

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 ۹ خرداد - شماره ۱۵۲

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	بیشترین ورود پول حقیقی/حقوقی
۱۳	بیشترین تغییرات قیمت
۱۴	بیشترین سرانه خرید و فروش حقیقی
۱۵	گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه
۱۶	نرخ بهره بدون ریسک
۱۷	اوراق خزانه
۱۸	صندوق‌های با درآمد ثابت
۱۹	نرخ بهره بین بانکی
۲۰	معاملات مرکز مبادله طلا و ارز
۲۲	قیمت‌های جهانی
۲۳	روند ارزش معاملات در بورس کالا
۲۴	بیشترین ارزش معاملات در بورس کالا
۲۵	روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله
۲۶	شاخص فاصله تا ارزش ذاتی
۲۸	بیشترین ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



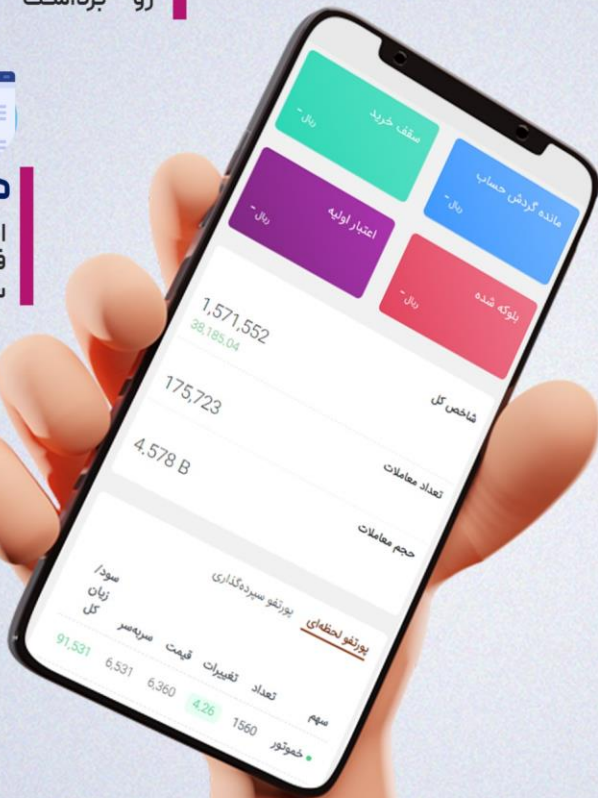
برداشت وجه آئی

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 آئی

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 نیاز های نوین

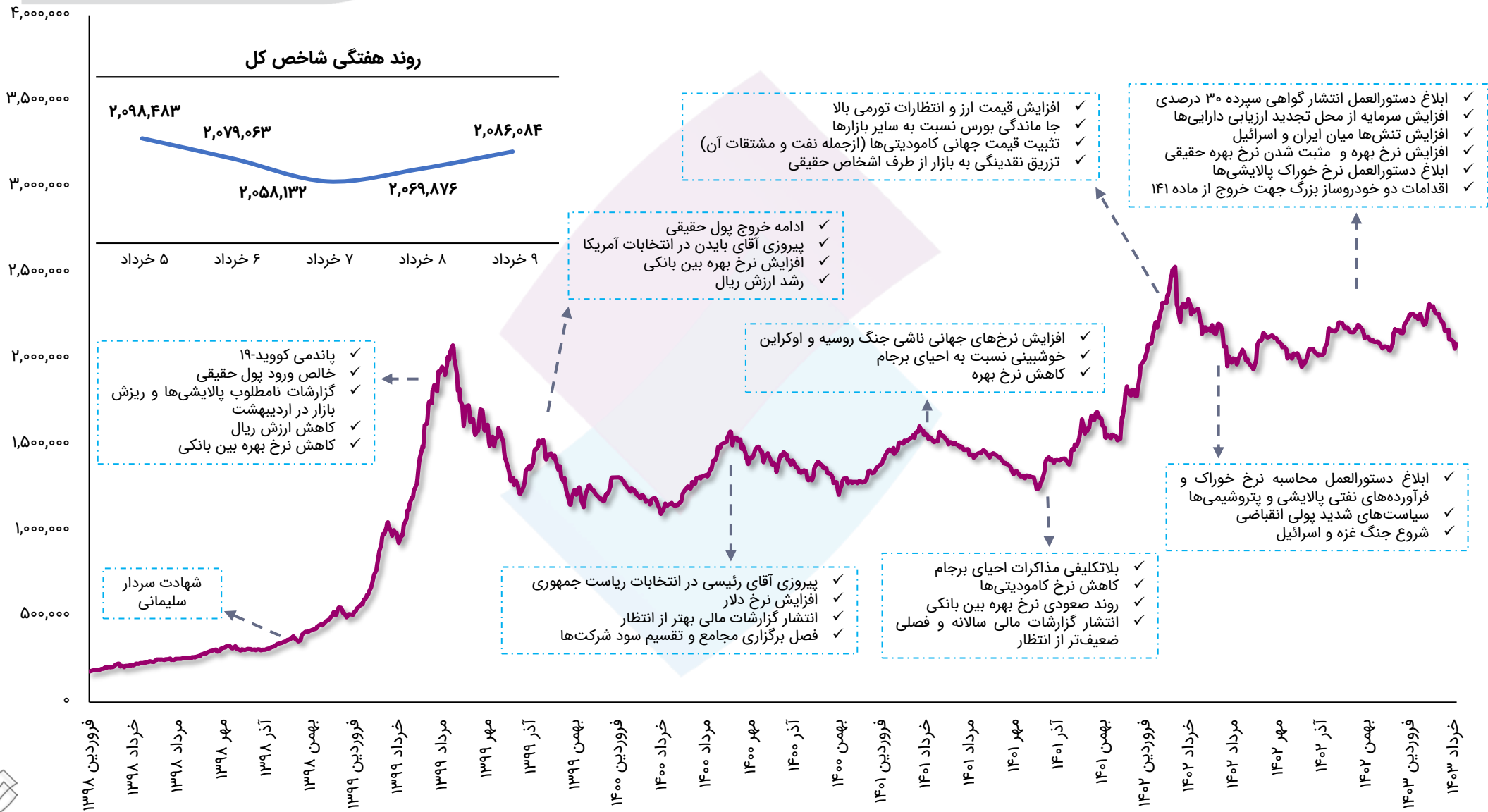
My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

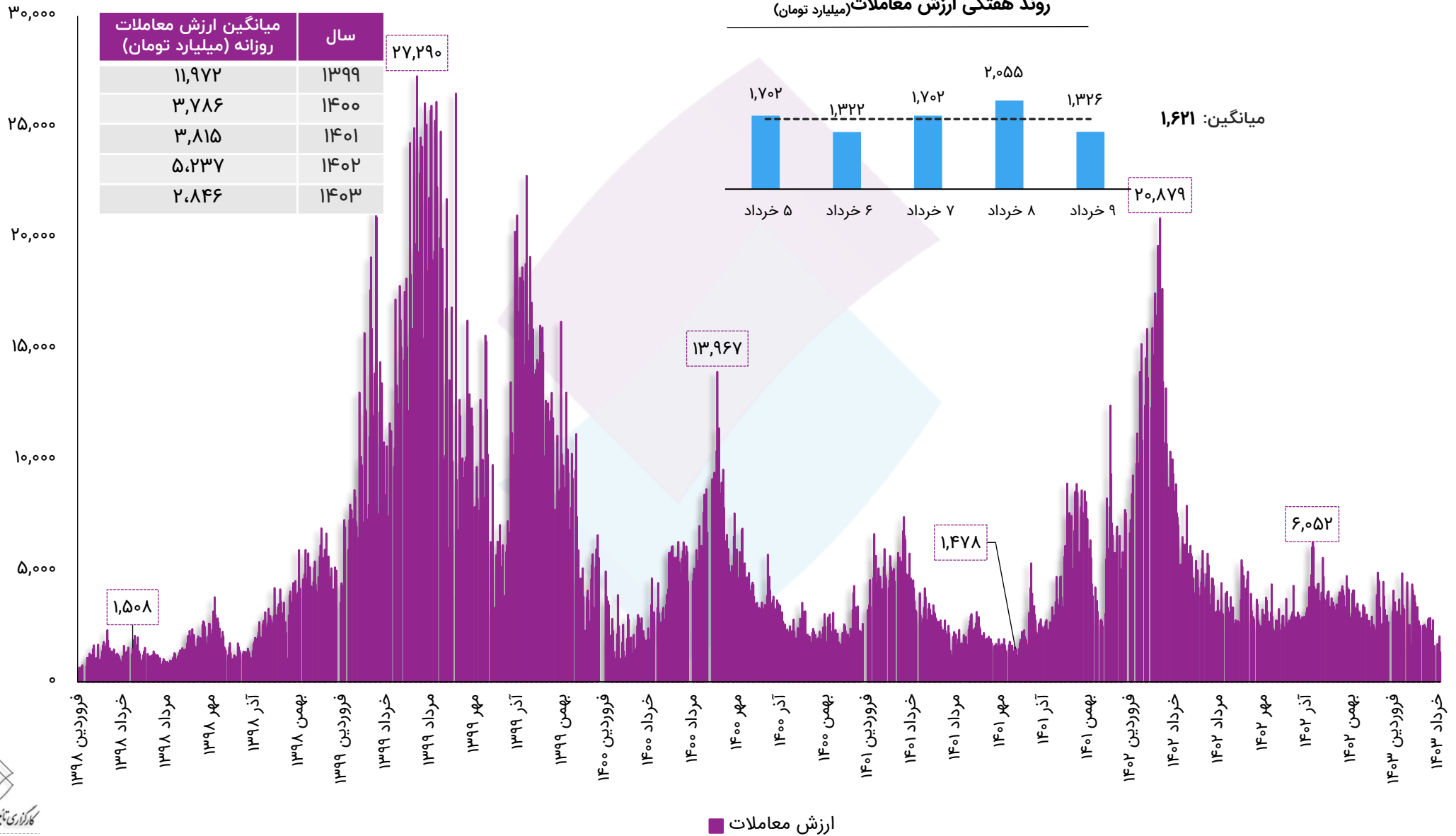


وضعیت بازار سرمایه
در هفته‌ای که گذشت.

