

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 ۲۴ مرداد - شماره ۱۶۳

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
۲۳	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



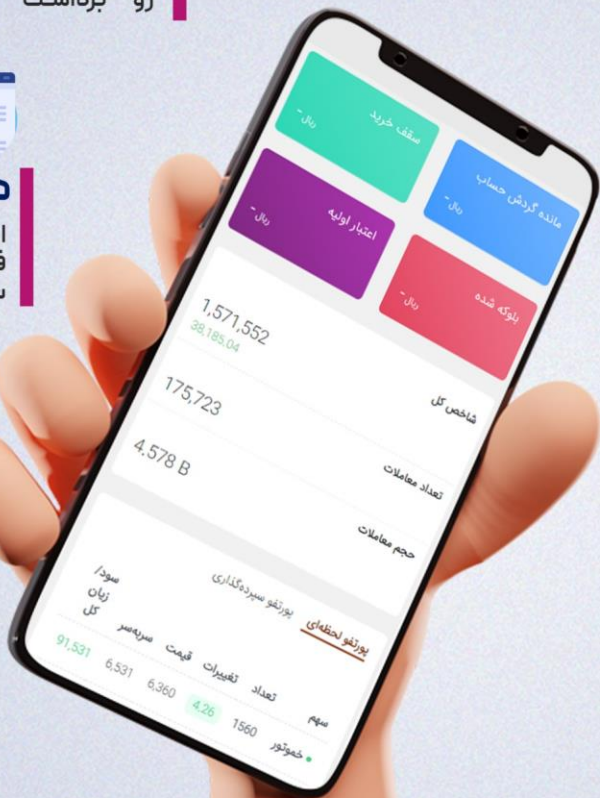
## برداشت وجه آئی

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

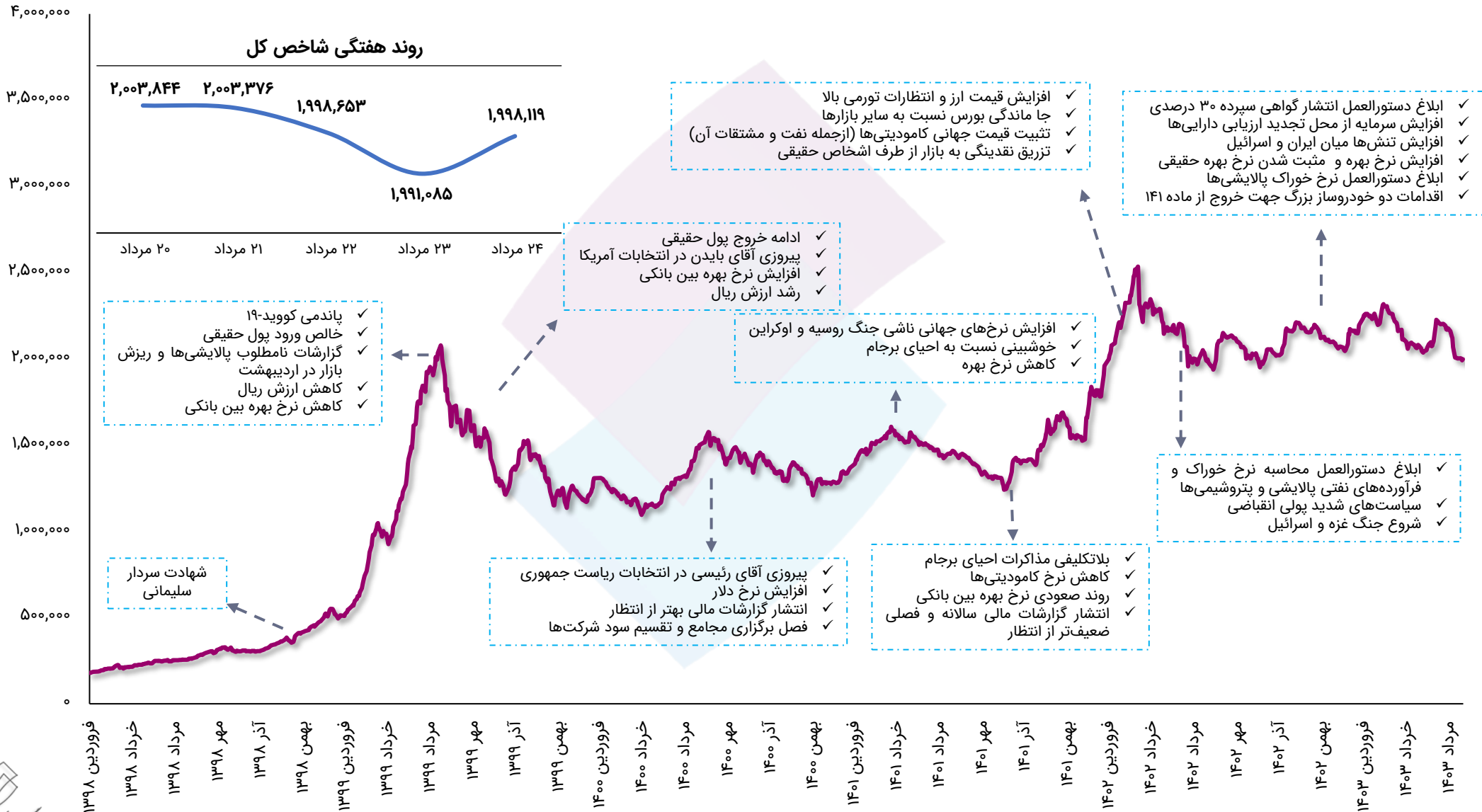
→ My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

