

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 ۱۸ تیر - شماره ۲۰۵

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



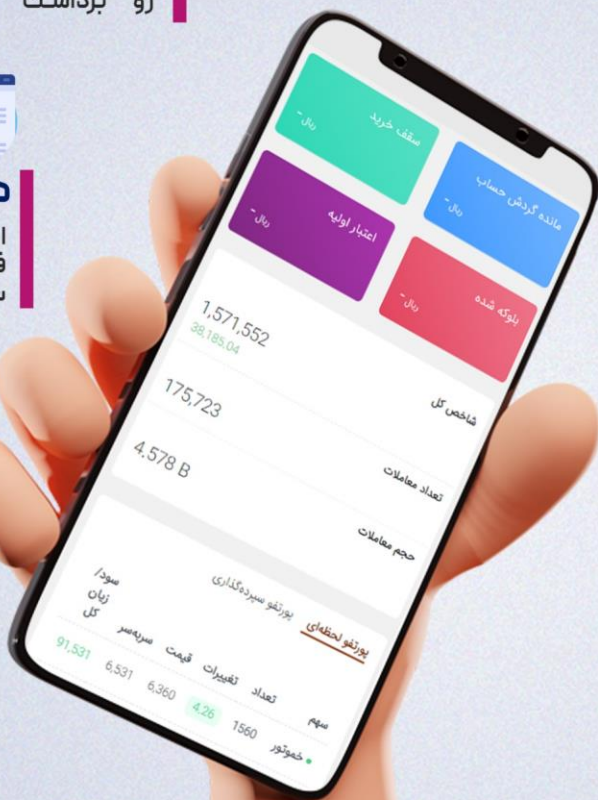
برداشت وجه آتی

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

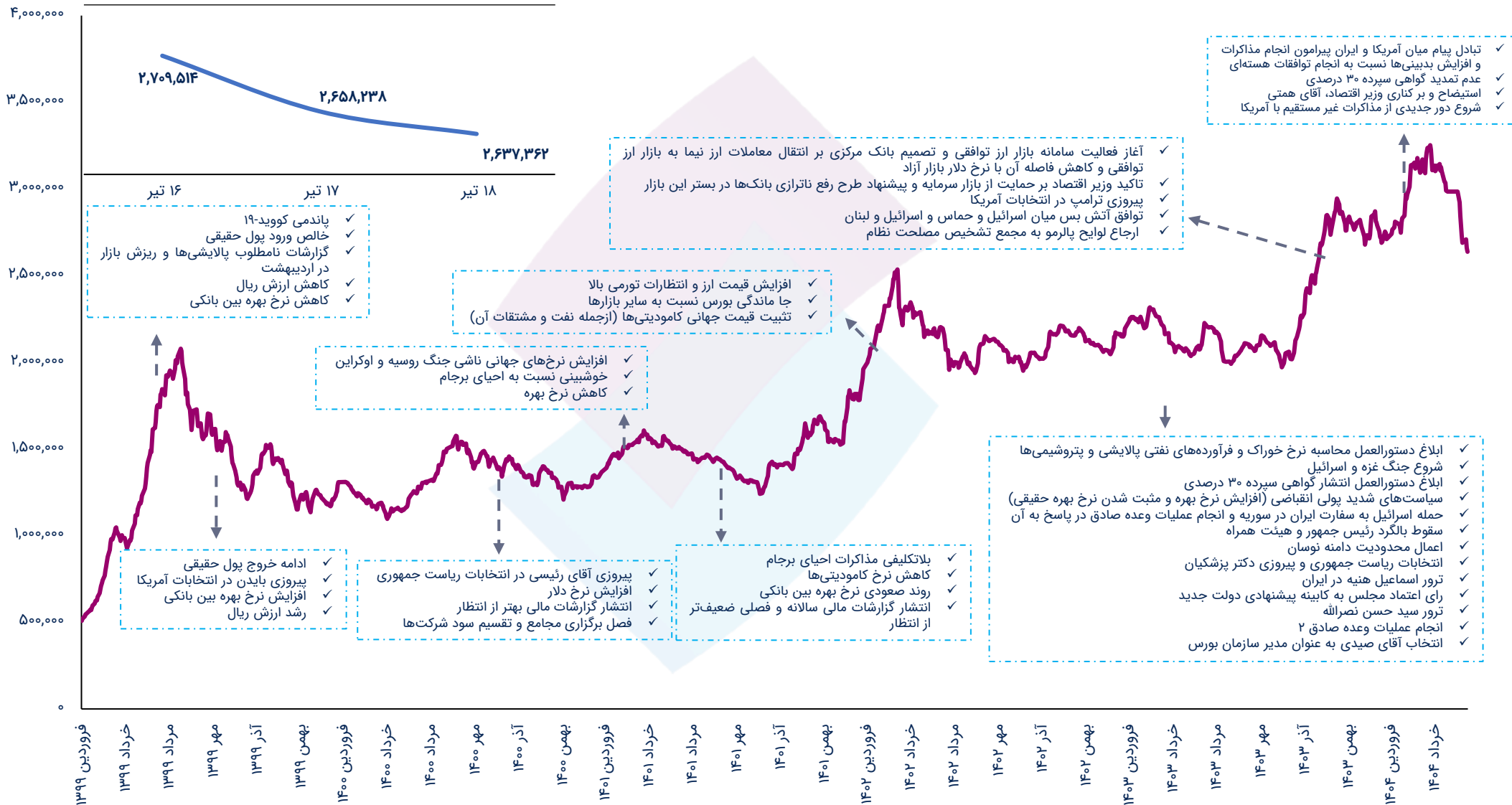
کارگزاری تأمین سرمایه نوین



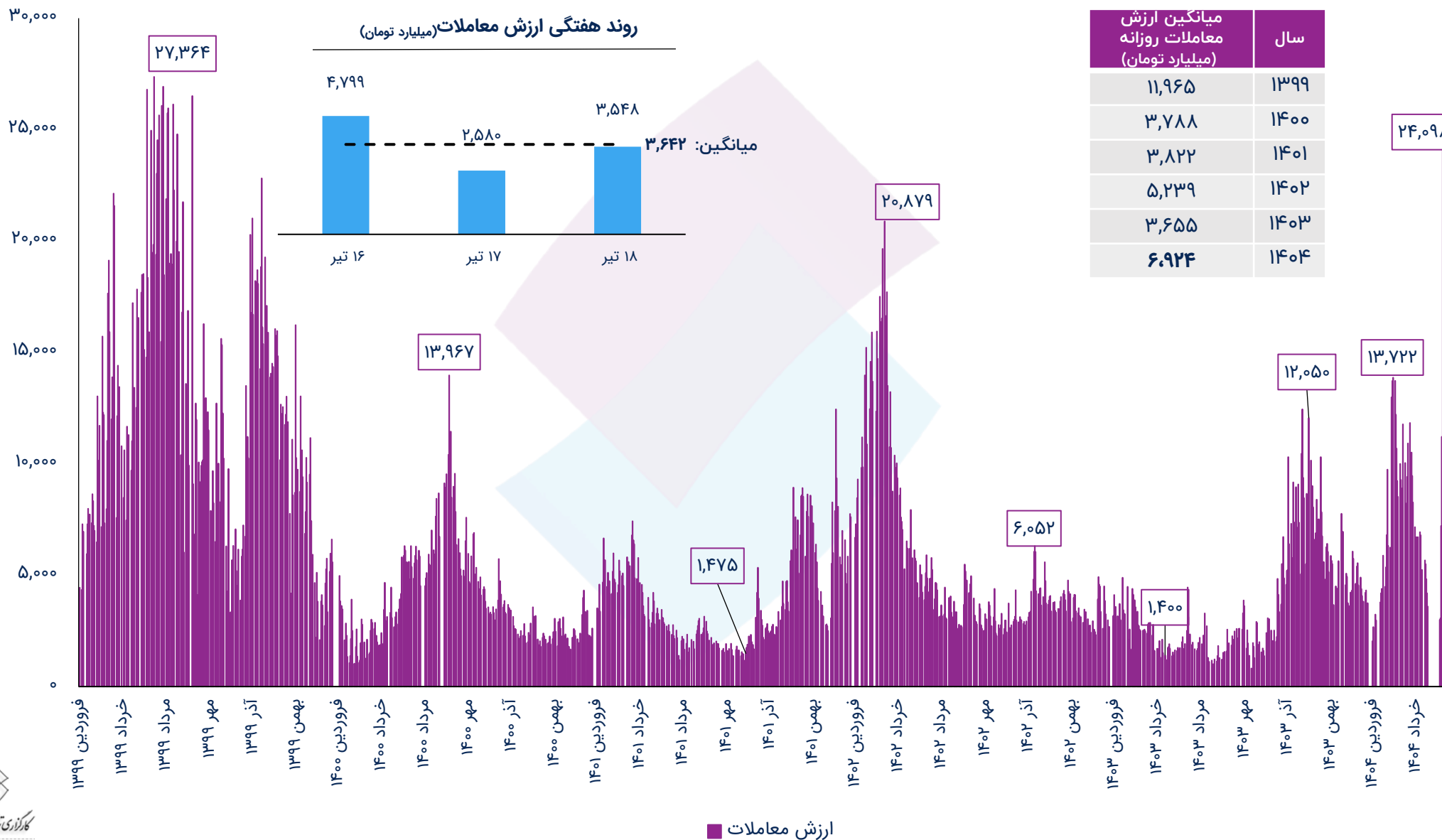
وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