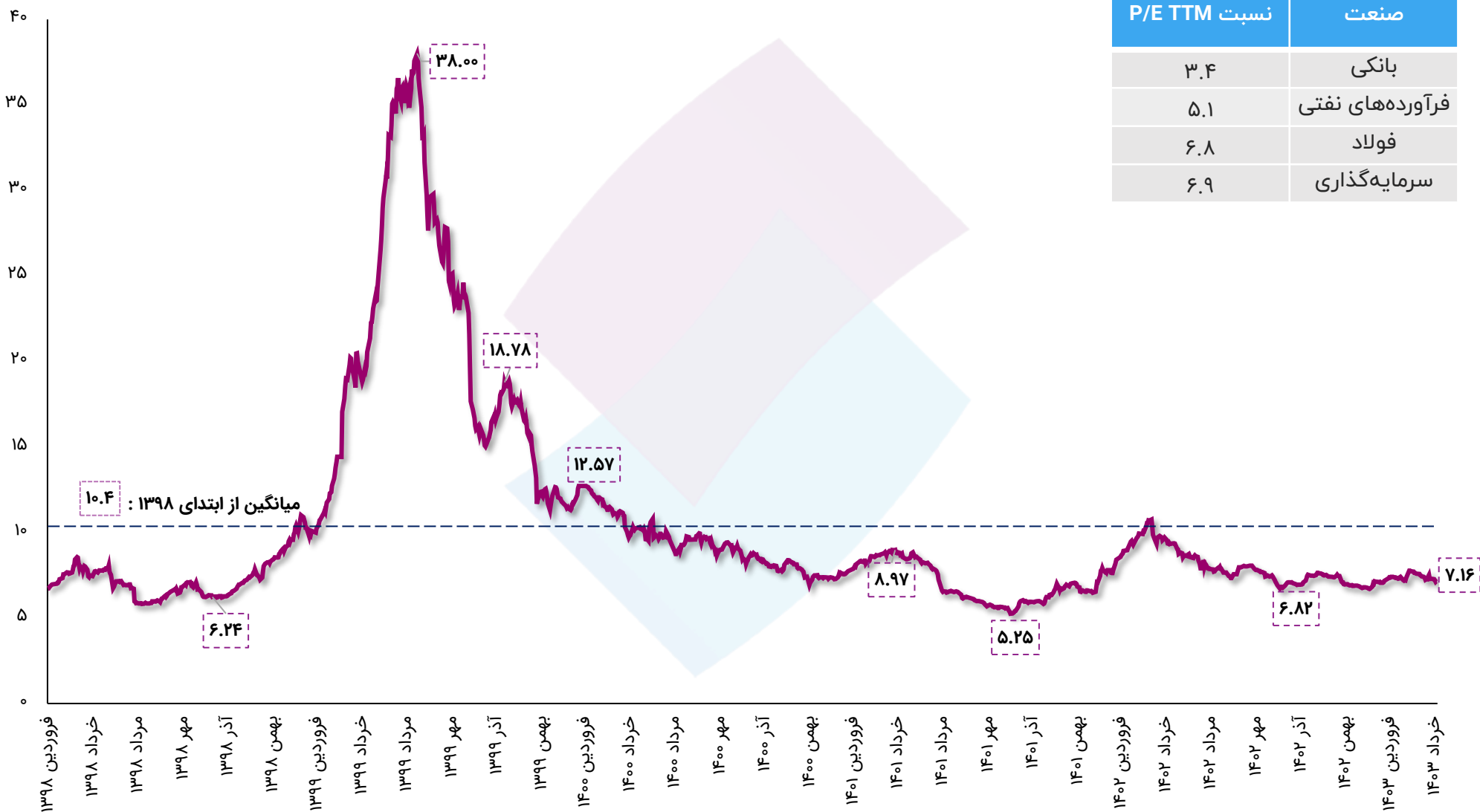
کاهش ۱.۳ درصدی شاخص کل در هفته جاری



ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



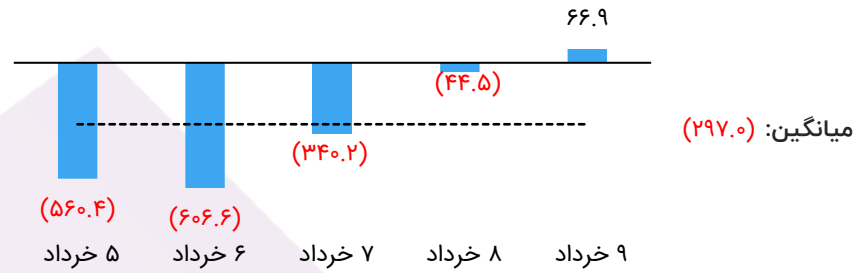
نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۳.۴	بانکی
۵.۱	فرآورده‌های نفتی
۶.۸	فولاد
۶.۹	سرمایه‌گذاری

۱,۴۸۵ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۵۱۶ میلیارد تومانی هفته گذشته

رشد هفتگی ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)



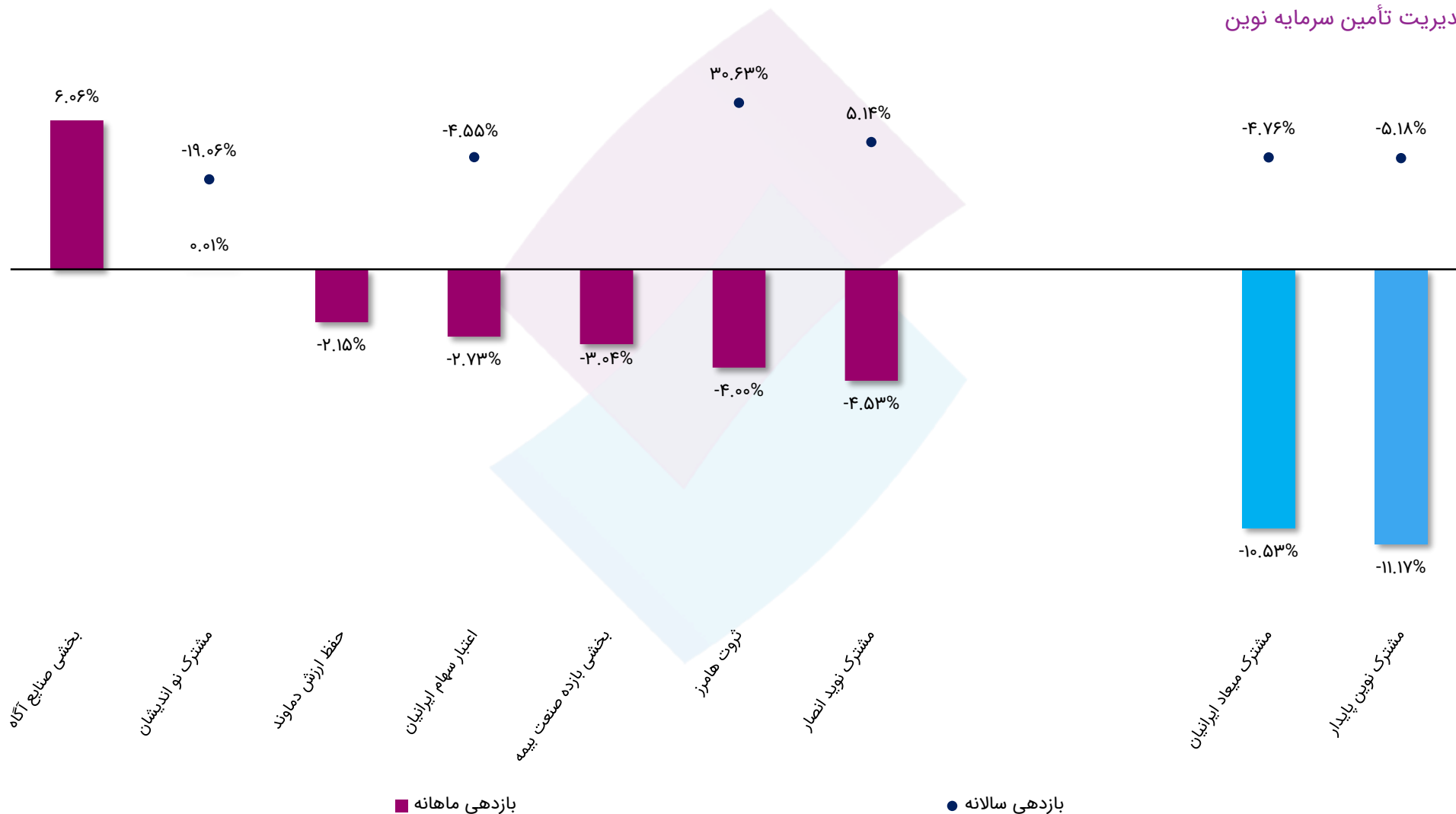
سال	خالص ورود حقیقی (همت)
۱۳۹۹	۲۱.۷
۱۴۰۰	(۵۸.۹)
۱۴۰۱	(۴۲.۸)
۱۴۰۲	(۳۶.۳)
۱۴۰۳	(۸.۰)



خالص ورود و خروج هفتگی

صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

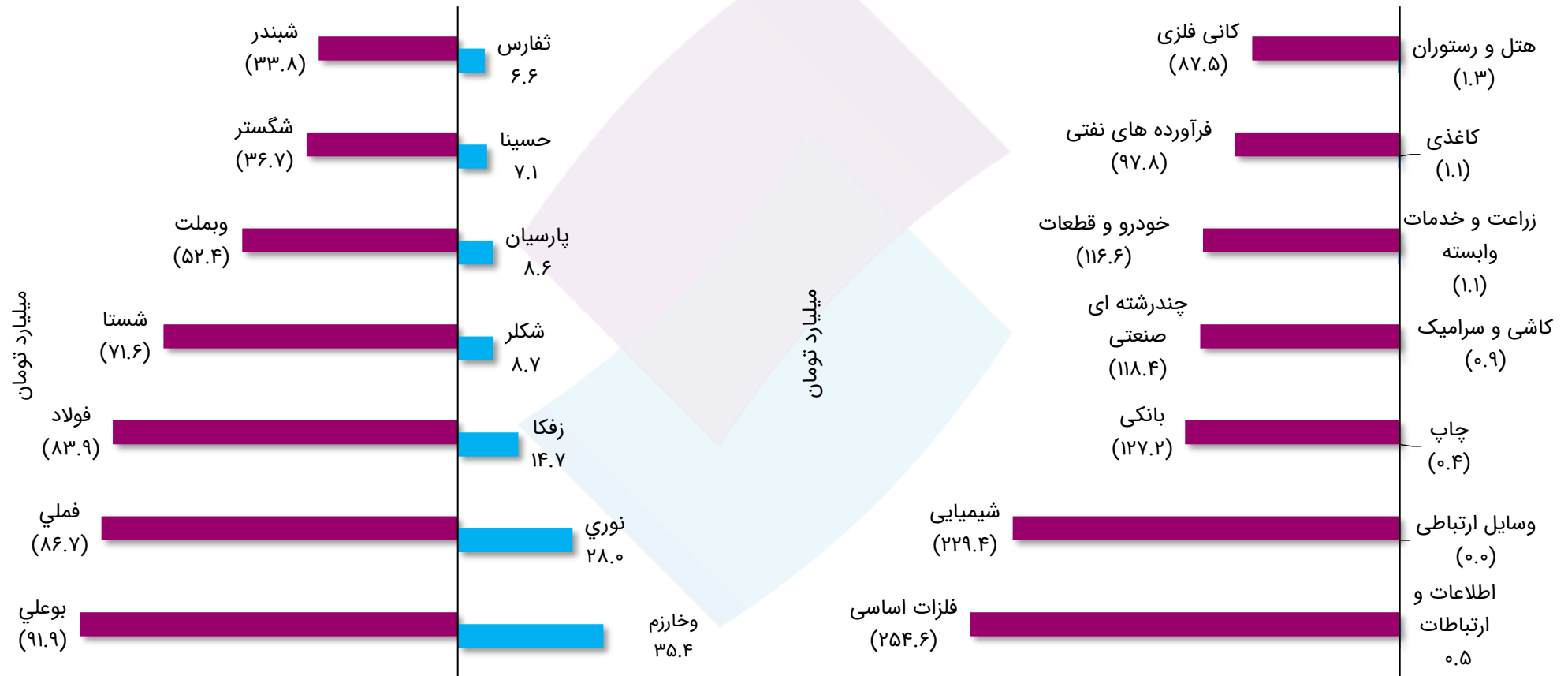
صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