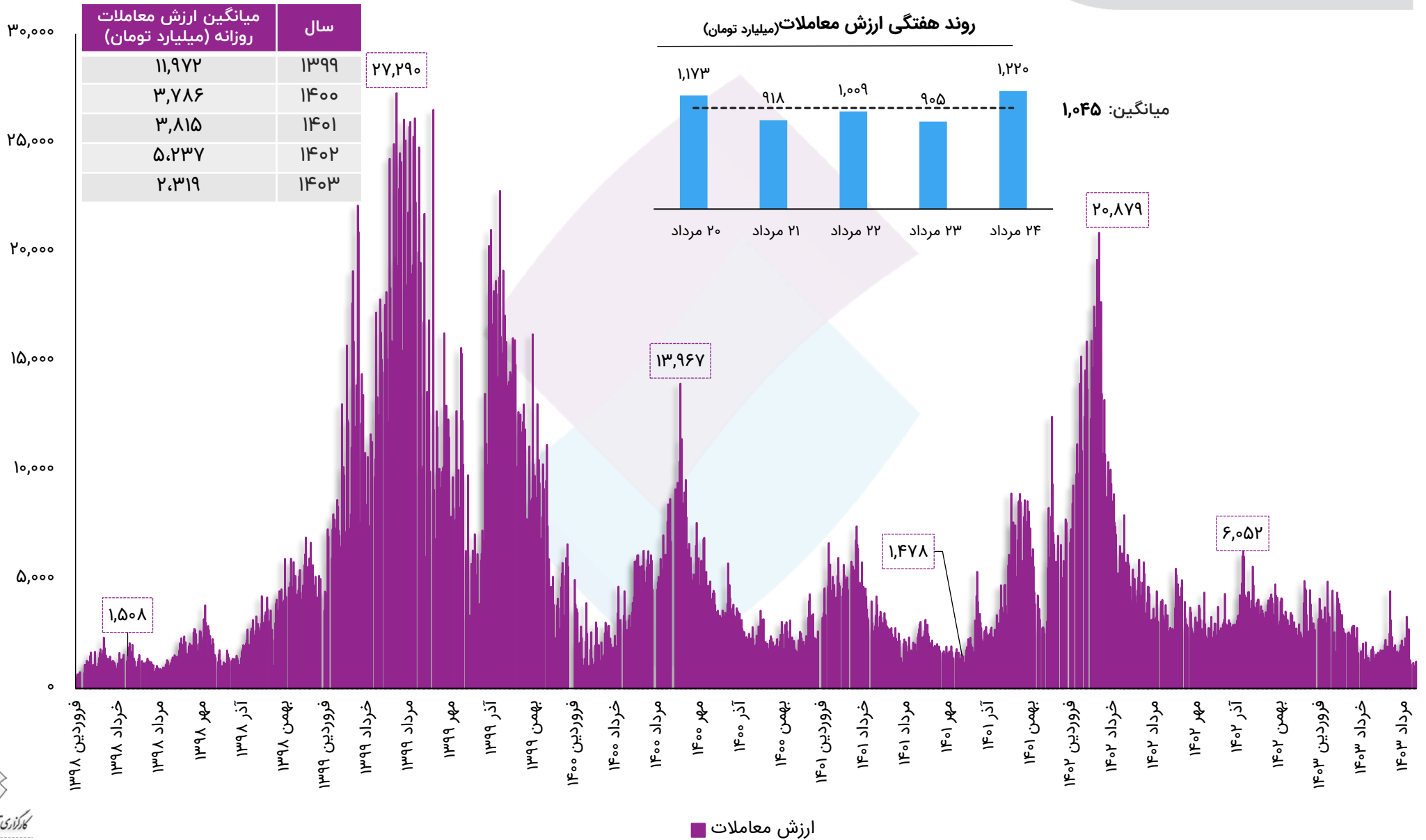


وضعیت بازار سرمایه  
در هفته‌ای که گذشت.

