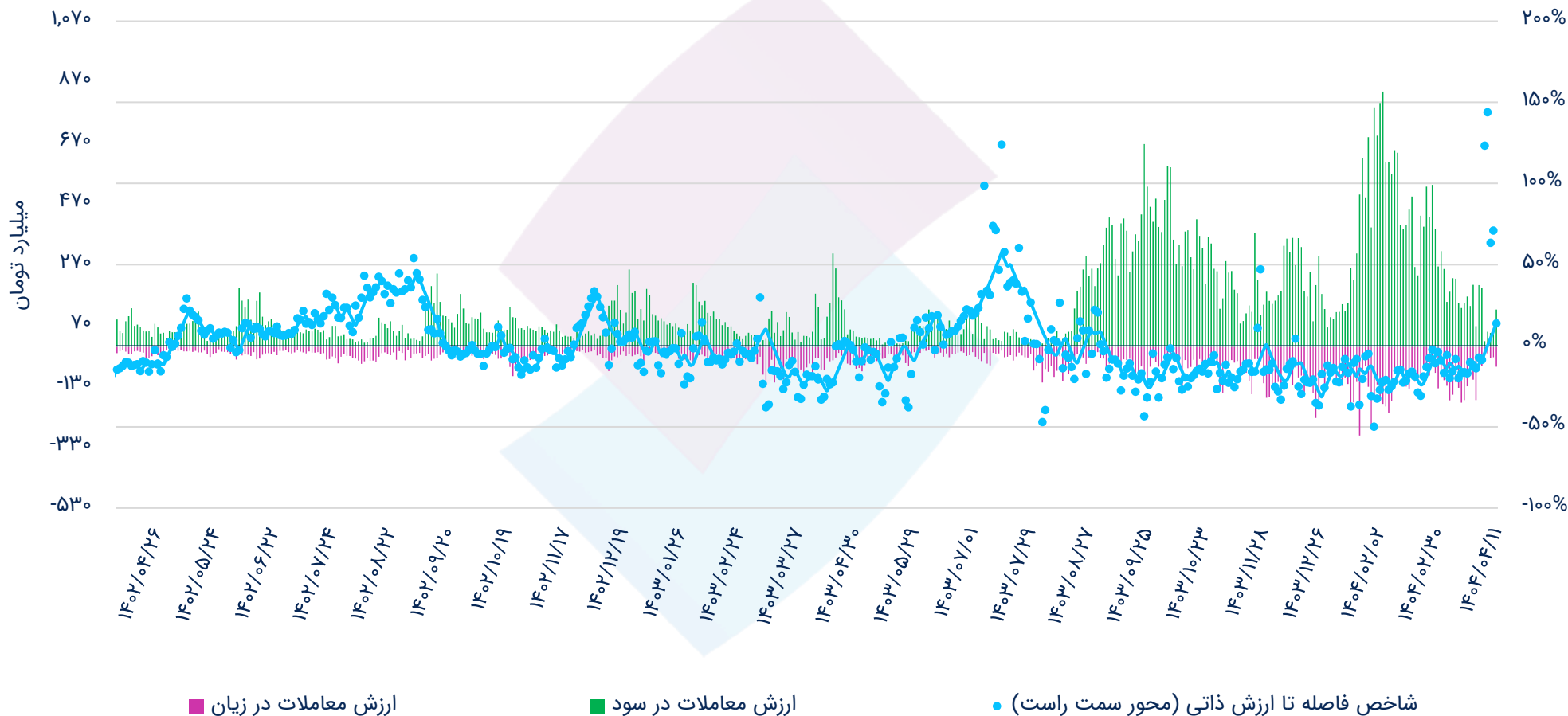
شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
سیمان	۲.۲	۱,۰۸۶,۰۰۸	بین المللی ساروج بوشهر، توسعه گستر هلال خاورمیانه (سیمان مارگون)، ساروج اصفهان، سیمان آبیگ، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان آرتا اردبیل، سیمان اردستان، سیمان ارومیه، سیمان استهبان، سیمان اصفهان، سیمان اکباتان، سیمان ایلام، سیمان باقران، سیمان بجنورد، سیمان بهبهان، سیمان پیوند گلستان، سیمان تهران، سیمان توسعه ماهان کرمان، سیمان جوبین، سیمان خاش، سیمان خاکستری نی ریز، سیمان خزر، سیمان خمسه، سیمان خوزستان، سیمان داراب، سیمان دشتستان، سیمان دورود، سیمان زابل، سیمان زاوه تربت، سیمان زنجان، سیمان ساوه
شمش بلوم	۲۹.۰	۱۶۹,۱۲۵	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، شرکت معدنی وصنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، فولاد کاوه جنوب کیش، مجتمع فولاد خراسان، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد