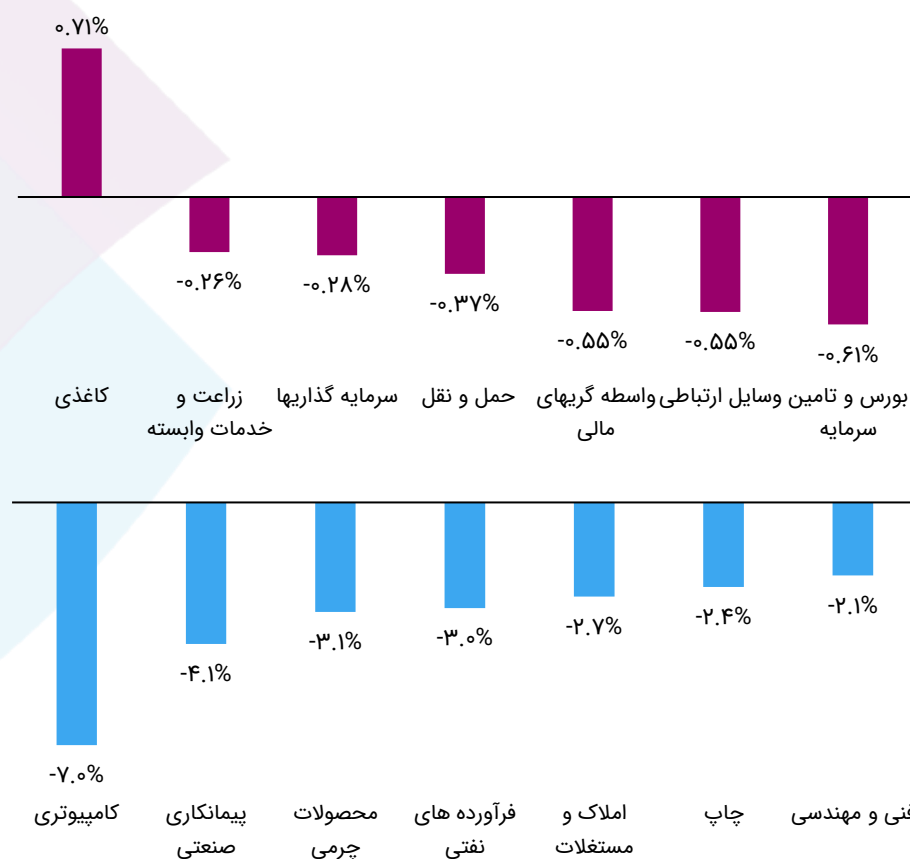
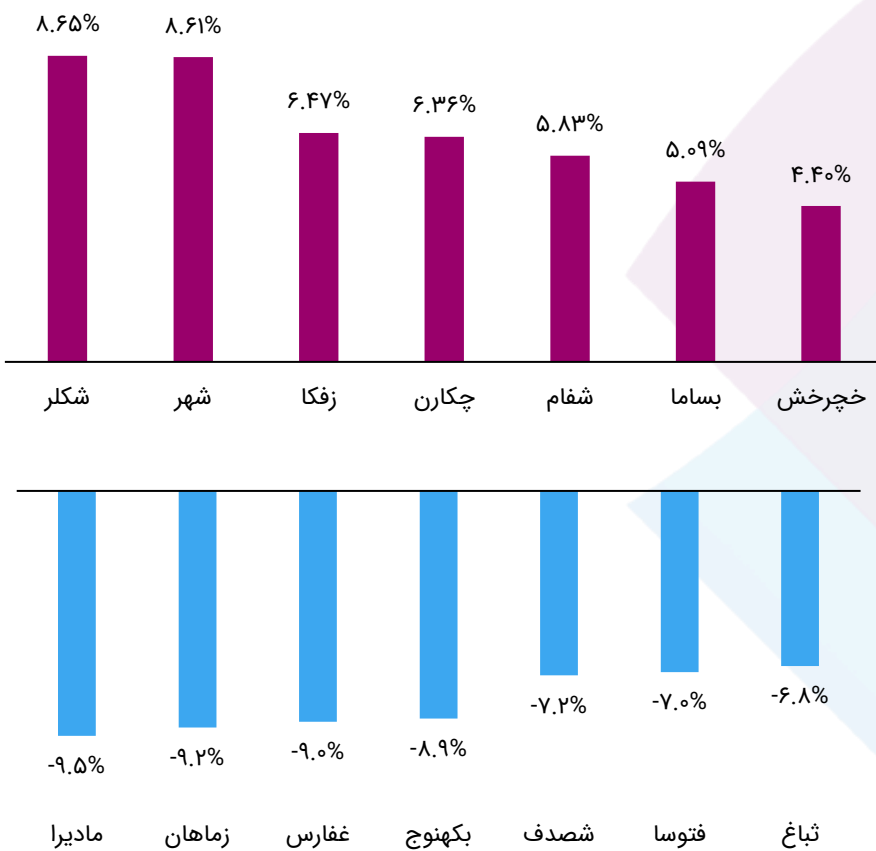
نماد

صنعت



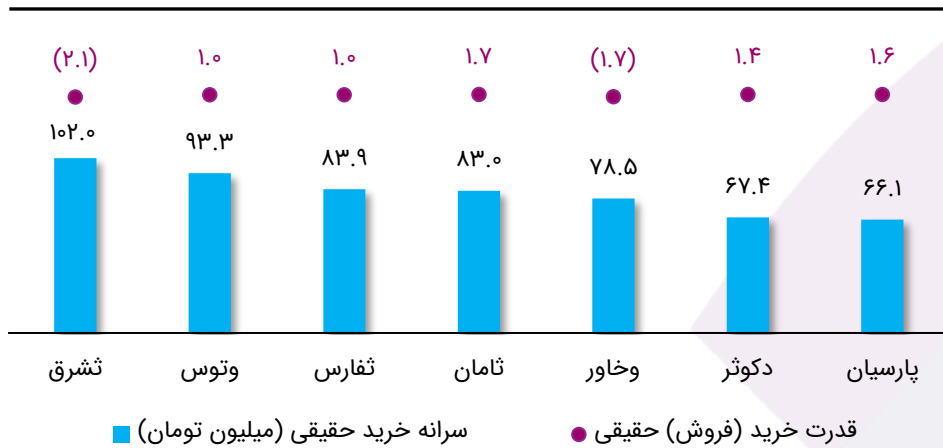
نماد

صنعت

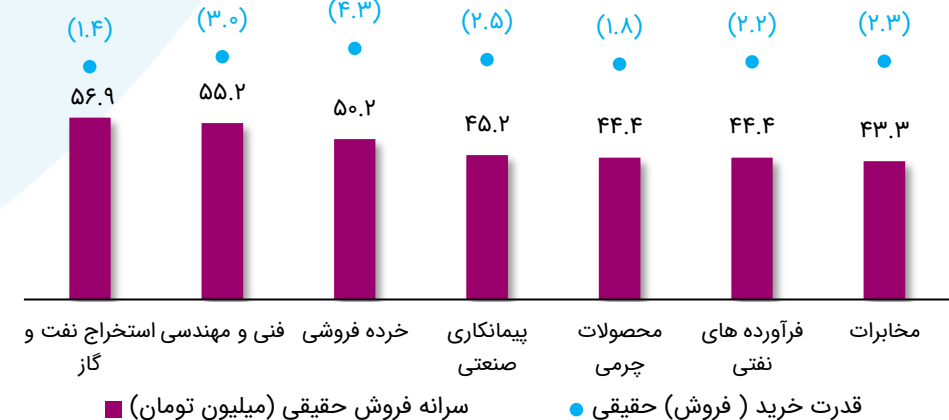
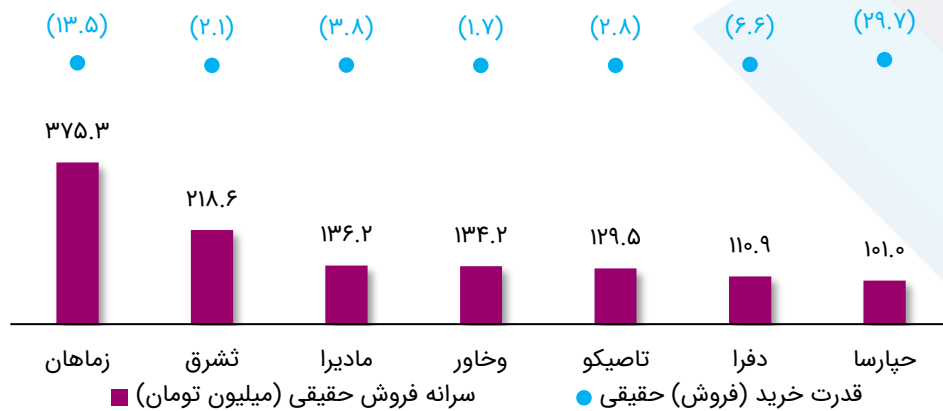
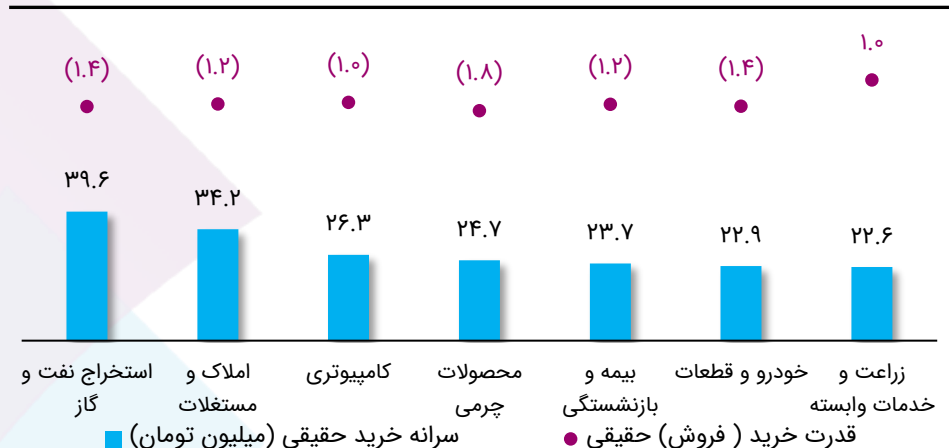


بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

نماد

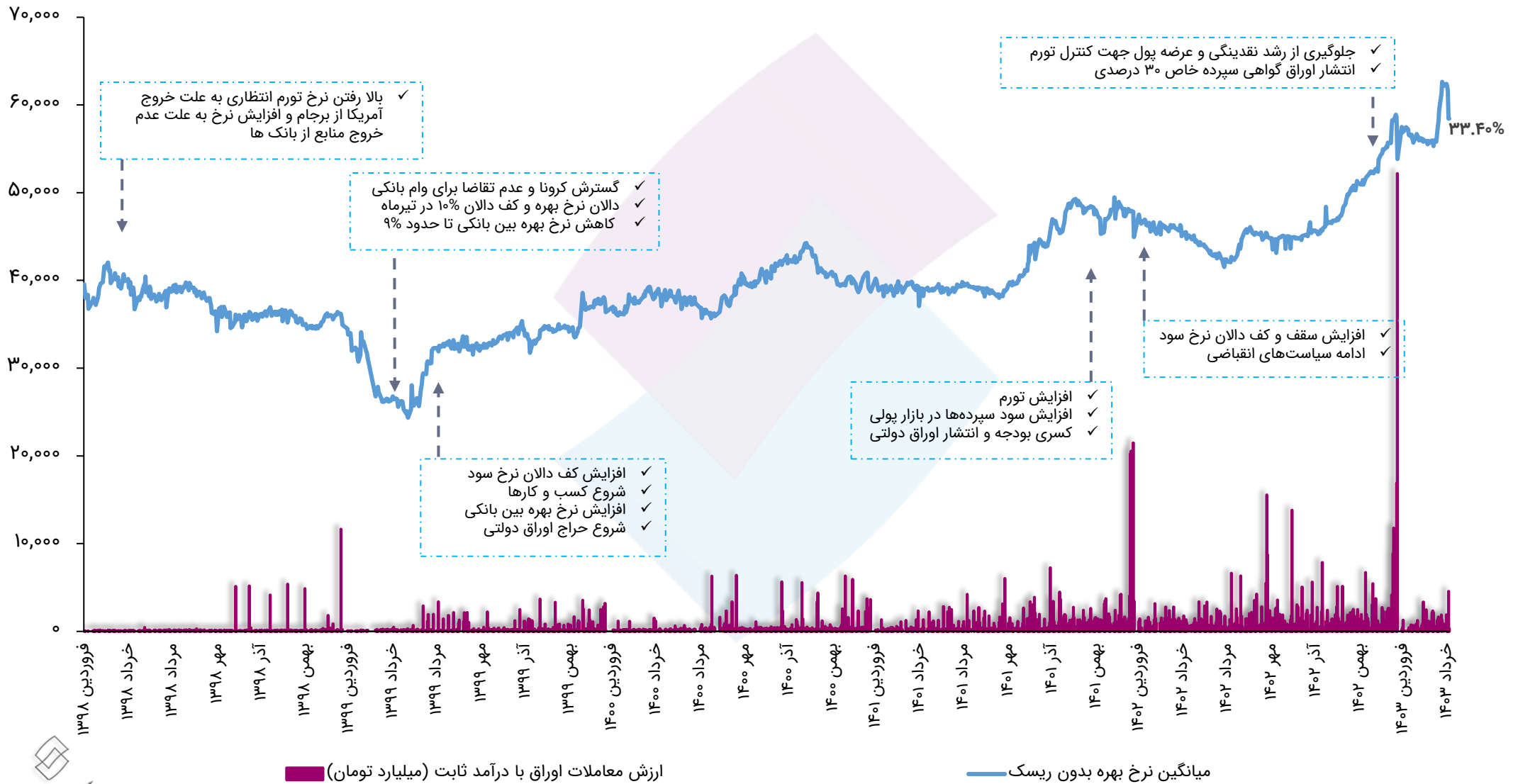


صنعت

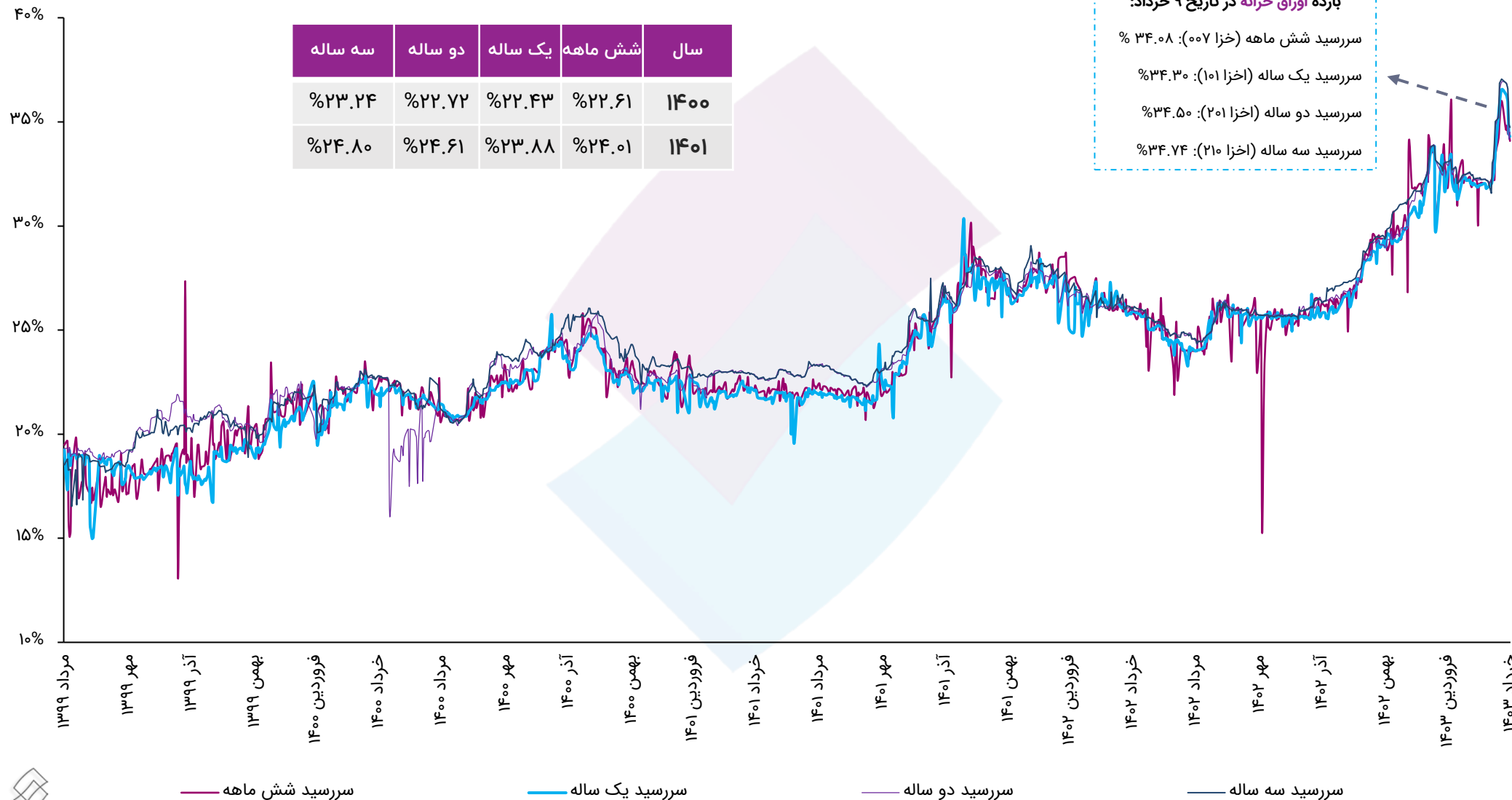


موضوع افزایش سرمایه	نماد	سرمایه فعلی سرمایه جدید تغییرات محل افزایش سرمایه		
		(میلیارد تومان)	(میلیارد تومان)	(درصد)
پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه				
بهبودی و جایگزینی ماشین آلات و تجهیزات تولید، اصلاح ساختار مالی، تأمین سرمایه در گردش مورد نیاز پروژه های در دست اجرا	فاذر	۱,۸۱۳	۳,۶۲۵	۱۰۰%
الزامات قانونی بانک مرکزی و بهره‌مندی از مزایای معافیت مالیاتی، توسعه فعالیت های خود و بهبود نسبت های احتیاطی	و خاور	۵,۰۰۰	۷,۵۰۰	۵۰%
مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر، تأمین سرمایه در گردش به منظور پذیرش تعهدات جدید در انتشار اوراق بدهی و احراز نسبت های کفایت سرمایه	داتام	۱,۰۰۰	۱,۲۰۰	۲۰%
توسعه عملیات لیزینگ	ولتجار	۲۲۰	۳۶۰	۶۴%
تقویت بنیه مالی شرکت و جذب نقدینگی جهت تکمیل تأمین مخارج پروژه ۴۲۰ تنی	کرازی	۳,۲۵۰	۳,۸۵۰	۱۸%
تصمیم هیئت مدیره به انجام افزایش سرمایه:				
مشارکت در افزایش سرمایه در حال انجام شرکت های سرمایه پذیر و جبران مخارج سرمایه ای انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های سرمایه پذیر	کچاد	۳۲,۴۰۰	۳۷,۱۵۰	۱۵%
تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه:				
سرمایه گذاری در شرکت فرعی مولد نیروگاهی گوهر سیرجان و تأمین سرمایه در گردش	وهور	۷,۶۱۸	۹,۵۱۸	۲۵%
آگهی ثبت افزایش سرمایه:				
اصلاح ساختار مالی، بهبود سرمایه نظارتی و کفایت سرمایه بانک	وبصادر	۱۷,۵۳۵	۲۱,۵۳۵	۲۳%
اصلاح ساختار مالی	غمایه	۲۴	۱۳۲	۴۵۰%
اصلاح ساختار مالی، بهبود کفایت سرمایه و توسعه فعالیت های مالی	لوتوس	۲,۴۰۰	۳,۵۰۰	۴۶%