## کاهش ۰.۲ درصدی شاخص کل در هفته جاری

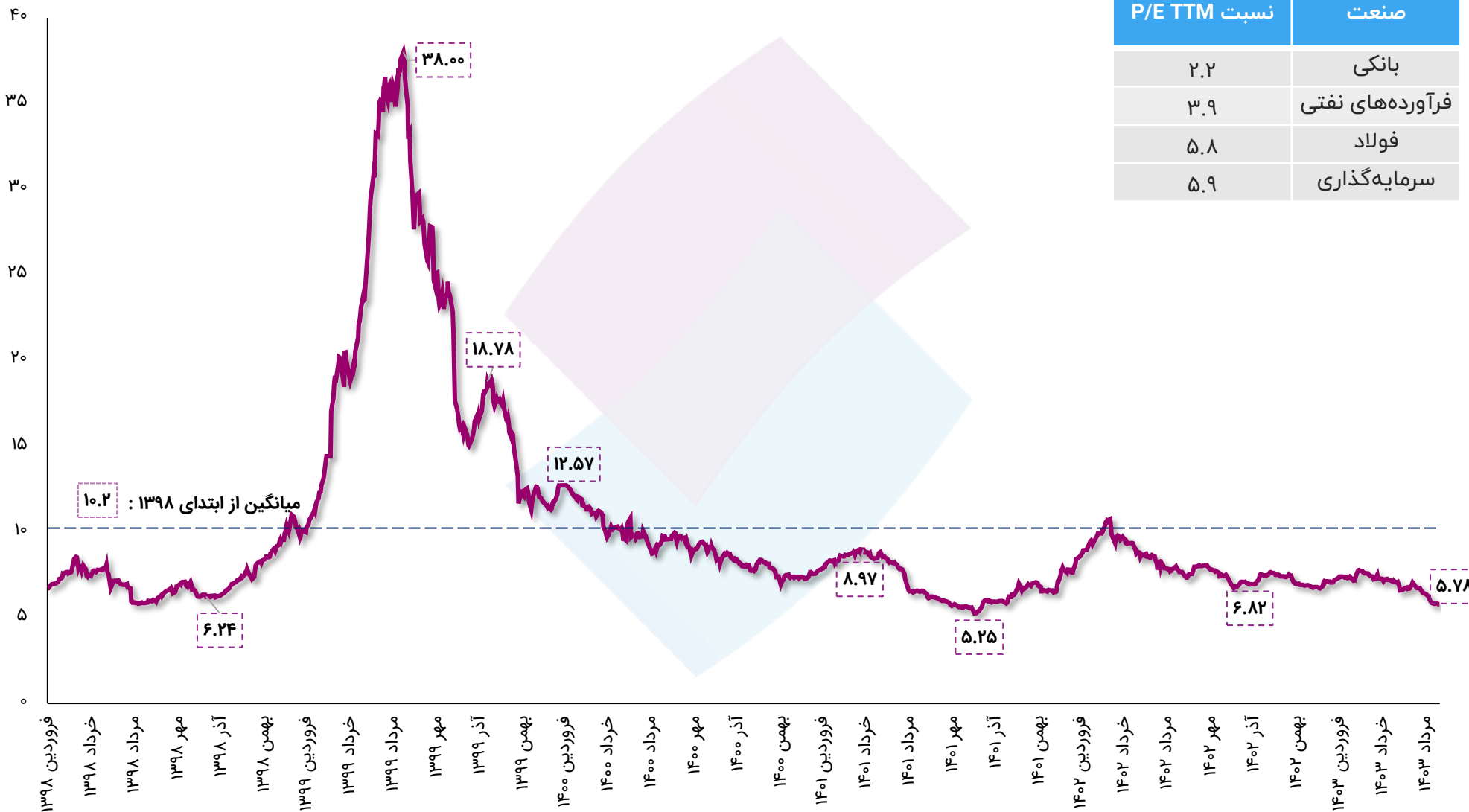


# ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



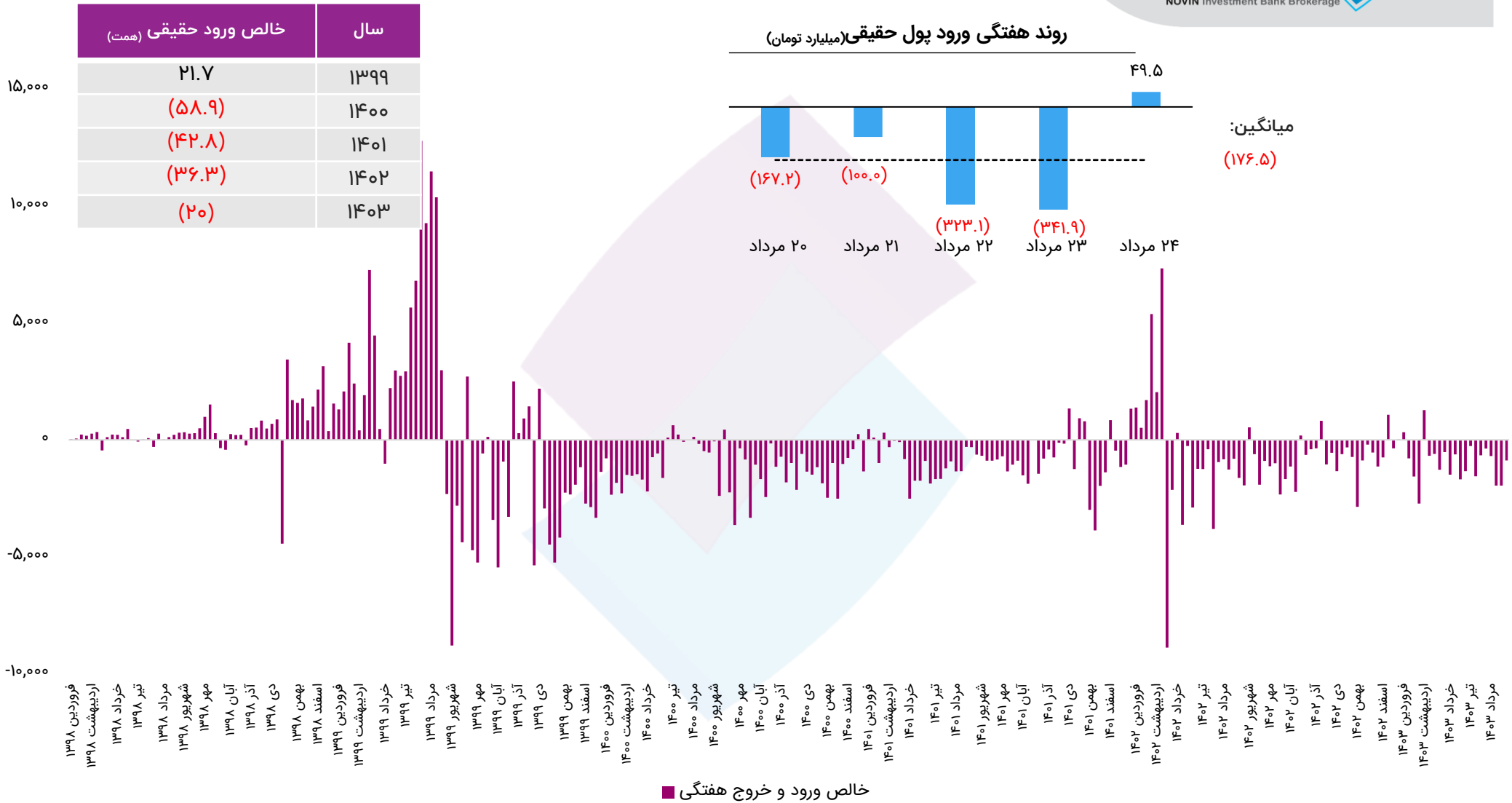


# نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۲	