کاهش ۱.۹ درصدی شاخص کل در هفته جاری

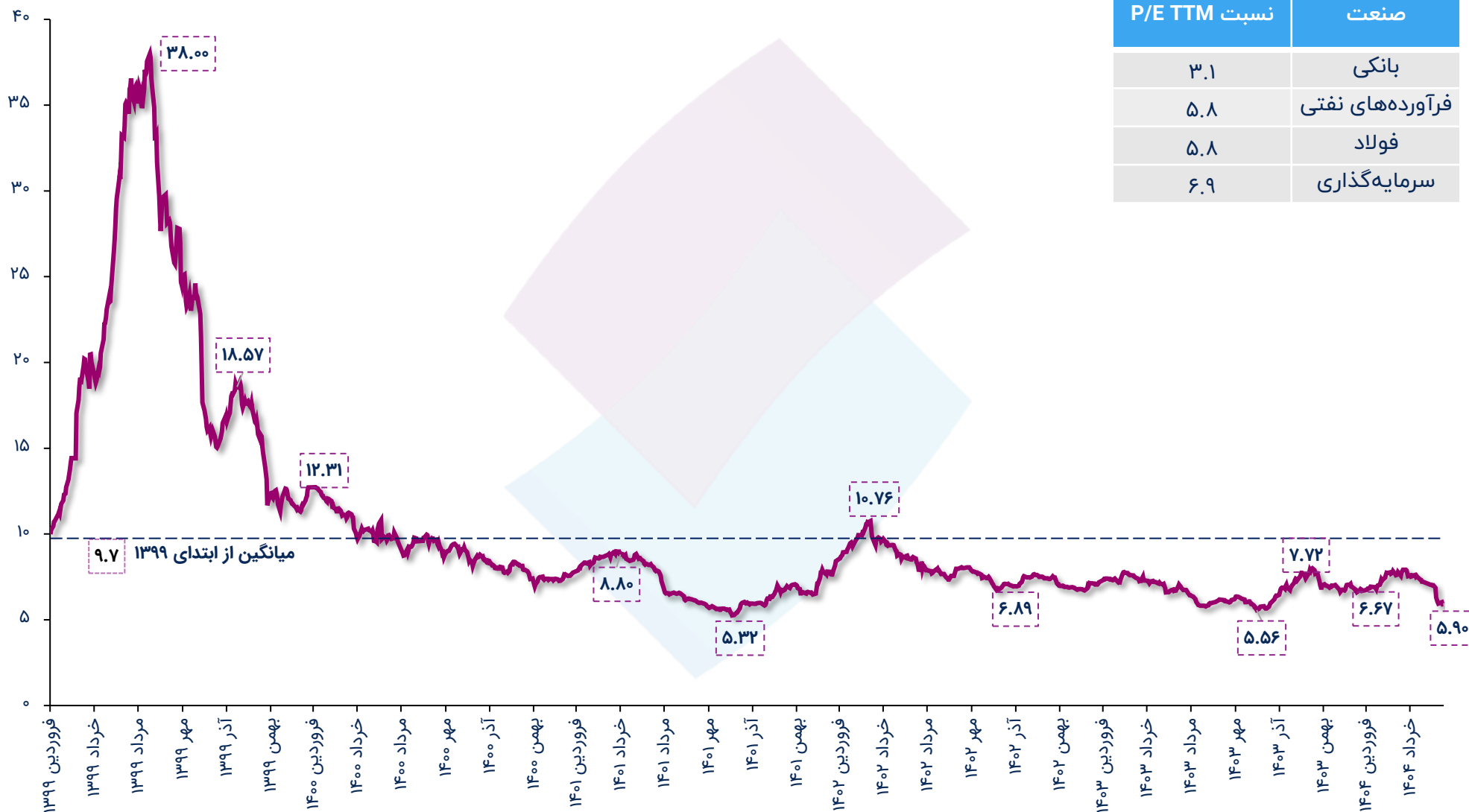
رند هفتگی شاخص کل



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



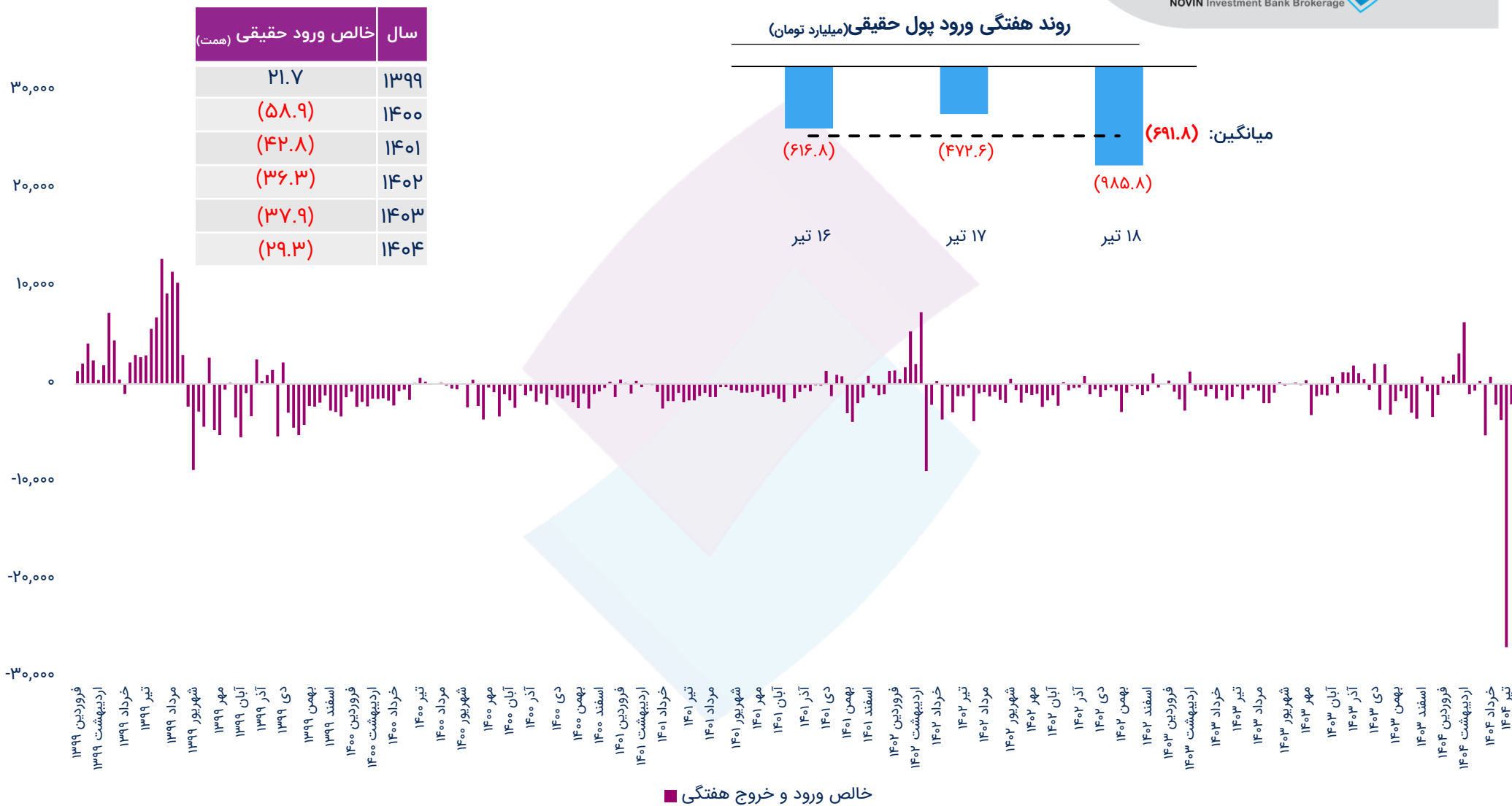
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۳.۱	بانکی
۵.۸	فرآورده‌های نفتی
۵.۸	فولاد
۶.۹	سرمایه‌گذاری

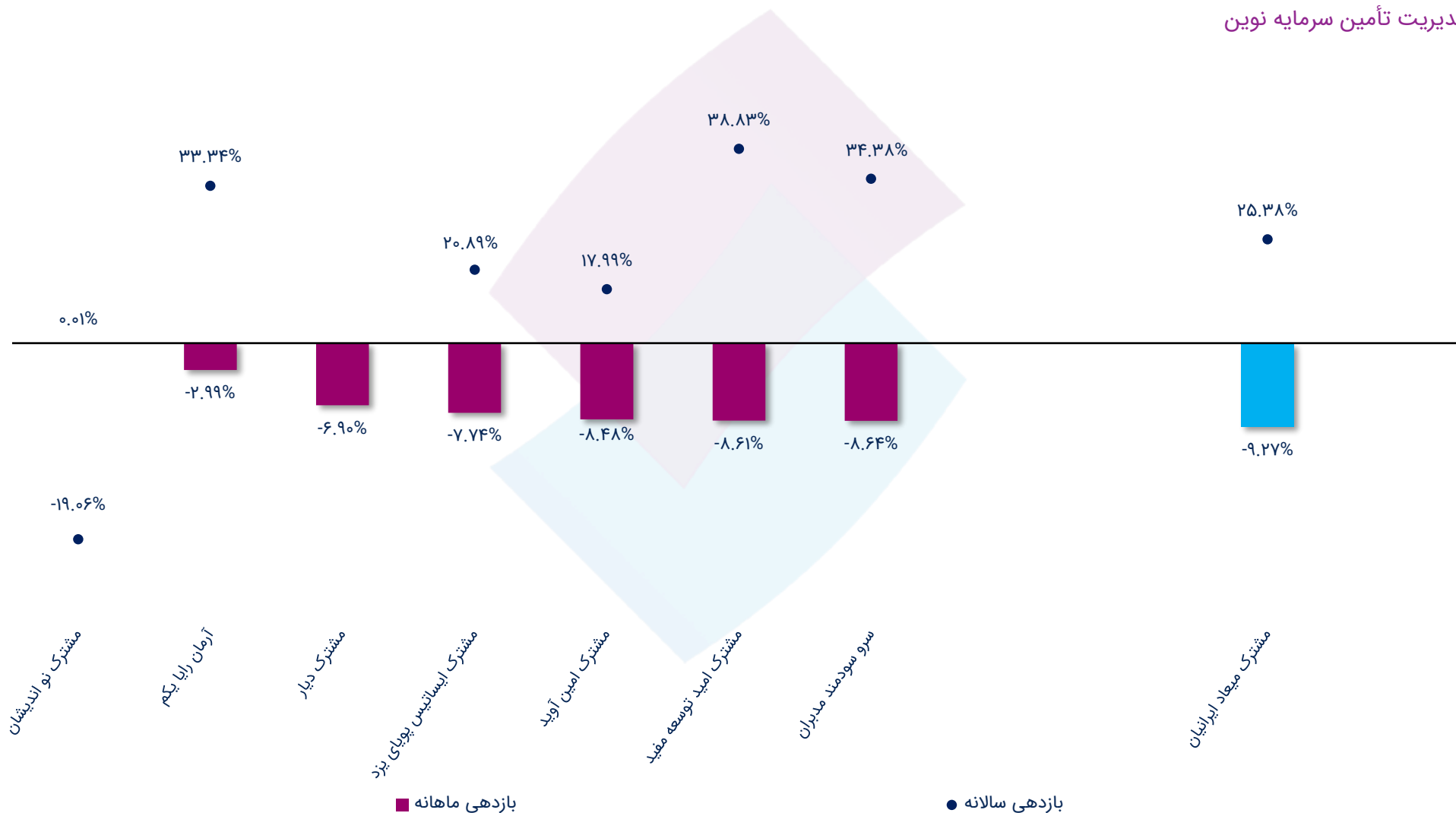
۲,۰۷۵ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۲۶,۹۳۷ میلیارد تومانی هفته گذشته

رند هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)