آهن اسفنجی	۱۶.۱	۱۲۱,۲۵۰	پارس فولاد سبزووار، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صبا فولاد خلیج فارس، آهن و فولاد غدیر ایرانیان
وکیوم باتوم	۲۵.۱	۱۲۰,۵۰۰	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
میلگرد	۳۴.۰	۴۰,۶۳۹	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، 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
تختال	۲۹.۹	۴۰,۰۰۰	فولاد هرمزگان جنوب
ورق سرد	۳۹.۴	۳۹,۲۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، فولاد غرب آسیا
پلی اتیلن سبک خطی	۶۰.۵	۱۰,۰۸۶	پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی جم، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مهاباد
پلی اتیلن سنگین فیلم	۵۸.۸	۹,۹۹۹	پتروشیمی آریا ساسول، پتروشیمی ایلام، پتروشیمی بندرامام، پتروشیمی مهر، پتروشیمی میاندوآب
پلی اتیلن ترفتالات	۷۵.۲	۹,۸۳۴	پتروشیمی تندگویان، Wankai New Materials Co.,Ltd
پلی پروپیلن نساجی	۷۹.۳	۹,۶۲۶	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی مارون، نوید زرشمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
پلی اتیلن سبک فیلم	۶۷.۴	۹,۳۷۴	پتروشیمی آریا ساسول، پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی بندرامام، پتروشیمی کردستان، پتروشیمی لاله
شمش آلومینیوم	۲۱۷.۵	۸,۳۰۰	آلومینای ایران، آلومینیوم المهدی، آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب
مس کاتد	۷۱۱.۴	۳,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
مس مفتول	۷۳۳.۵	۲,۴۸۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، گروه صنایع کابلسازی افق البرز، صنایع مس کاوه



روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

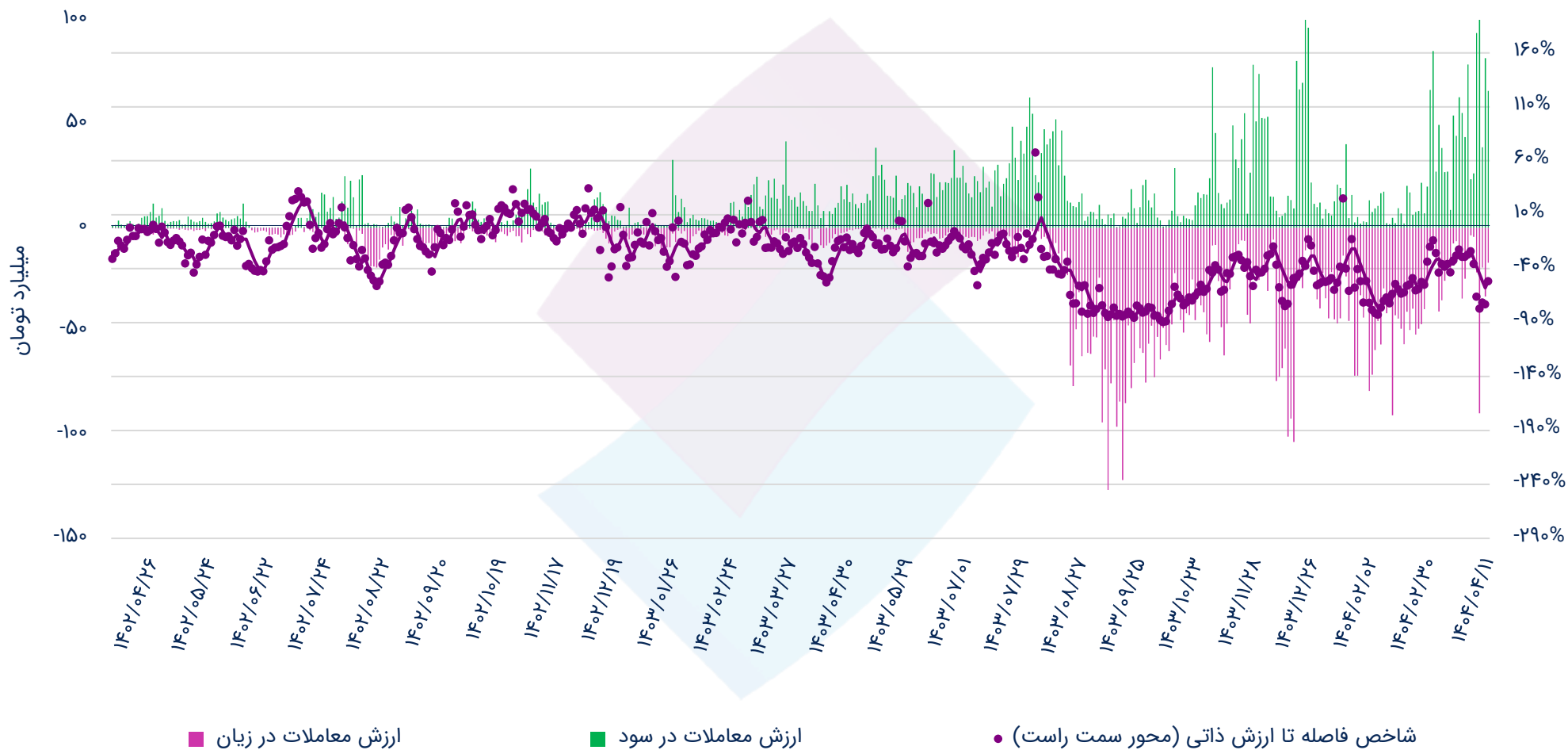


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

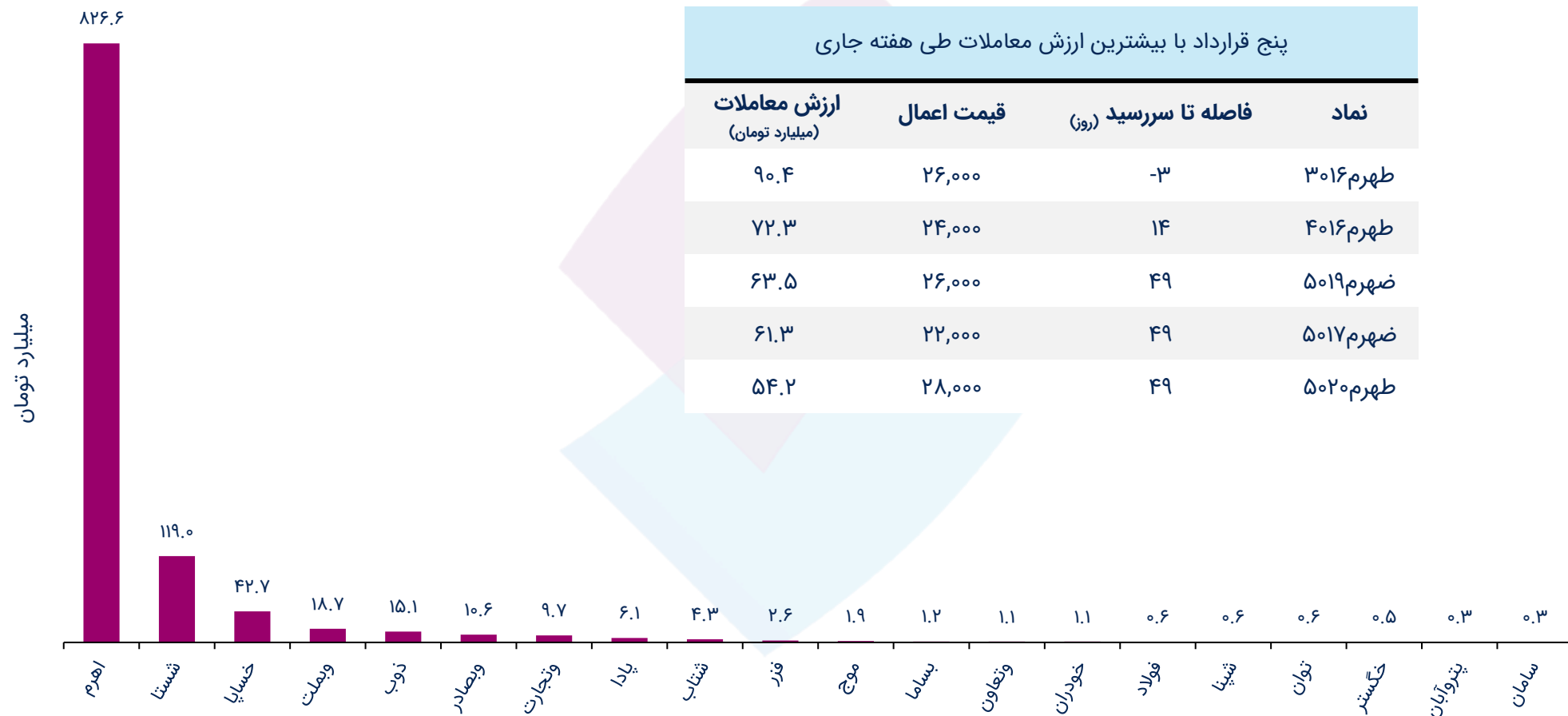
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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)