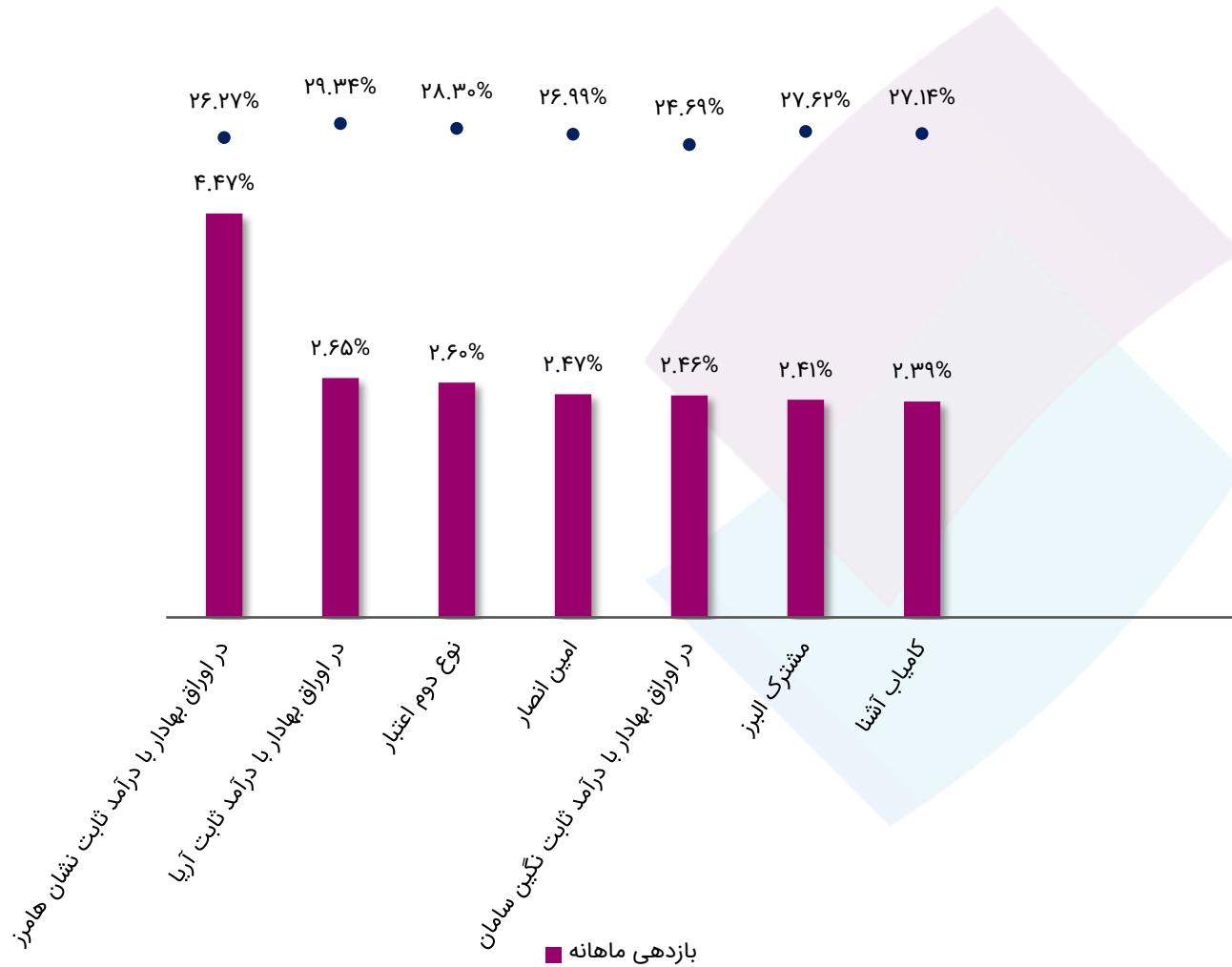
کاهش ۳.۱۶ واحدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۳.۴ درصد



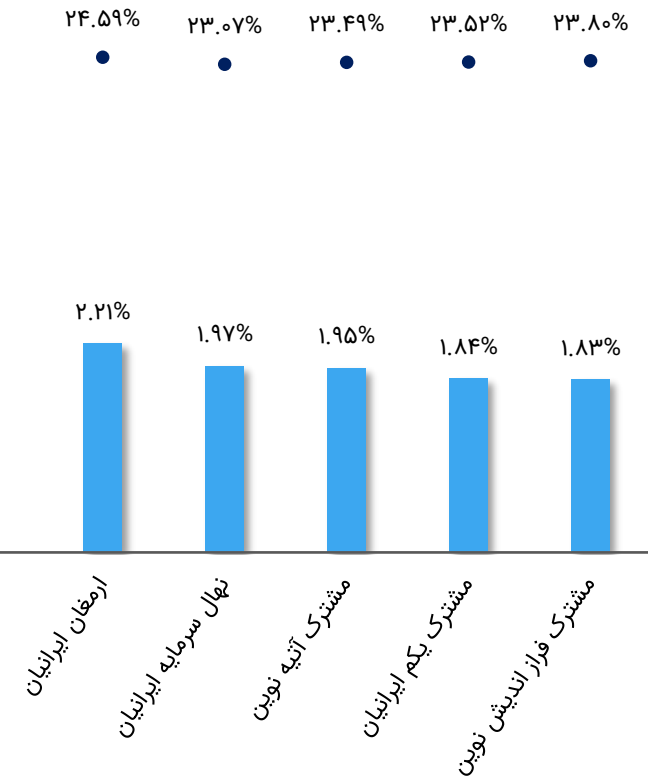
بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



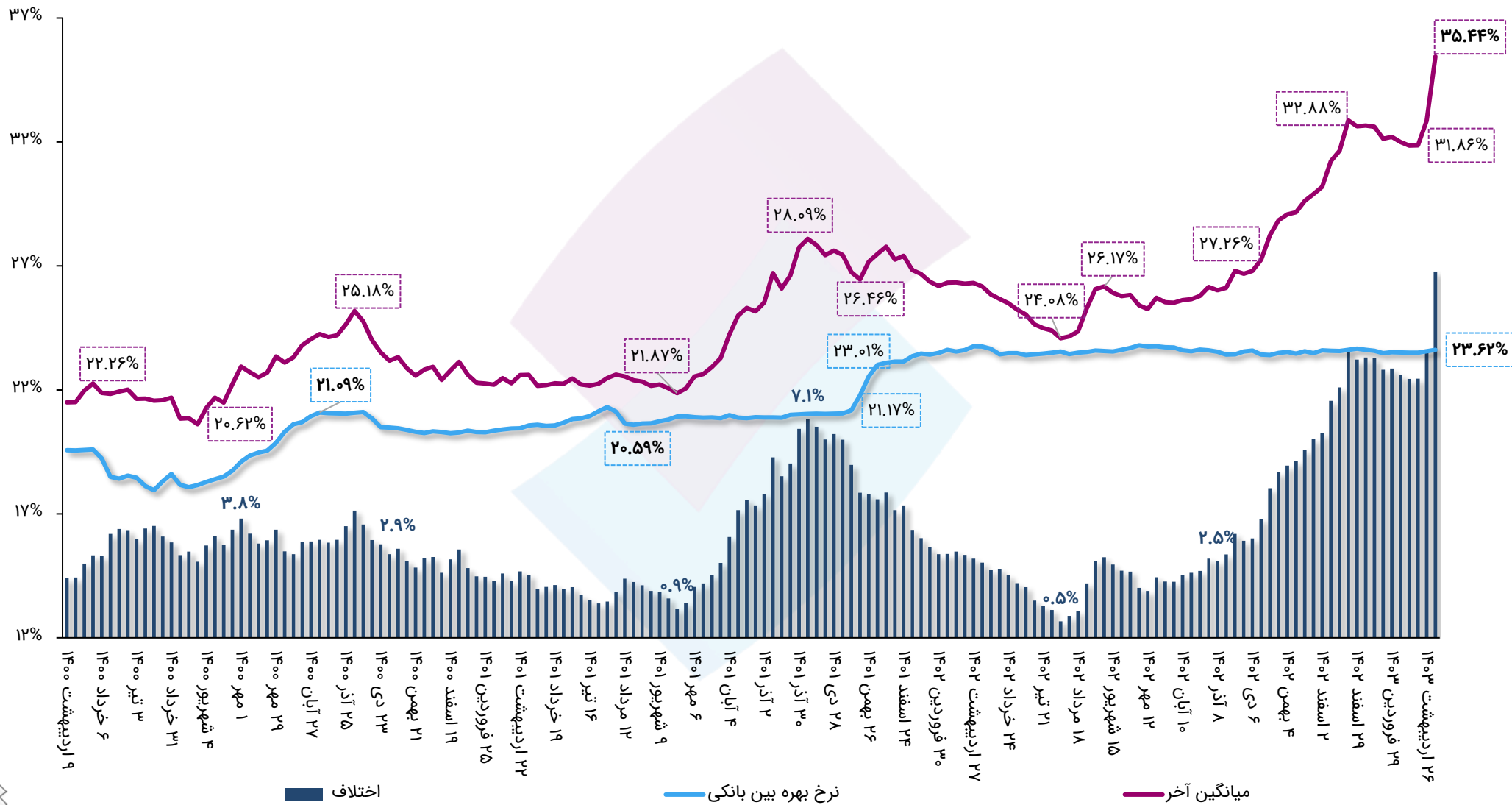
صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته



صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

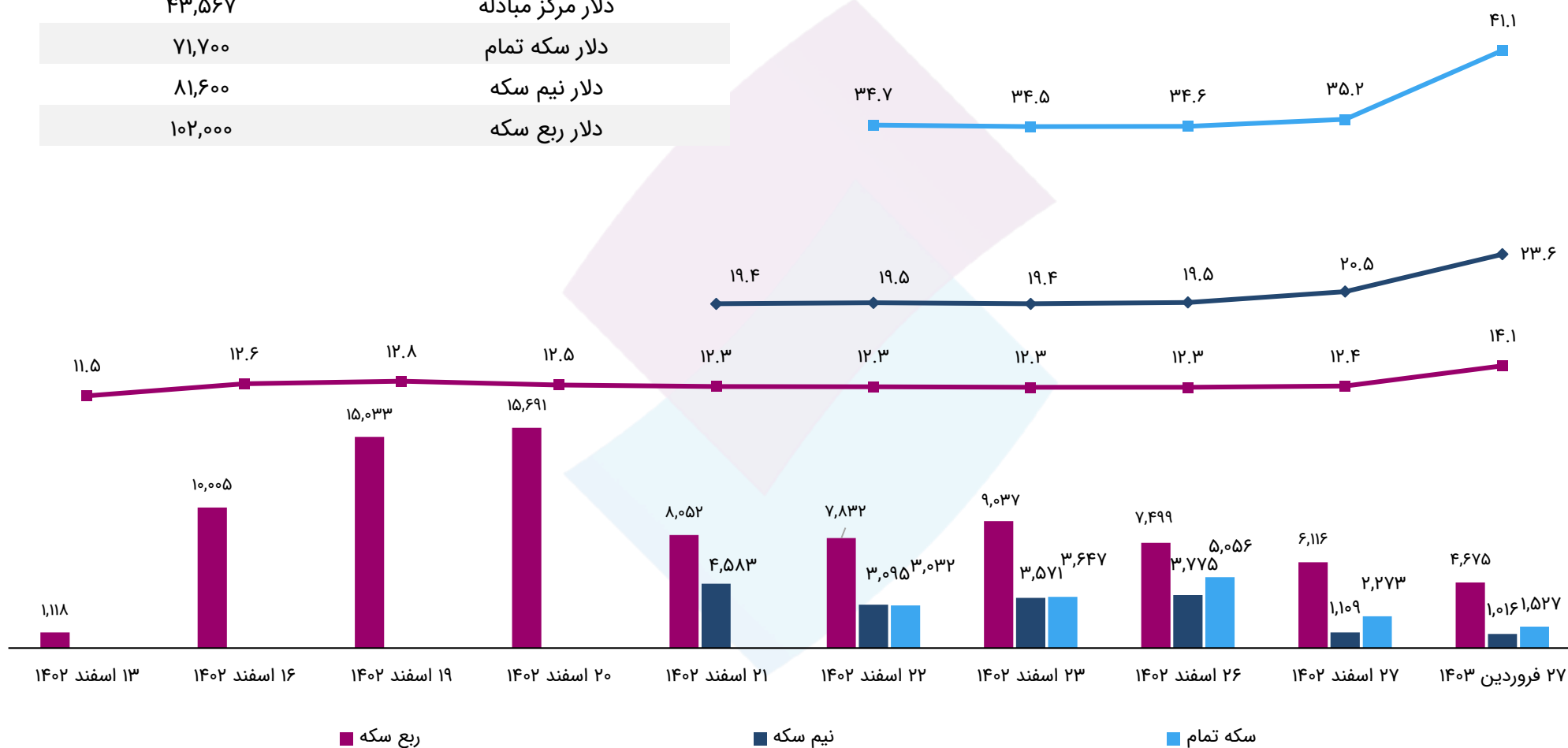


رشد ۰.۰۶ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۶۲ درصد و اجرای چهارمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به ارزش ۳۵۳ میلیارد تومان