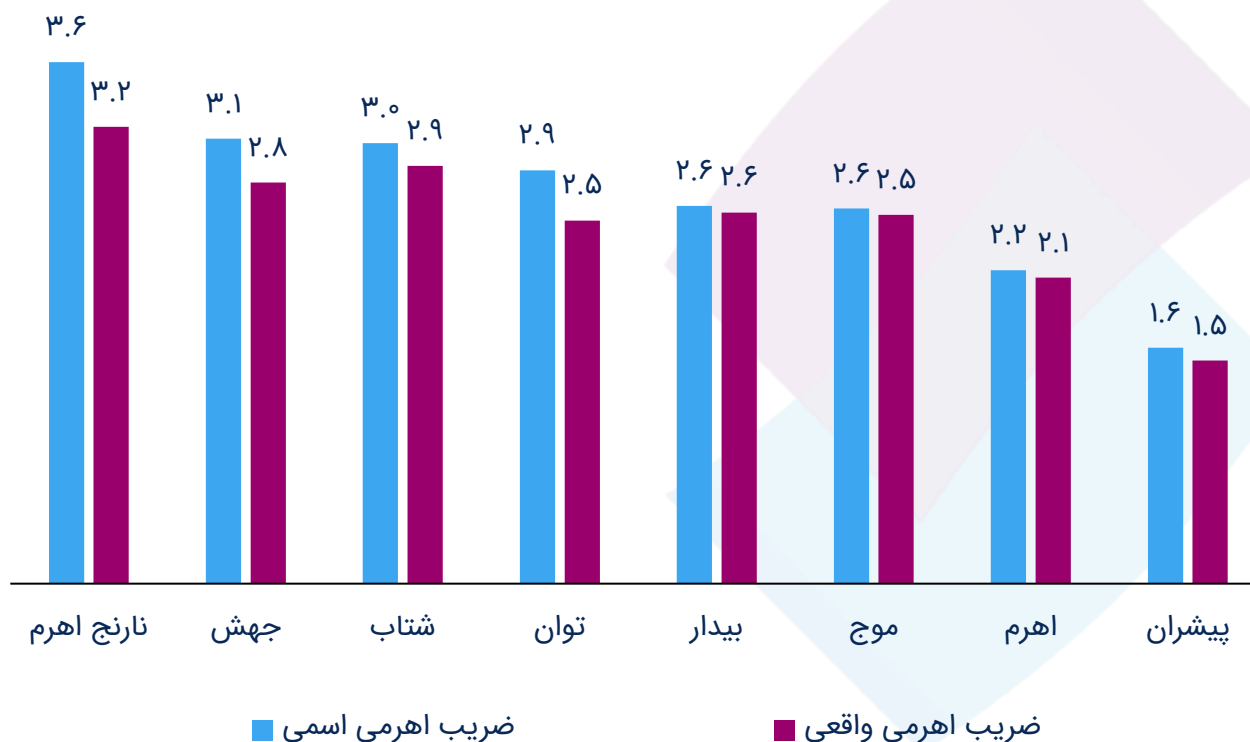


صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
اهرم	-۵.۶%	۱.۷
جهش	-۴.۶%	۱.۸
موج	-۴.۱%	۱.۷
بیدار	-۳.۷%	۱.۸
شتاب	-۲.۵%	۱.۹
نارنج اهرم	-۱.۶%	۱.۷
توان	-۱.۵%	۱.۸
پیشران	۰.۱%	-

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
پیشران	-۱۵.۲%	۲.۴۱%
موج	-۲۰.۹%	۲.۵۰%
اهرم	-۲۱.۰%	۲.۵۱%
توان	-۲۱.۳%	۲.۵۱%
شتاب	-۲۱.۴%	۲.۵۱%
جهش	-۲۱.۷%	۲.۵۱%
بیدار	-۲۲.۰%	۲.۵۰%
نارنج اهرم	-۲۲.۷%	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

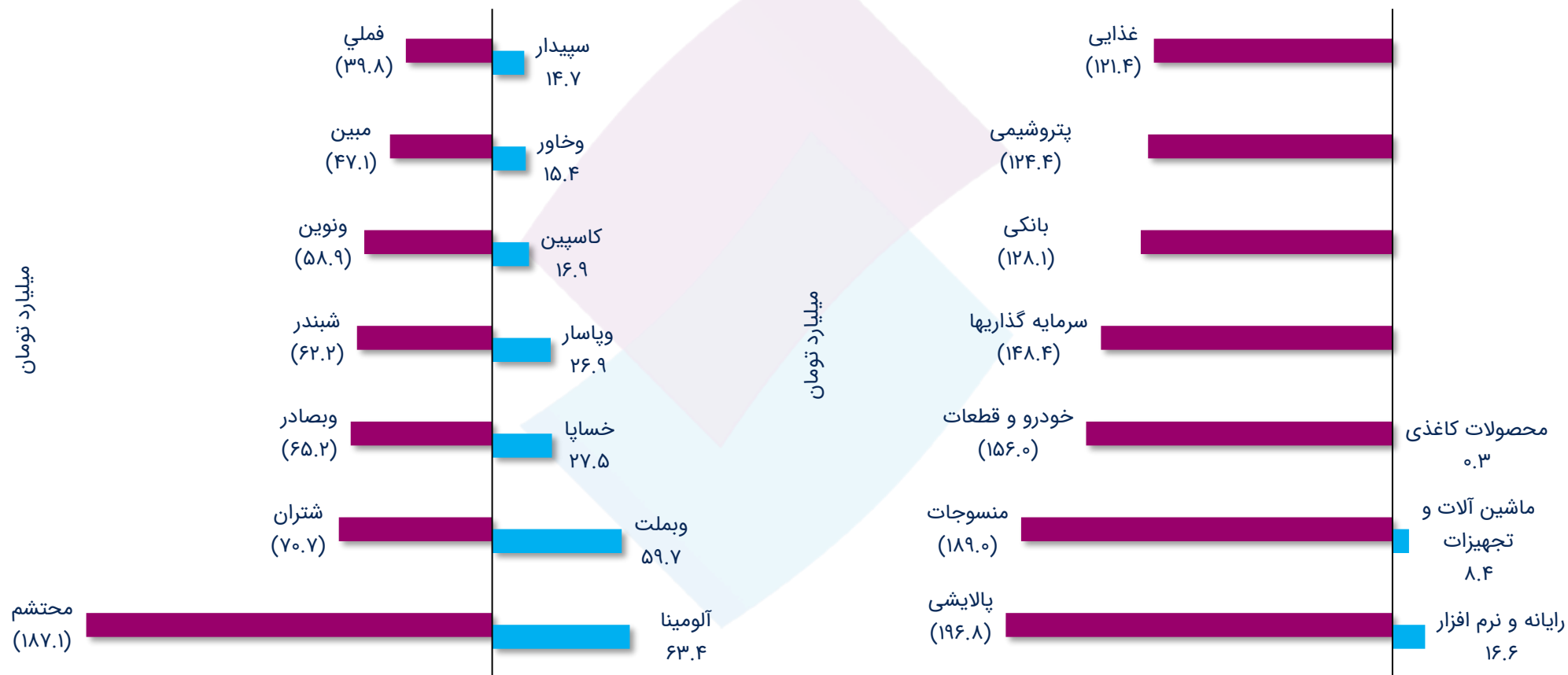
ضریب اهرمی واقعی = (خالص ارزش دارایی‌های صندوق - سپرده بانکی، اوراق و وجه نقد) / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

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

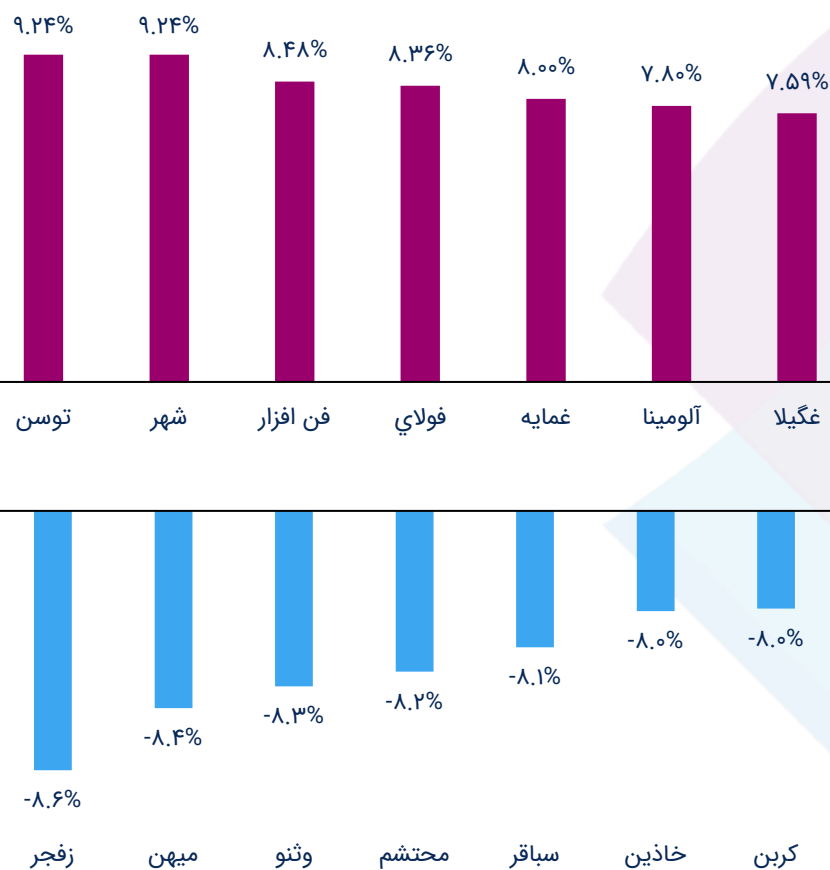
بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