معامله ۱۴۷ هزار و ۶۷۷ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

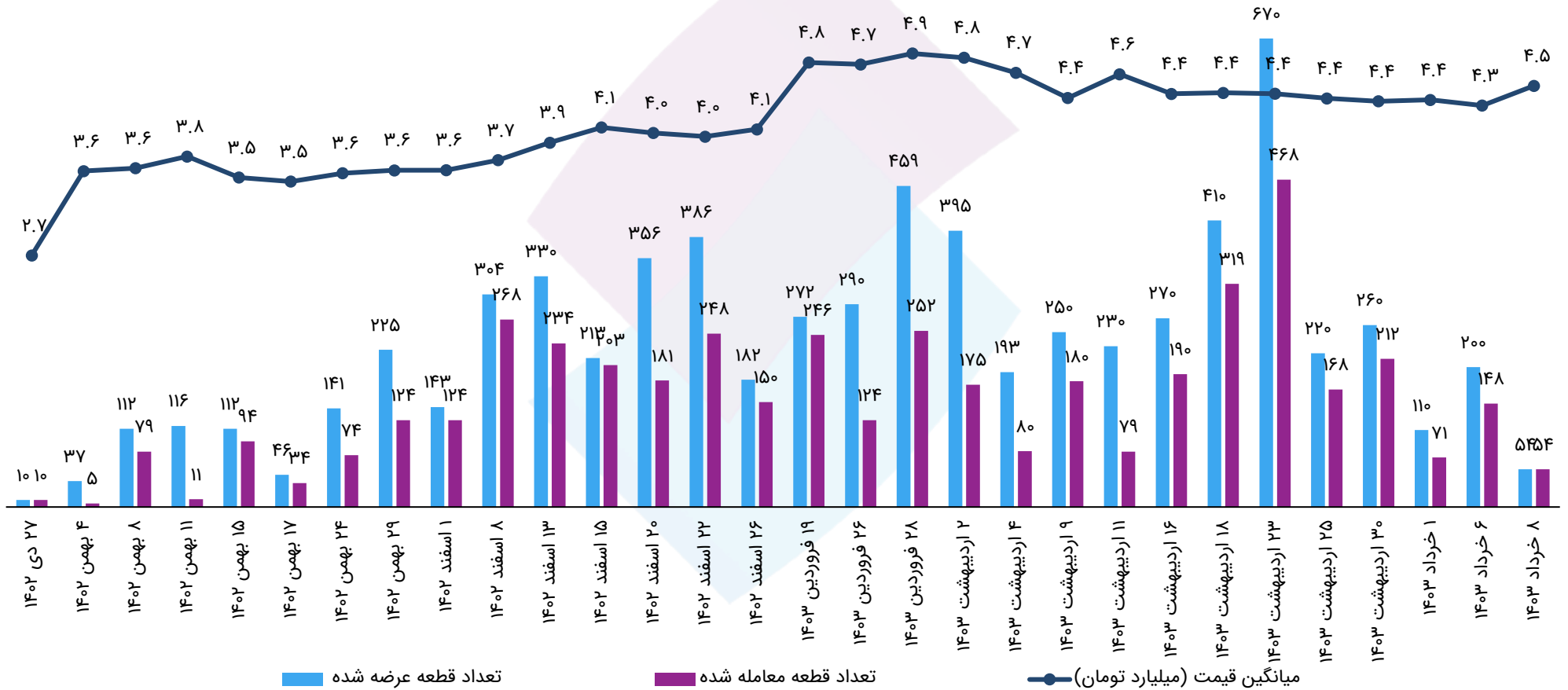
آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۳,۵۶۷
دلار سکه تمام	۷۱,۷۰۰
دلار نیم سکه	۸۱,۶۰۰
دلار ربع سکه	۱۰۲,۰۰۰



نمودارهای ستونی بیانگر تعداد سکه معامله شده است.
 نمودارهای خطی بیانگر میانگین قیمت معامله شده با واحد میلیون تومان است.

معامله ۴ هزار و ۶۰۵ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۵,۰۲۸
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۵۹,۵۰۰



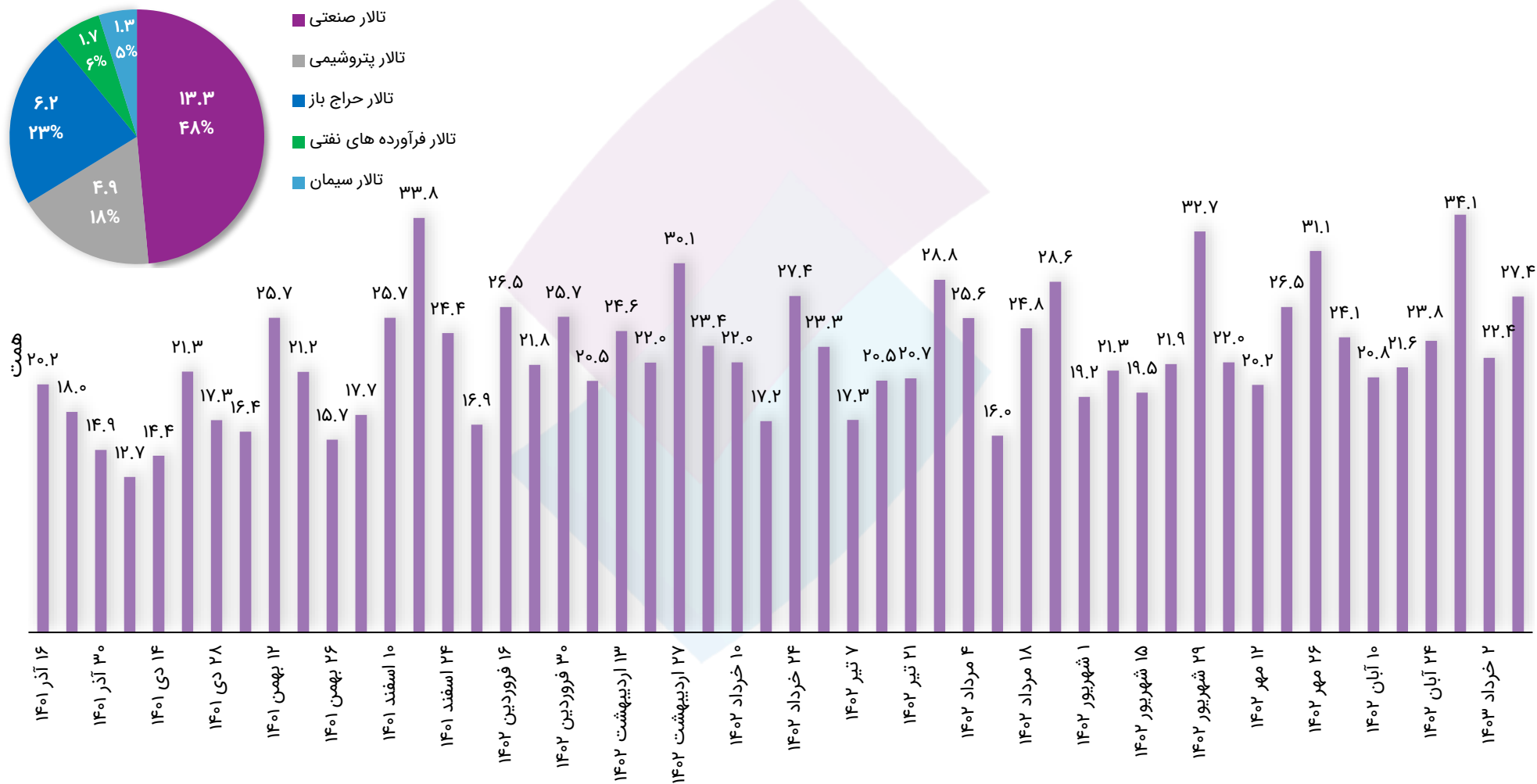
هر قطعه شمش طلای معامله شده در مرکز مبادله ایران یک کیلو گرمی بوده است.

رشد ۳.۹ درصدی نفت برنت در پی انتظارات برای تمدید محدودیت عرضه داوطلبانه تولیدکنندگان اوپک پلاس و افزایش مصرف سوخت در فصل تعطیلات تابستانی

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۱۹.۷%	۱,۹۵۹	۰.۴%	۲,۳۳۶	-۱.۵%	۲,۳۸۰	۲,۳۴۵	طلا (دلار/انس)
۳۳.۹%	۳۰۶,۹۷۰	-۱.۲%	۴۱۶,۰۱۰	۲.۰%	۴۰۳,۰۲۰	۴۱۰,۹۷۰	سکه (هزار ریال)
۷.۰%	۴۲۱,۴۴۲	۱.۷%	۴۴۳,۱۴۴	۰.۶%	۴۴۸,۱۱۱	۴۵۰,۸۴۵	دلار اسکناس (ریال)
۹.۹%	۳۸۳,۱۲۹	۱.۷%	۴۱۳,۷۶۷	۰.۶%	۴۱۸,۴۰۴	۴۲۰,۹۵۷	دلار حواله (ریال)
۱۵.۳%	۷۴	-۴.۰%	۸۹	۳.۹%	۸۲	۸۵	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۴۴.۶%	۲۷,۷۰۲	۶.۲%	۶۳,۸۴۱	-۲.۰%	۶۹,۱۲۲	۶۷,۷۷۱	بیت کوین (دلار)
۲۷.۲%	۸,۱۲۰	۴.۰%	۹,۹۳۰	-۱.۱%	۱۰,۴۴۶	۱۰,۳۳۰	مس LME (دلار/تن)
۳۱.۴%	۲,۳۲۳	۶.۰%	۲,۸۸۱	۰.۸%	۳,۰۲۸	۳,۰۵۳	روی LME (دلار/تن)
-۴.۲%	۵۲۰	-۰.۲%	۴۹۹	-۰.۷%	۵۰۱	۴۹۸	بیلت CIS (دلار/تن)
۱.۵%	۴۷۱	۱.۵%	۴۷۱	۰.۰%	۴۷۸	۴۷۸	بیلت ایران (دلار/تن)
۲۱.۹%	۲۴۷	۲.۷%	۲۹۳	-۳.۸%	۳۱۳	۳۰۱	متانول CFR (\$/mt)
-۱۴.۵%	۳۵۵	۰.۰%	۳۰۳	۲.۵%	۲۹۶	۳۰۳	سبب اوره (mt/\$)
۳۳.۲%	۲.۱۱	۸۱.۳%	۱.۵۵	-۱.۱%	۲.۸۴	۲.۸۱	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)

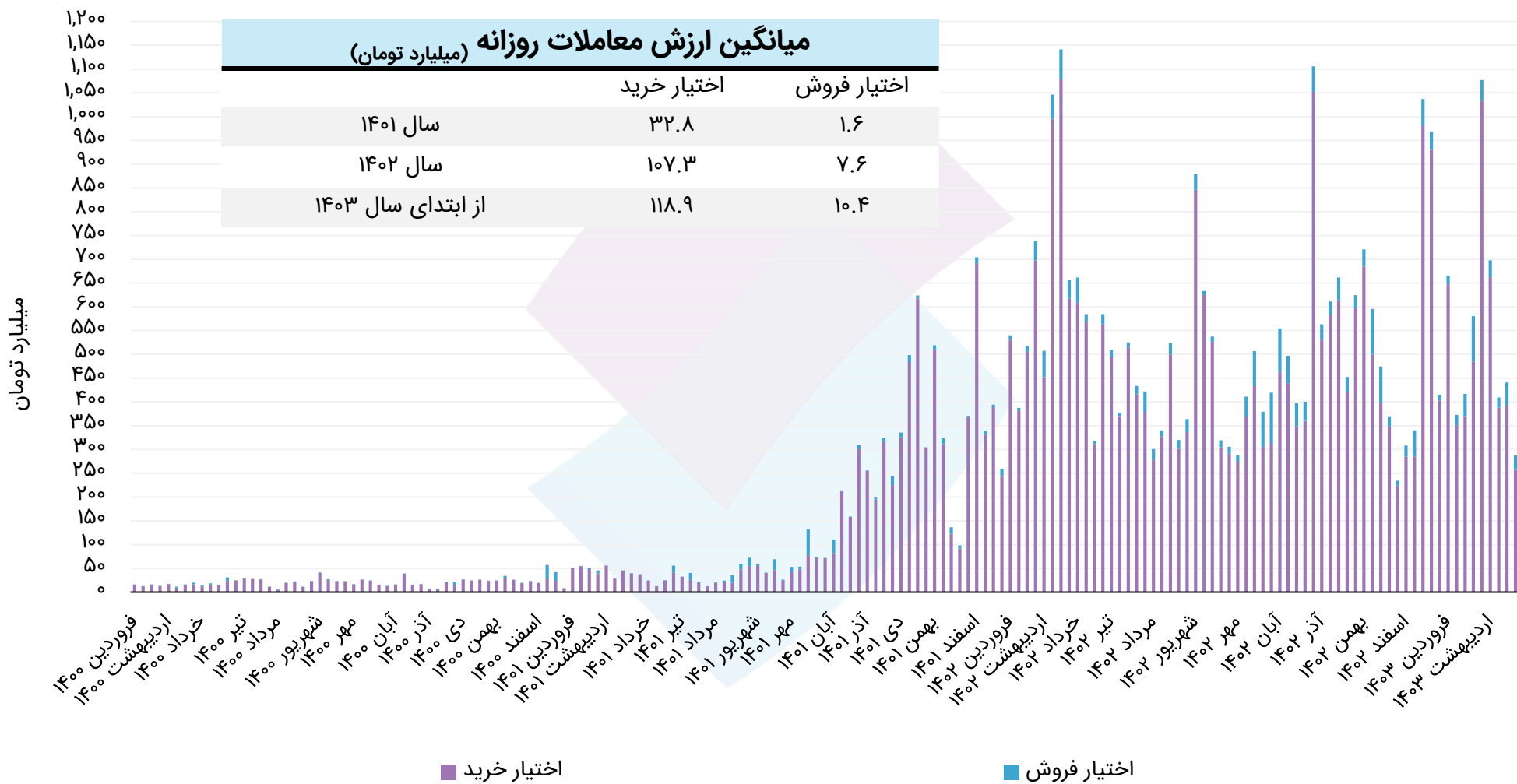
روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

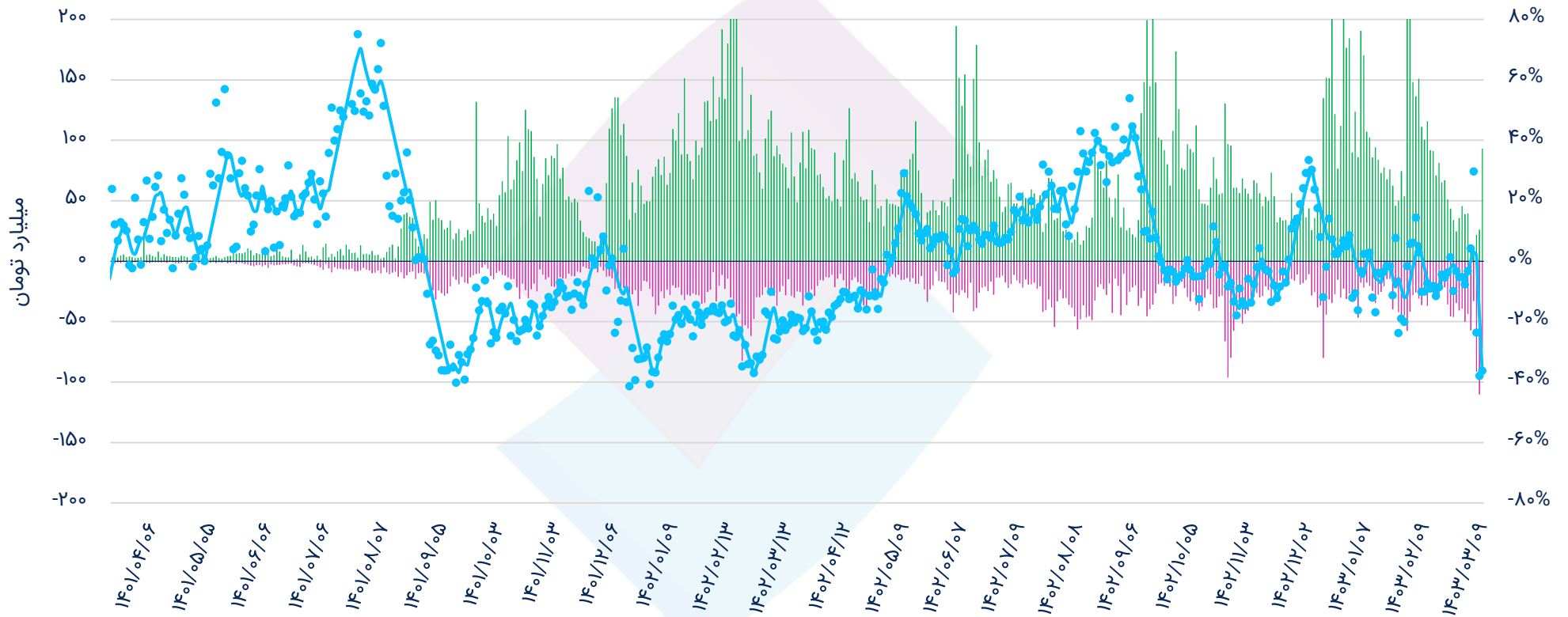


کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات(تن)	عرضه کننده
آهن اسفنجی	۱۲.۴	۲۴۶,۴۵۰	فولاد خوزستان، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، فولاد غدیر نی ریز، پارس فولاد سبزوار، احیاء استیل فولاد بافت، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، صنعت فولاد شادگان، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق
شمش بلوم	۲۰.۶	۱۳۷,۲۷۵	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد خوزستان، فولاد کاوه جنوب کیش، آهن و فولاد ارفع، فولاد بوتیای ایرانیان، مجتمع فولاد خراسان، جهان فولاد سیرجان، فولاد سیرجان ایرانیان، شرکت فولاد زرنده ایرانیان، صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، مجتمع فولاد البرز ناب آرش
مس کاتد	۵۳۱.۰	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
تختال	۲۲.۵	۸۰,۰۰۰	فولاد خوزستان، فولاد هرمزگان جنوب
میلگرد	۲۳.۹	۷۰,۰۱۶	مجتمع فولاد خراسان، جهان فولاد سیرجان، تولیدی فولاد سپید فراب کویر، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد شاهرود، فولاد کاوه اروند، فولاد آلیاژی ایران، ذوب آهن اصفهان، صنایع نورد میلاد یزد، نورد میلگرد کاسپین، نورد فولاد صنعتی و ساختمانی یزد، فولاد سپهر ایرانیان
گندله سنگ آهن	۵.۱	۲۶۹,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، سنگ آهن گهر زمین، شرکت فولاد زرنده ایرانیان
لوب کات	۲۲.۵	۶۱,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت آبادان
سیمان	۱.۰	۱,۳۲۵,۲۲۴	سیمان تهران، سیمان ساوه، سیمان آبیگ، سیمان مازندران، سیمان هرمزگان، سیمان صوفیان، سیمان سپاهان، سیمان ارومیه، سیمان هگمتان، سیمان ممتازان کرمان، سیمان خوزستان، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان شرق، سیمان عمران انارک، سیمان بجنورد، صنایع سیمان شهرکرد، سیمان آرتا اردبیل، سیمان فارس نو، سیمان کرمان، سیمان شاهرود، سیمان فراز فیروزکوه، گروه صنعتی معدنی سیمان تجارت مهریز، سیمان فیروزکوه
مس مفتول	۵۶۱.۵	۲,۳۶۵	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان، ملی صنایع مس ایران، گیل راد شمال، گروه صنایع کابلسازی افق البرز
وکیوم باتوم	۱۴.۵	۶۶,۳۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت تهران (تندگویان)
کنسائتره سنگ آهن	۳.۸	۱۹۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، سنگ آهن گهر زمین، بین‌المللی اسم ایران
شمش آلومینیوم	۱۳۳.۳	۵,۴۰۰	آلومینیوم ایران(ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم مهدی، آلومینای ایران
ورق سرد	۳۸.۰	۱۷,۸۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، فولاد غرب آسیا، صنایع هفت الماس
پلی اتیلن ترفتالات	۵۱.۶	۱۲,۷۱۸	پتروشیمی تندگویان، Wankai New Materials Co.,Ltd، Ismail Resin Limited، Reliance Industries Limited
پلی پروپیلن نساجی	۵۲.۹	۱۱,۸۶۵	پتروشیمی مارون، دی آریا پلیمر، پتروشیمی شازند، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)، پتروشیمی رجال، پتروشیمی پلی نار، نوید زرشمی