صنعت

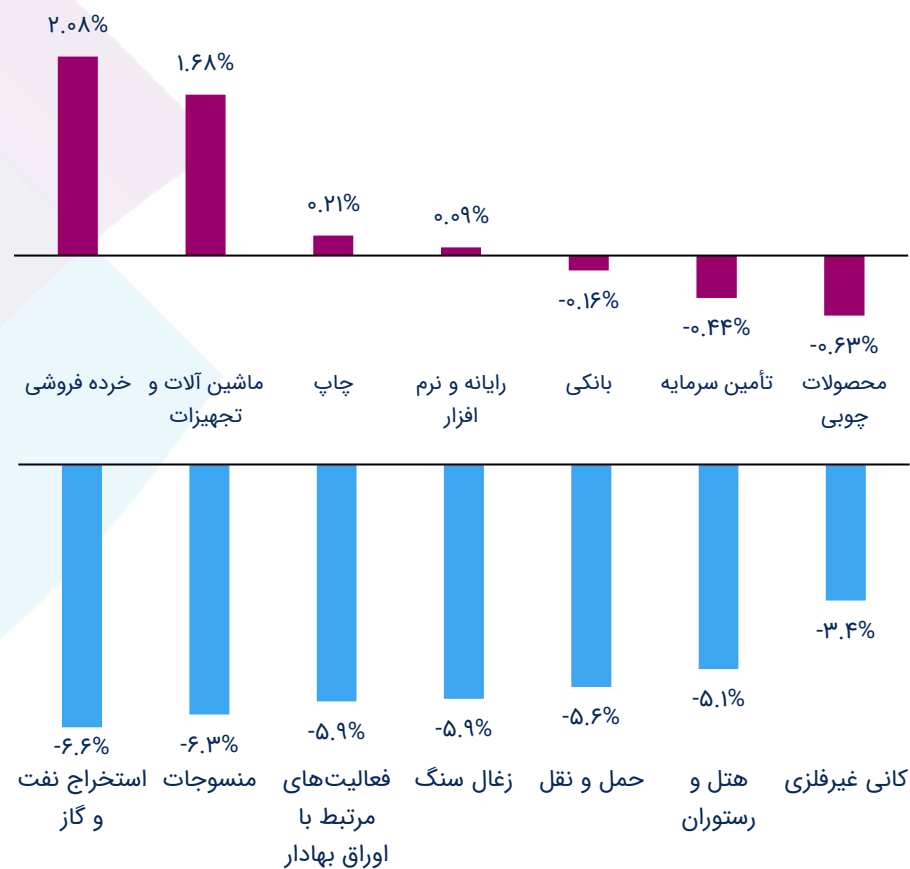
نماد



نماد

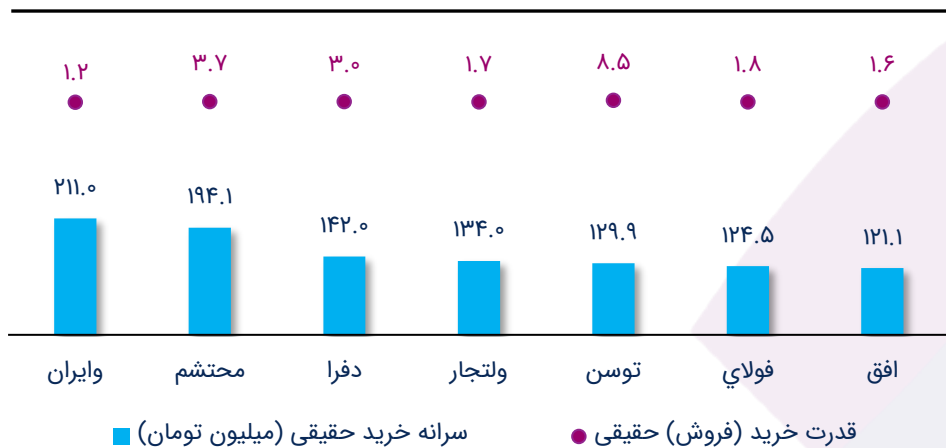


صنعت

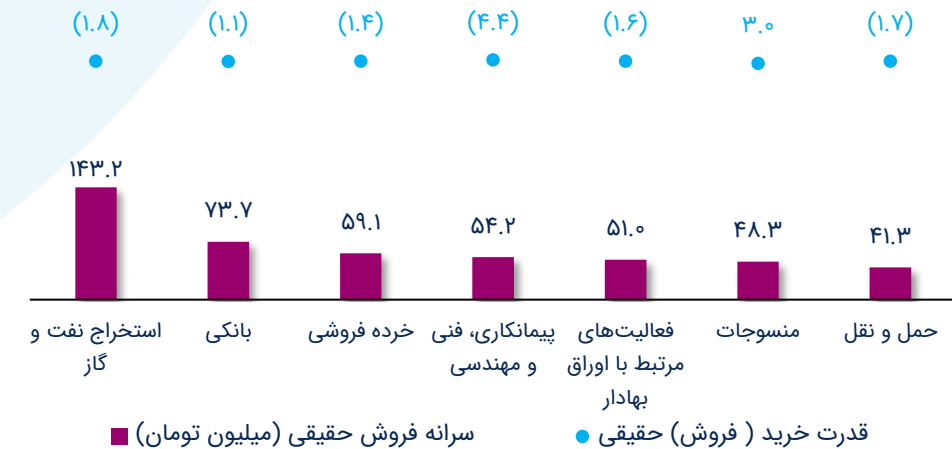
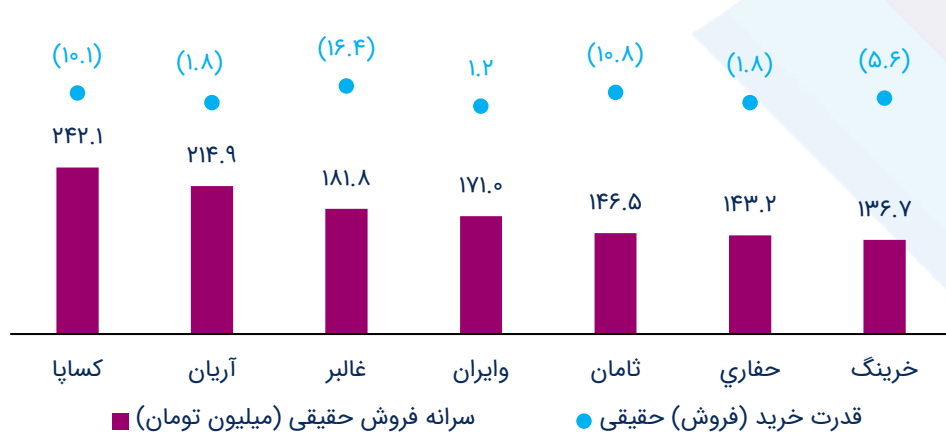
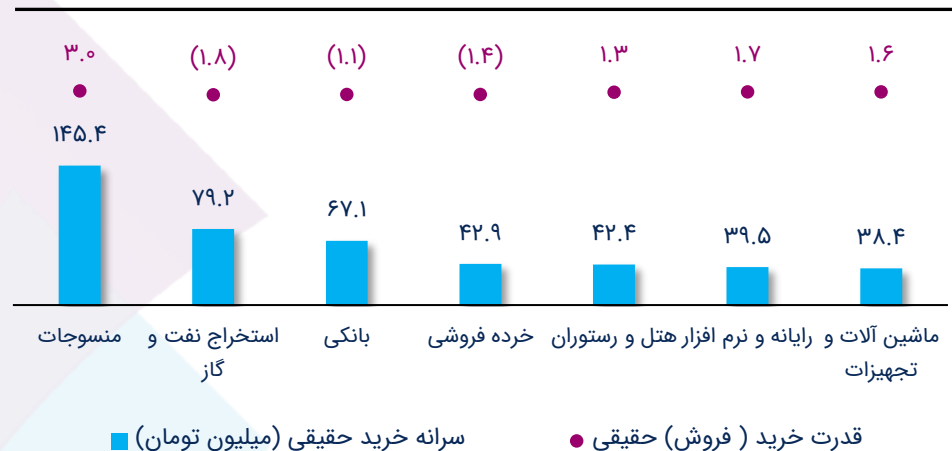


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد



صنعت



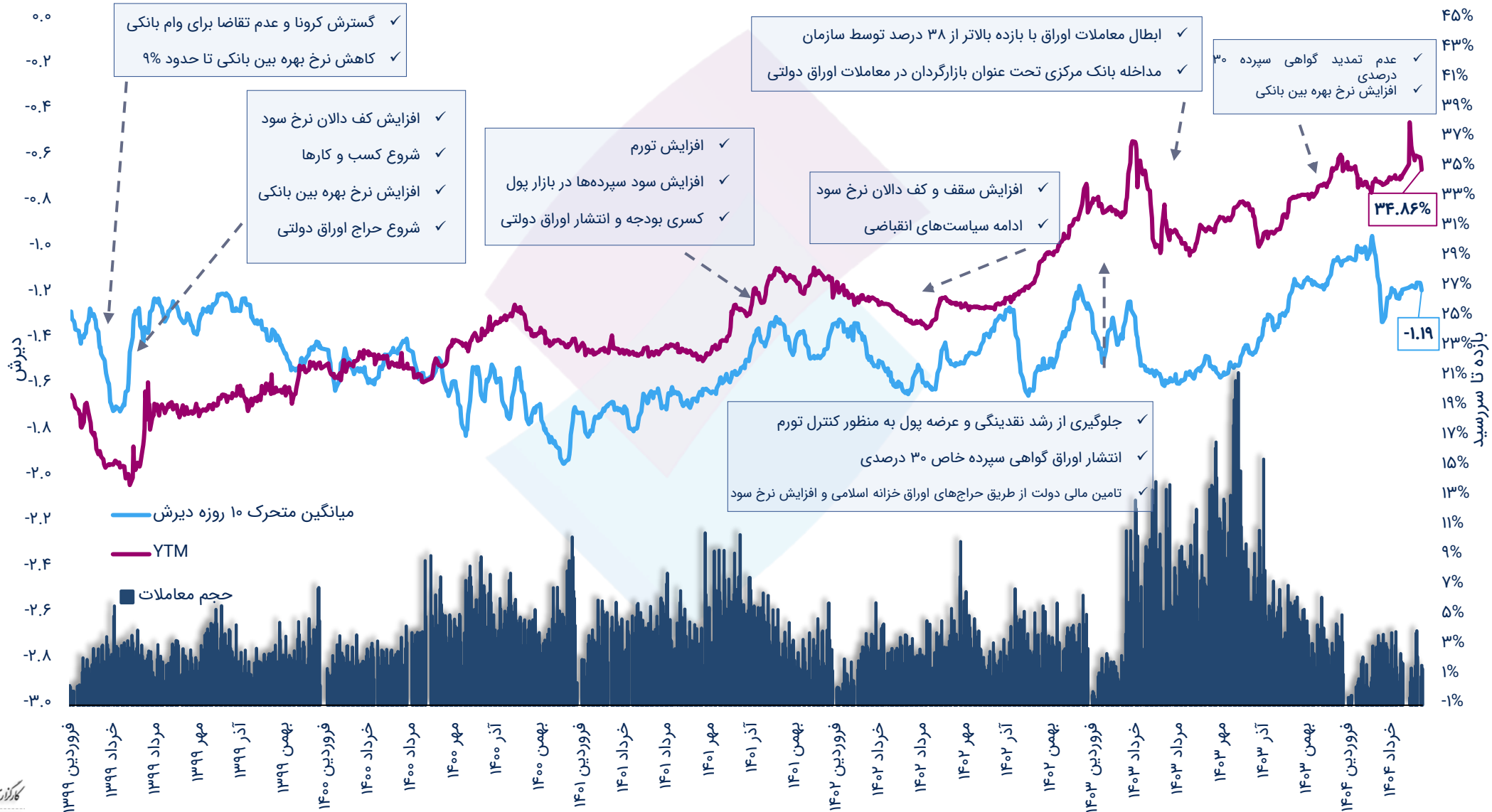
گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه					
قرن	۱,۰۰۰	۱,۷۵۰	۷۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج نقدینگی بابت تامین سرمایه در گردش مورد نیاز شرکت
غمهرا	۳۲۰	۵۰۰	۵۶%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی با حفظ و بهبود سرمایه در گردش
رانفور	۳,۶۰۰	۶,۰۰۰	۶۷%	آورده نقدی	بهبود و افزایش ظرفیت پردازشی و فنی زیرساخت های سرویس ها
مهر	۳۰۰	۷۰۰	۱۳۳%	آورده نقدی سود انباشته	لوگیری از کاهش سودآوری و اندازه سبد سرمایه گذاری شرکت، تداوم در بهینه سازی سبد سرمایه گذاری شرکت و انجام سرمایه گذاری های جدید
ثپهران	۱,۰۰۰	۱,۵۰۰	۵۰%	آورده نقدی	افزایش سرمایه
شپاکسا	۱,۲۳۰	۱,۷۸۰	۴۵%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی
فروی	۳۶۰	۴۶۱	۲۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی و استفاده از معافیت مالیاتی قانون تامین مالی پایدار و زیرساخت ها
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه					
فرآور	۶۶	۵۰۰	۶۵۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، حفظ سرمایه در گردش و استفاده از معافیت مالیاتی موضوع بند (ث) ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیرساختها

گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

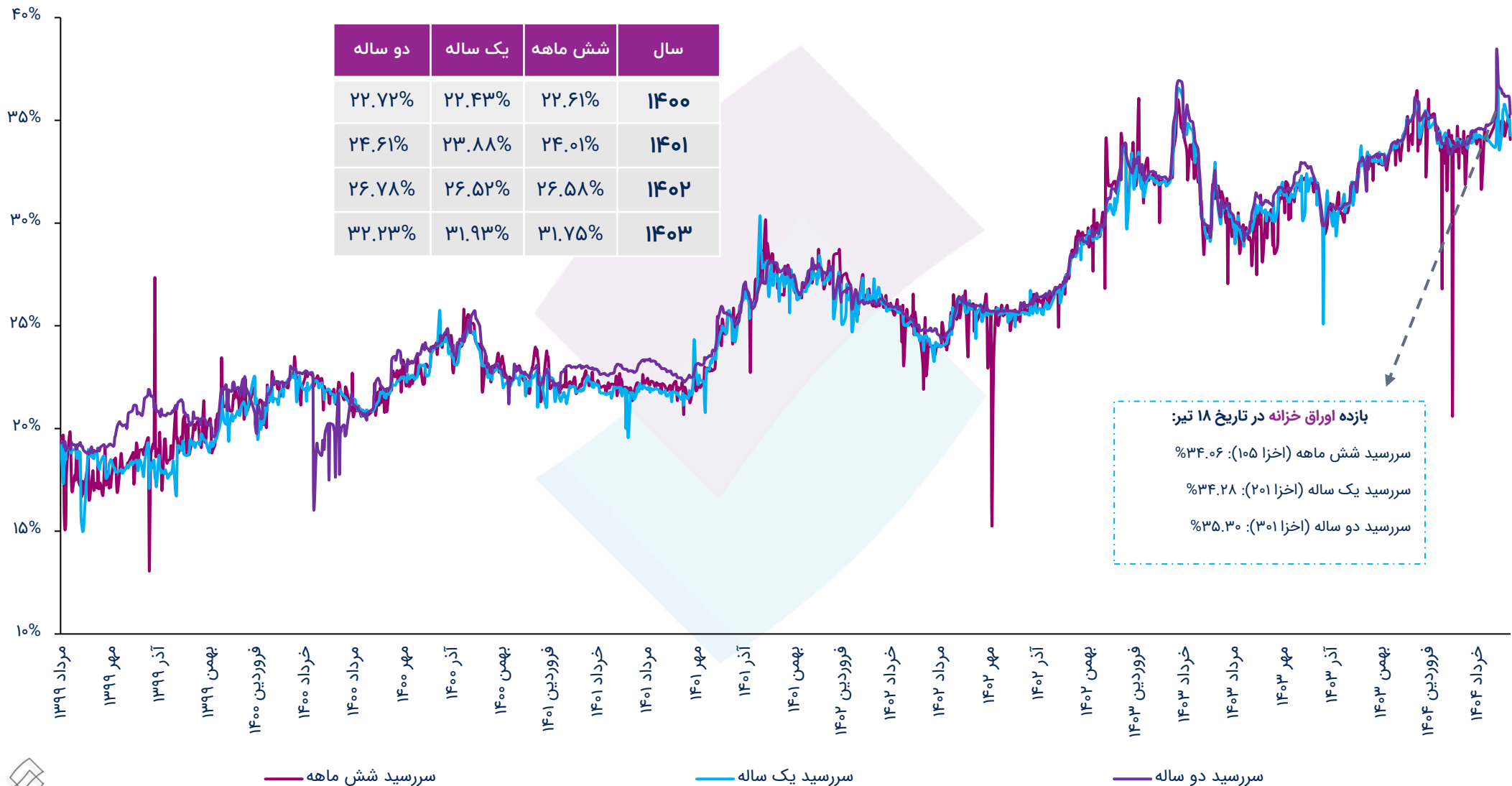
نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید (میلیارد تومان)	تغییرات (درصد)	محل افزایش سرمایه	موضوع افزایش سرمایه
مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام					
والبر	۲,۶۱۴	۳,۱۰۰	۱۹%	آورده نقدی	اصلاح ساختار مالی، جبران مخارج سرمایه گذاریهای انجام شده و مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر مهلت استفاده از حق تقدم از تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۱۸ تا تاریخ ۱۴۰۴/۰۵/۱۶ است.
آگهی ثبت افزایش سرمایه					
حزور	۳۶۰	۱,۲۶۰	۲۵۰%	آورده نقدی	تامین مالی بخشی از پروژه ساخت یک فروند شناور و جبران مخارج گذشته بابت سرمایه گذاری در شرکت فرعی
فراور	۶۶	۵۰۰	۶۵۸%	سود انباشته	اصلاح ساختار مالی، حفظ سرمایه در گردش و استفاده از معافیت مالیاتی موضوع بند (ث) ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیرساختها

کاهش ۰.۹۱ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۴.۸۶ درصد

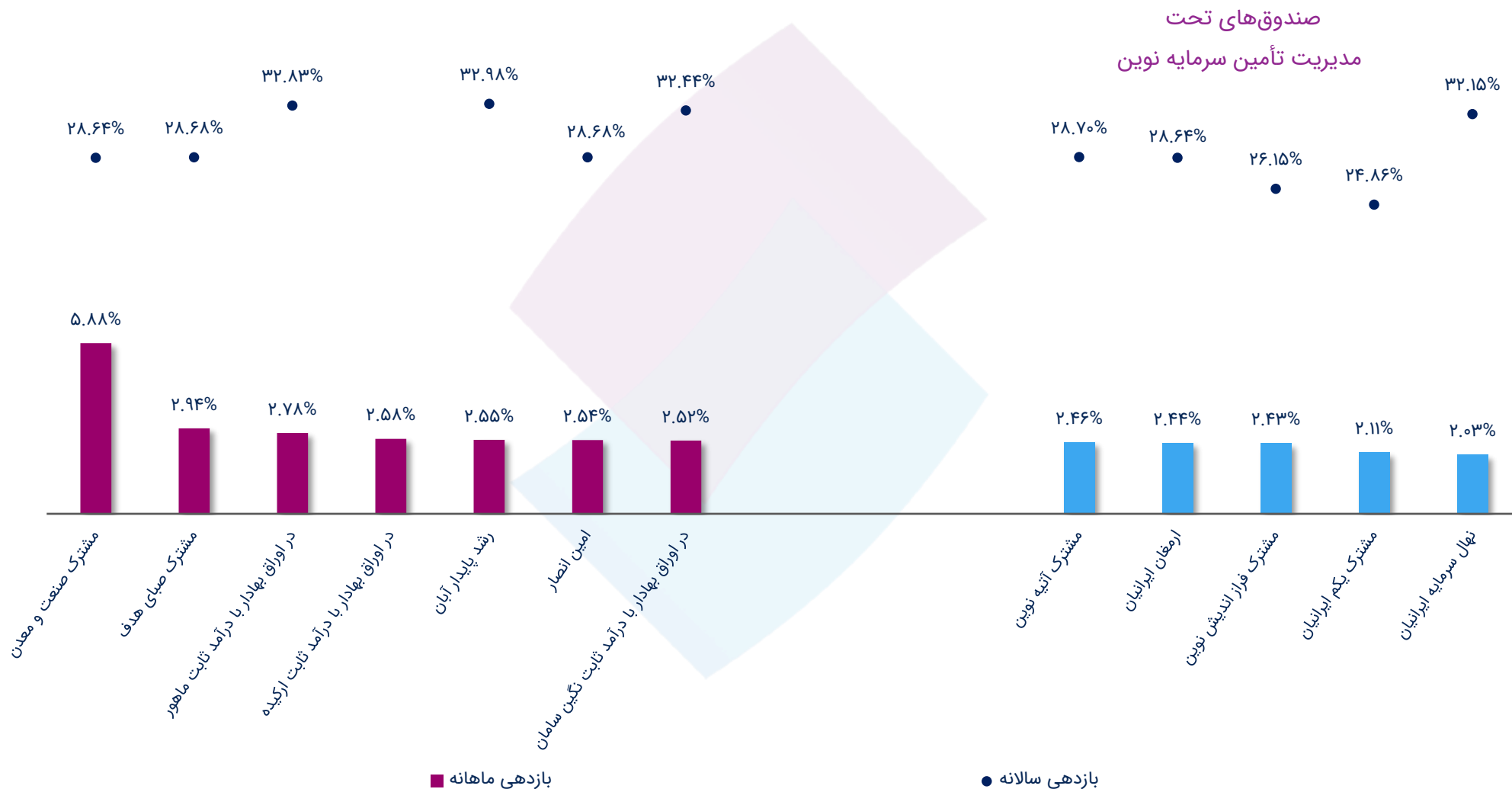


بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

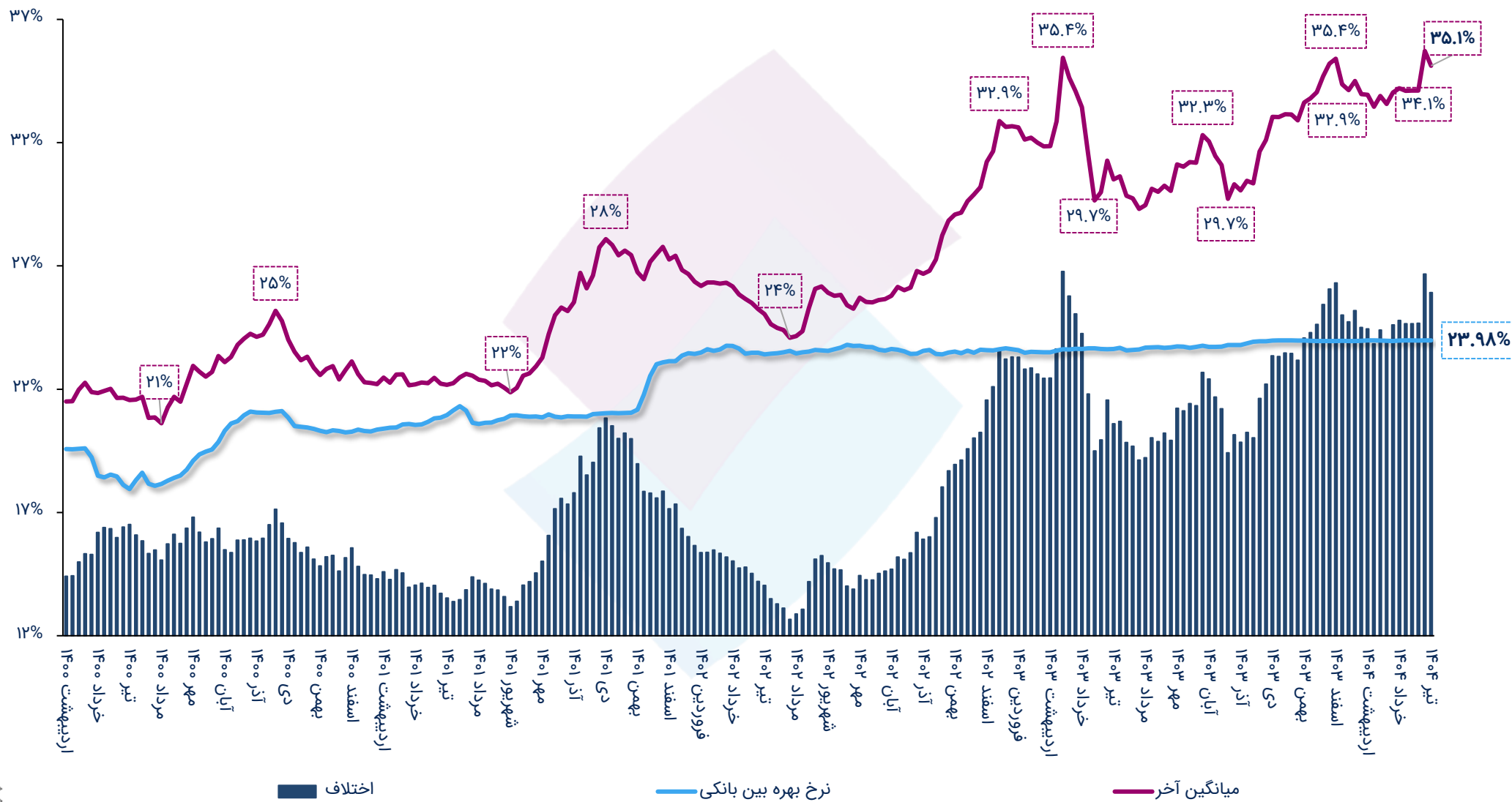
سال	شش ماهه	یک ساله	دو ساله
۱۴۰۰	۲۲.۶۱%	۲۲.۴۳%	۲۲.۷۲%
۱۴۰۱	۲۴.۰۱%	۲۳.۸۸%	۲۴.۶۱%
۱۴۰۲	۲۶.۵۸%	۲۶.۵۲%	۲۶.۷۸%
۱۴۰۳	۳۱.۷۵%	۳۱.۹۳%	۳۲.۲۳%



صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



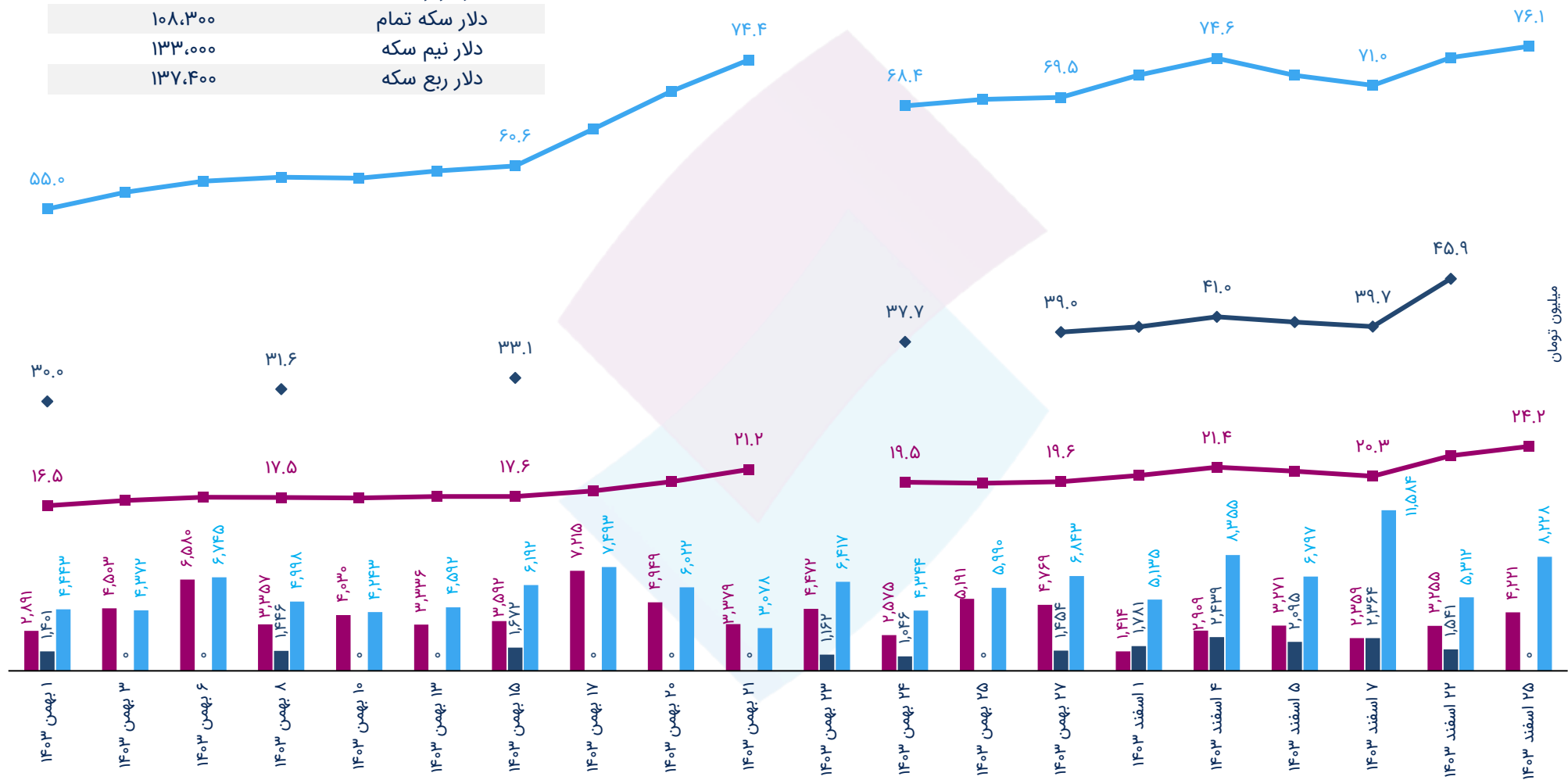
ثبات نرخ بهره بین بانکی در رقم ۲۳.۹۸ درصد و اجرای چهارمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به مبلغ ۹۶۰ میلیارد تومان



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



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

در حراج ۲۳ بهمن قیمت‌ها اطلاع رسانی نشده‌اند.

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

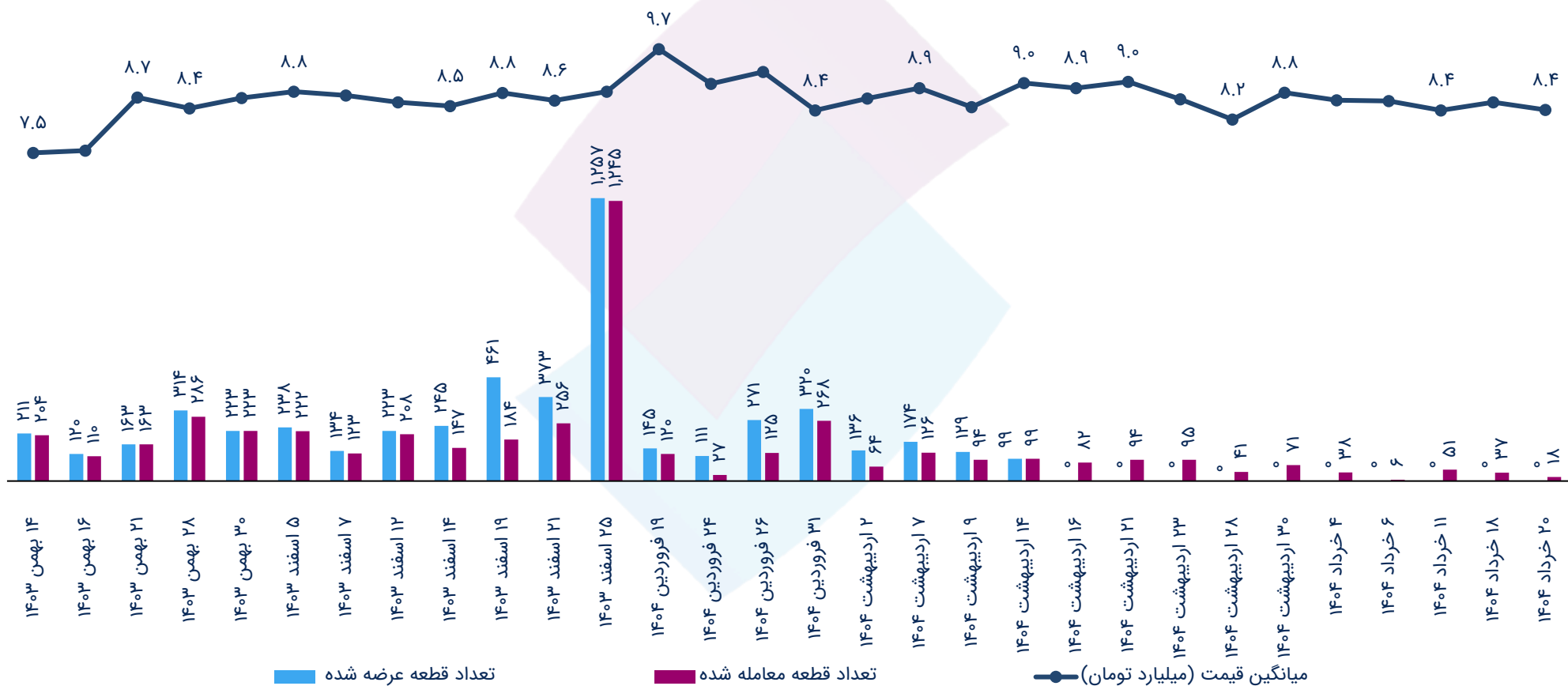
آخرین نرخ
مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج

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.