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



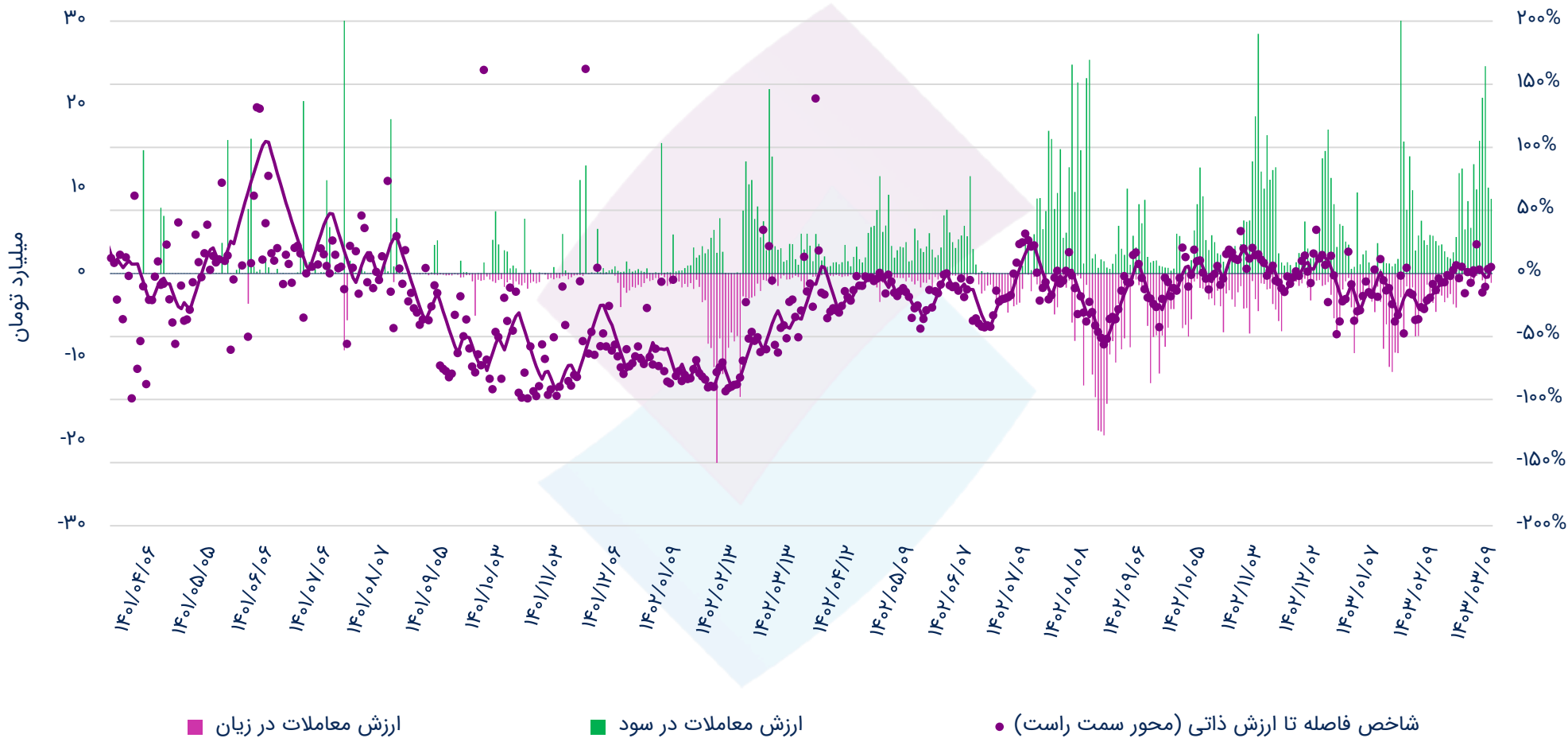
● شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (محور سمت راست)
 ■ ارزش معاملات در سود
 ■ ارزش معاملات در زیان

(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

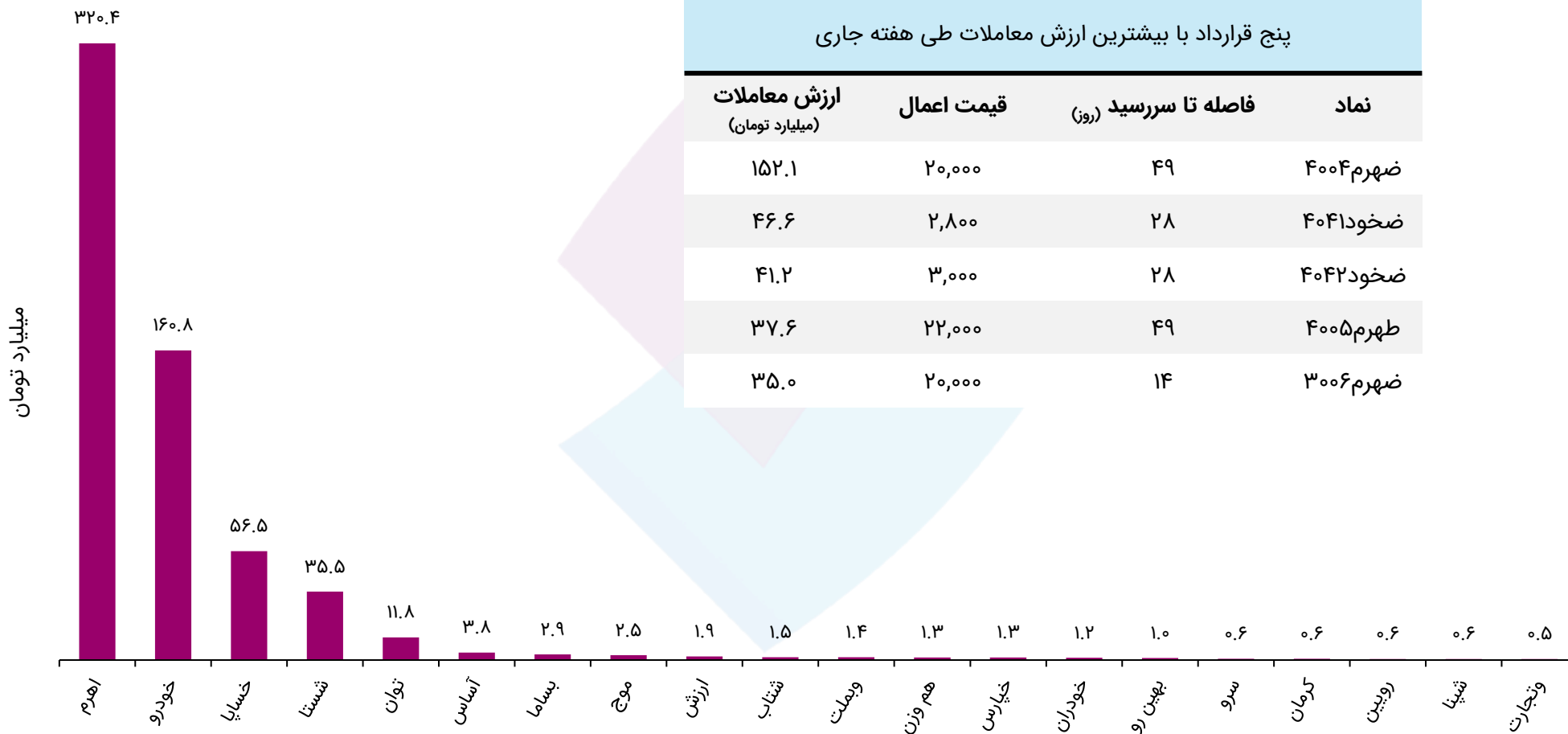


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).
 (۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه
 (۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

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 ۴۰۰۴	۴۹	۲۰,۰۰۰	۱۵۲.۱
ضخود ۴۰۴۱	۲۸	۲,۸۰۰	۴۶.۶
ضخود ۴۰۴۲	۲۸	۳,۰۰۰	۴۱.۲
طهرم ۴۰۰۵	۴۹	۲۲,۰۰۰	۳۷.۶
ضهرم ۳۰۰۶	۱۴	۲۰,۰۰۰	۳۵.۰



ثبت نام آنلاین آئی

دوست دار طبیعت باشیم

NeoBroker
نئوکارگزاری نوین
راهکار نیازهای نوین

→ My.Nibb.ir



شرایط ویژه اعتباری برای مشتریان

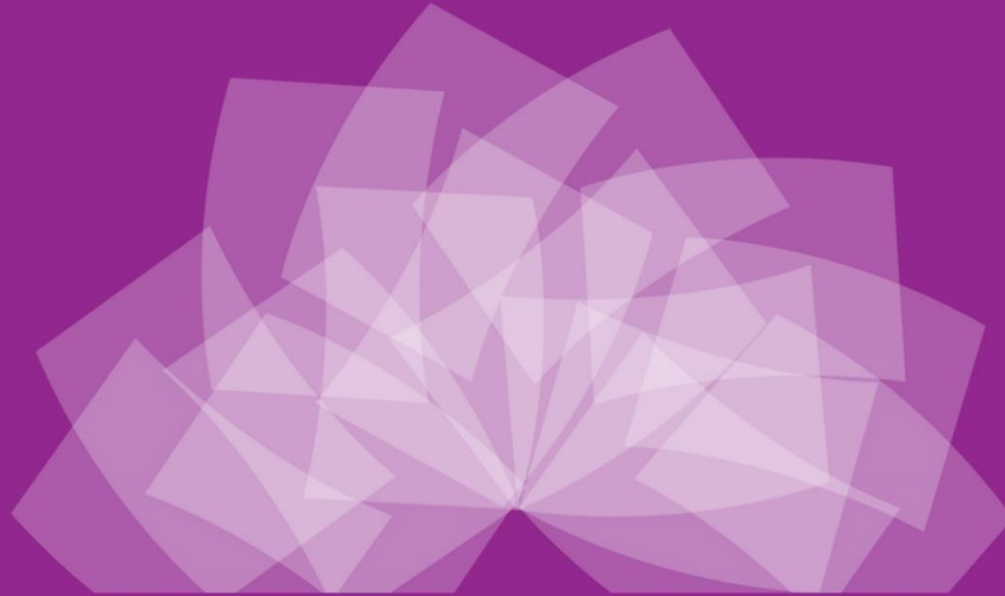
- ◆ برگشت کارمزد و اعطای اعتبار رایگان برای مشتریان پرگردش
- ◆ تا ۲ درصد تخفیف اعتبار در نرخ هزینه مالی با هربار گردش اعتبار
- ◆ اعطای اعتبار رایگان با حداقل ۱۴ بار گردش اعتبار در ماه



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 با 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

☎ ۰۲۱ - ۸۶۷۹ ۱۰۰۰

🌐 www.nibb.ir

✉ info@nibb.ir

📷 [nibb.ir](https://www.instagram.com/nibb.ir)

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

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