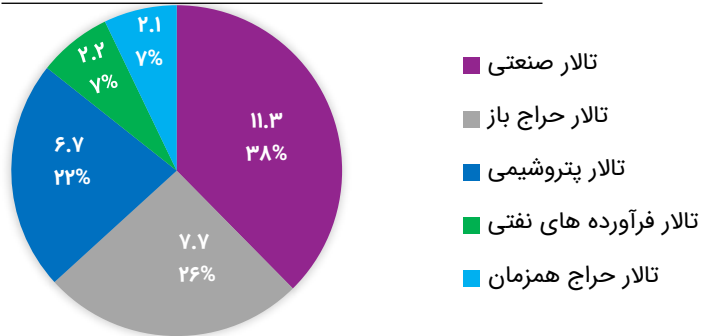
در روزهای حراجی که تعداد قطعه عرضه شده برابر با صفر است، در اطلاعیه مربوطه تعداد آن مشخص نگردیده.

آخرین قیمت‌های بازار در یک نگاه

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۹.۲%	۲,۳۶۴	-۱.۱%	۳,۳۲۷	-۲.۰%	۳,۳۵۸	۳,۲۹۱	طلا (دلار/انس)
۹۲.۸%	۳۹۹,۴۵۰	۴.۹%	۷۳۴,۱۰۰	-۷.۲%	۸۲۹,۹۵۰	۷۷۰,۰۵۰	سکه (هزار ریال)
۵۴.۰%	۴۶۴,۵۹۹	۰.۵%	۷۱۱,۷۴۶	۰.۴%	۷۱۲,۲۷۲	۷۱۵,۳۶۹	دلار اسکنا (ریال)
۶۰.۴%	۴۳۳,۷۹۹	۰.۵%	۶۹۲,۳۶۰	۰.۴%	۶۹۲,۸۷۲	۶۹۵,۸۸۴	دلار حواله (ریال)
-۱۷.۴%	۸۵	۴.۸%	۶۷	۱.۷%	۶۹	۷۰	نفت برنت (دلار/بشکه)
۸۷.۹%	۵۸,۰۰۹	-۱.۲%	۱۱۰,۲۹۴	۰.۱%	۱۰۸,۸۵۹	۱۰۸,۹۷۹	بیت کوین (دلار)
۱.۷%	۹,۷۶۲	۰.۸%	۹,۸۴۸	-۱.۲%	۱۰,۰۴۰	۹,۹۲۵	مس LME (دلار/تن)
-۶.۰%	۲,۸۷۲	۳.۲%	۲,۶۱۵	-۰.۴%	۲,۷۱۰	۲,۶۹۸	روی LME (دلار/تن)
-۱۲.۹%	۴۹۸	-۰.۹%	۴۳۸	۰.۰%	۴۳۴	۴۳۴	بیلت CIS (دلار/تن)
۰.۷%	۴۲۰	۰.۷%	۴۲۰	-۱.۲%	۴۲۸	۴۲۳	بیلت ایران (دلار/تن)
۲۹.۸%	۳۲۸	۱۳.۸%	۳۷۵	-۱.۵%	۴۳۳	۴۲۶	سبد اوره (\$/mt)
۳۵.۵%	۲.۴۲	۴.۸%	۳.۱۳	-۶.۳%	۳.۵	۳.۲۸	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

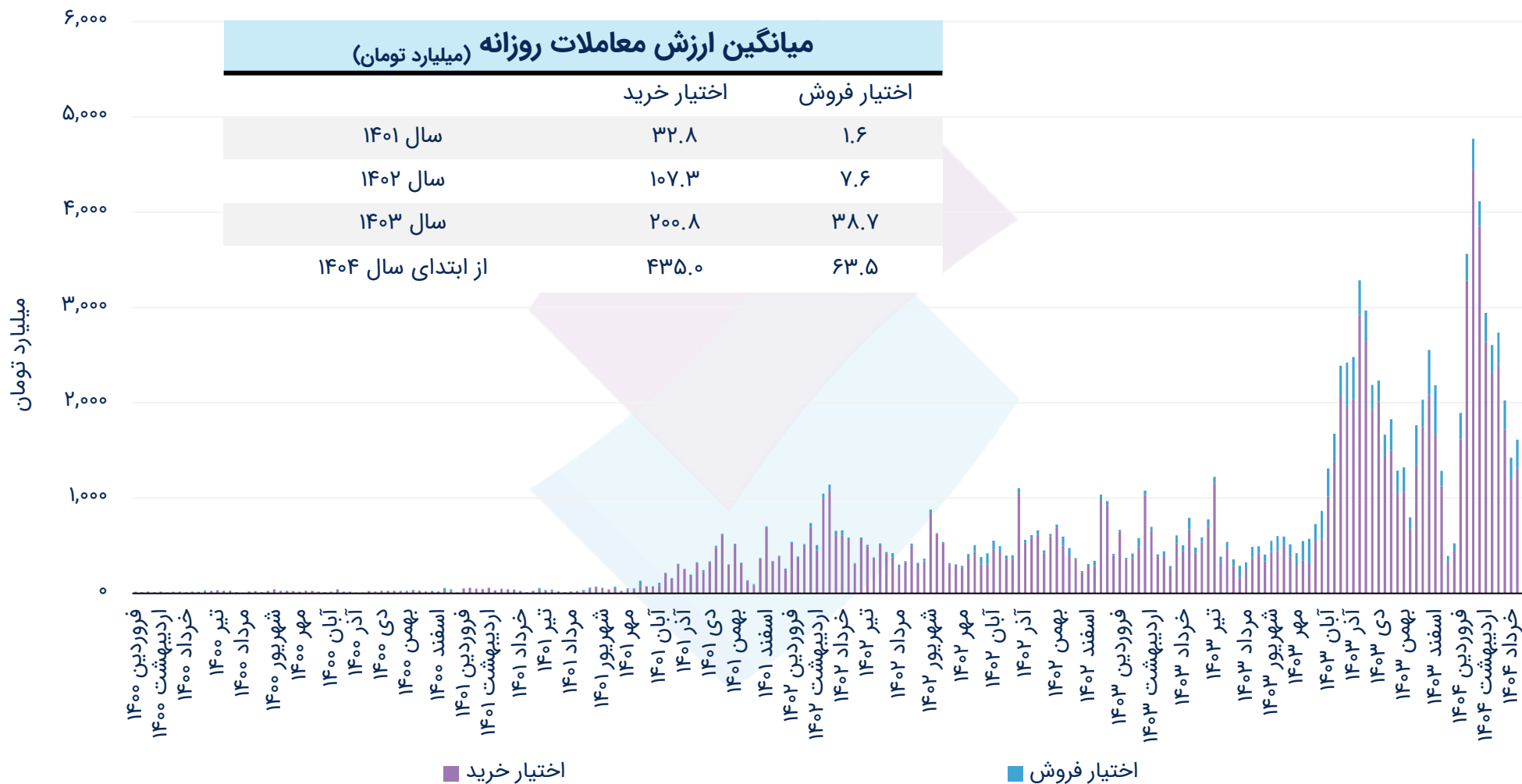


ارزش معاملات تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

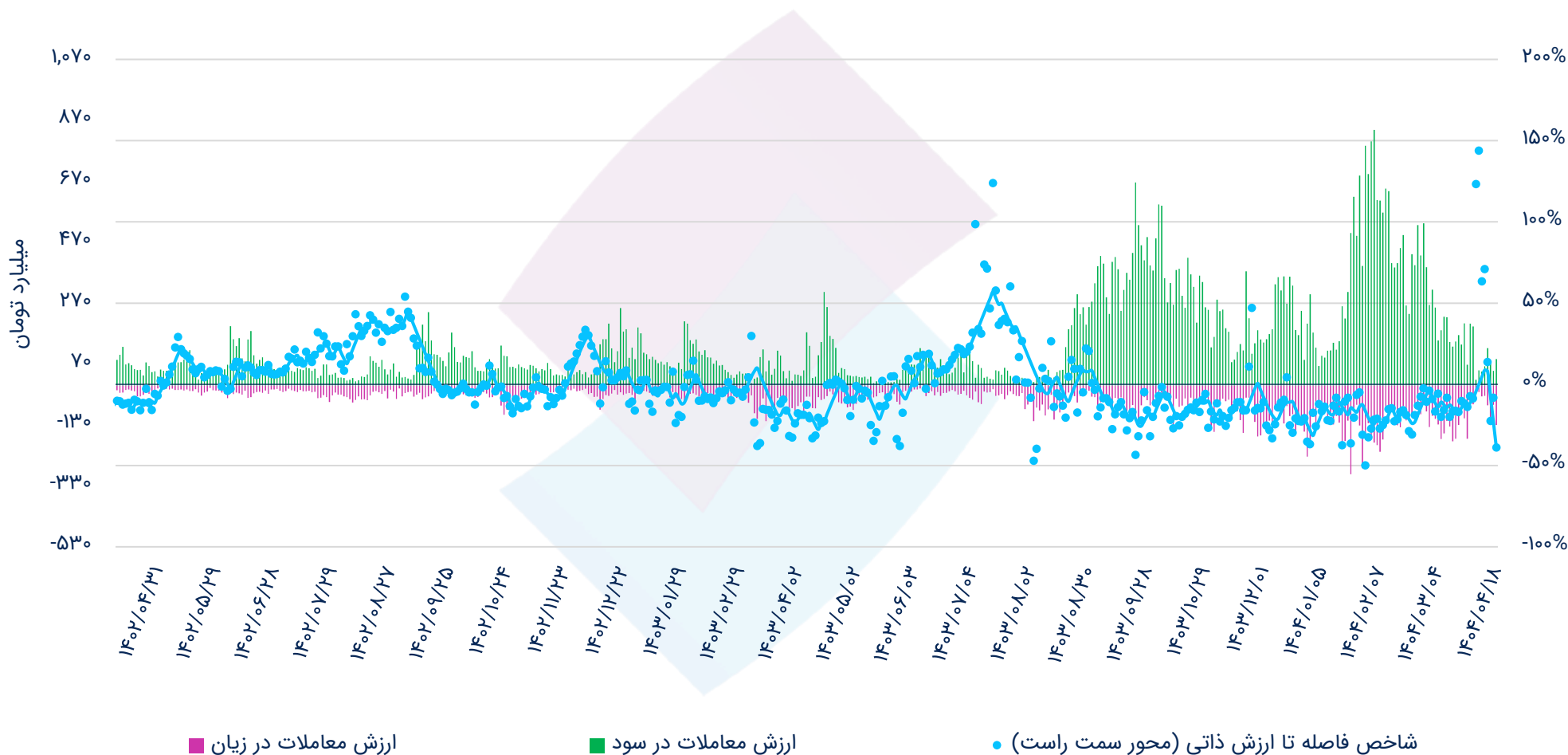
کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
سیمان	۲.۲	۹۶۸,۱۱۴	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، سیمان توسعه ماهان کرمان، سیمان جوبین، سیمان خاش
شمش بلوم	۲۹.۱	۱۵۷,۵۲۵	آهن و فولاد ارفع، جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، گروه صنعتی پارس بوتیل یزد، غلتک سازان سپاهان، فولاد سیرجان ایرانیان، فولاد کویر دامغان، صبا راد محور، مجتمع فولاد البرز ناب آرش، مجتمع فولاد شمش نگین مشهد
وکیوم باتوم	۲۵.۴	۱۳۸,۵۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت شیراز
لوب کات	۲۸.۱	۶۳,۰۰۰	پالایش نفت آبادان، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)
آهن اسفنجی	۱۵.۵	۴۹,۱۵۰	پارس فولاد سبزواری، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، فولاد غدیر نی ریز، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، صنعت فولاد شادگان، صبا فولاد خلیج فارس، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان
تختال	۲۹.۹	۳۰,۰۰۰	فولاد هرمزگان جنوب
ورق سرد	۳۹.۴	۲۹,۲۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا
میلگرد	۳۵.۲	۲۸,۱۹۹	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، صنایع آهن و فولاد سرمد 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
ورق گالوانیزه	۵۰.۲	۲۶,۶۵۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد مبارکه اصفهان، مجتمع فولادی روی اندودکاوه
تیرآهن	۳۷.۷	۱۵,۶۱۷	ذوب آهن اصفهان
پلی اتیلن سنگین فیلم	۵۷.۰	۱۱,۰۱۵	پتروشیمی آریا ساسول، پتروشیمی ایلام، پتروشیمی بندرامام، پتروشیمی مارون، پتروشیمی مهر، پتروشیمی میاندوآب
پلی اتیلن ترفتالات	۷۵.۴	۱۰,۱۸۶	پتروشیمی تندگویان، پتروشیمی محب پلی استر خاوران، Wankai New Materials Co.,Ltd
پلی پروپیلن نساجی	۷۸.۴	۷,۷۸۴	پتروشیمی پلی نار، پتروشیمی رجا، پتروشیمی مارون، نوید زرشیمی، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)
مس کاتد	۷۱۷.۴	۳,۰۲۰	ملی صنایع مس ایران، تماس
مس مفتول	۷۳۹.۰	۱,۰۹۰	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران

روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

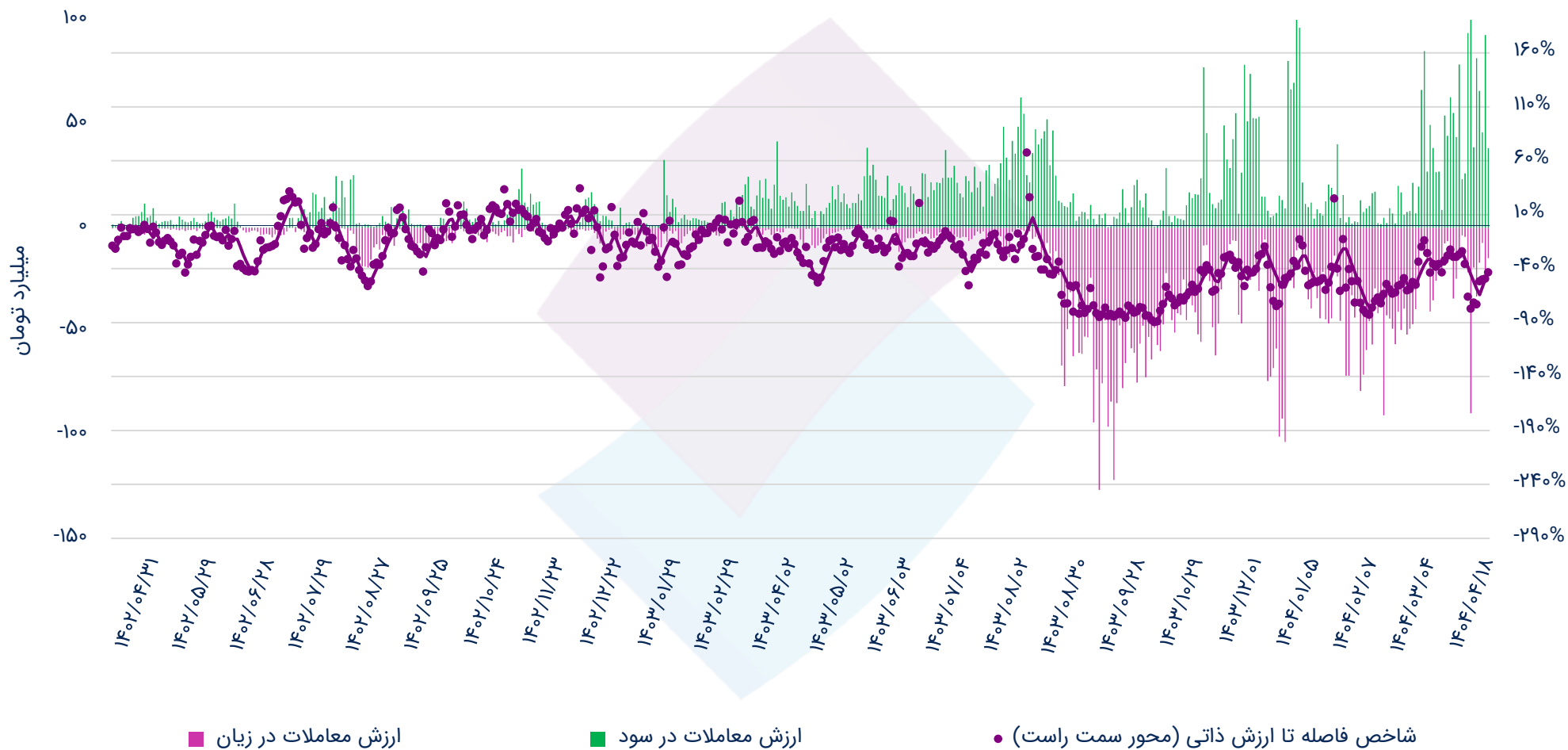


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

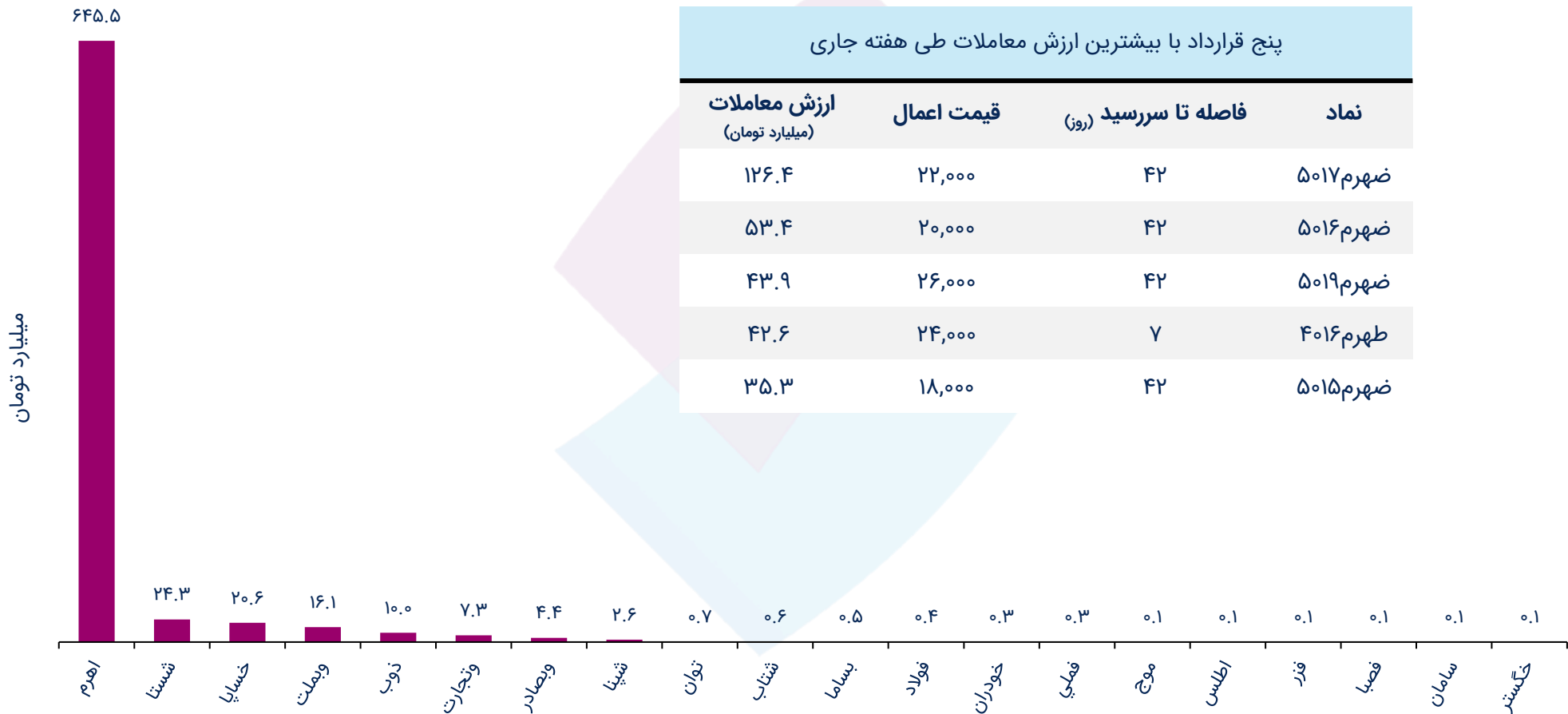
(۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه

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 ۵۰۱۷	۴۲	۲۲,۰۰۰	۱۲۶.۴
ضهرم ۵۰۱۶	۴۲	۲۰,۰۰۰	۵۳.۴
ضهرم ۵۰۱۹	۴۲	۲۶,۰۰۰	۴۳.۹
طهرم ۴۰۱۶	۷	۲۴,۰۰۰	۴۲.۶
ضهرم ۵۰۱۵	۴۲	۱۸,۰۰۰	۳۵.۳

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)