بانکی
۳.۹	فرآورده‌های نفتی
۵.۸	فولاد
۵.۹	سرمایه‌گذاری

## ۸۸۳ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱.۹۵۹ میلیارد تومانی هفته گذشته

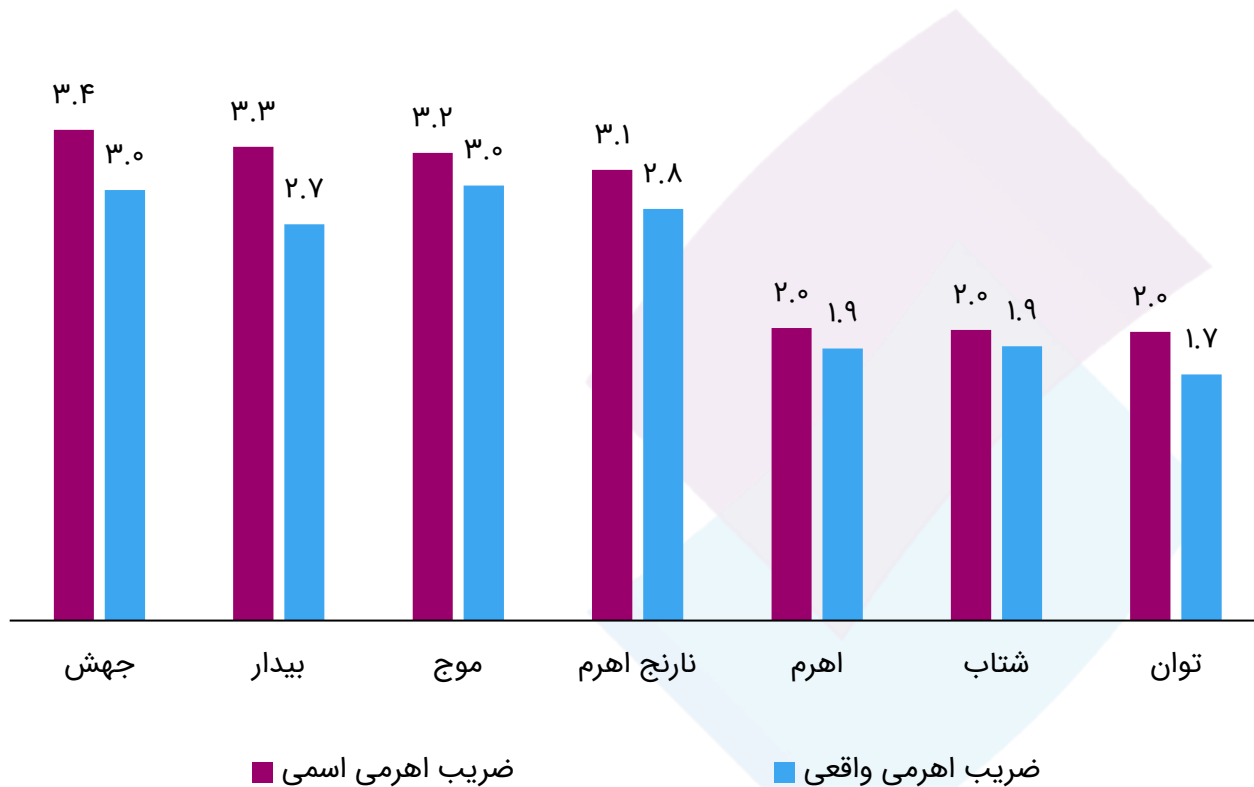


## صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

### صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



# صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب
اهرم	-۰.۹%
بیدار	-۱.۲%
نارنج اهرم	-۳.۳%
جهش	-۳.۶%
توان	-۴.۲%
شتاب	-۴.۶%
موج	-۶.۸%

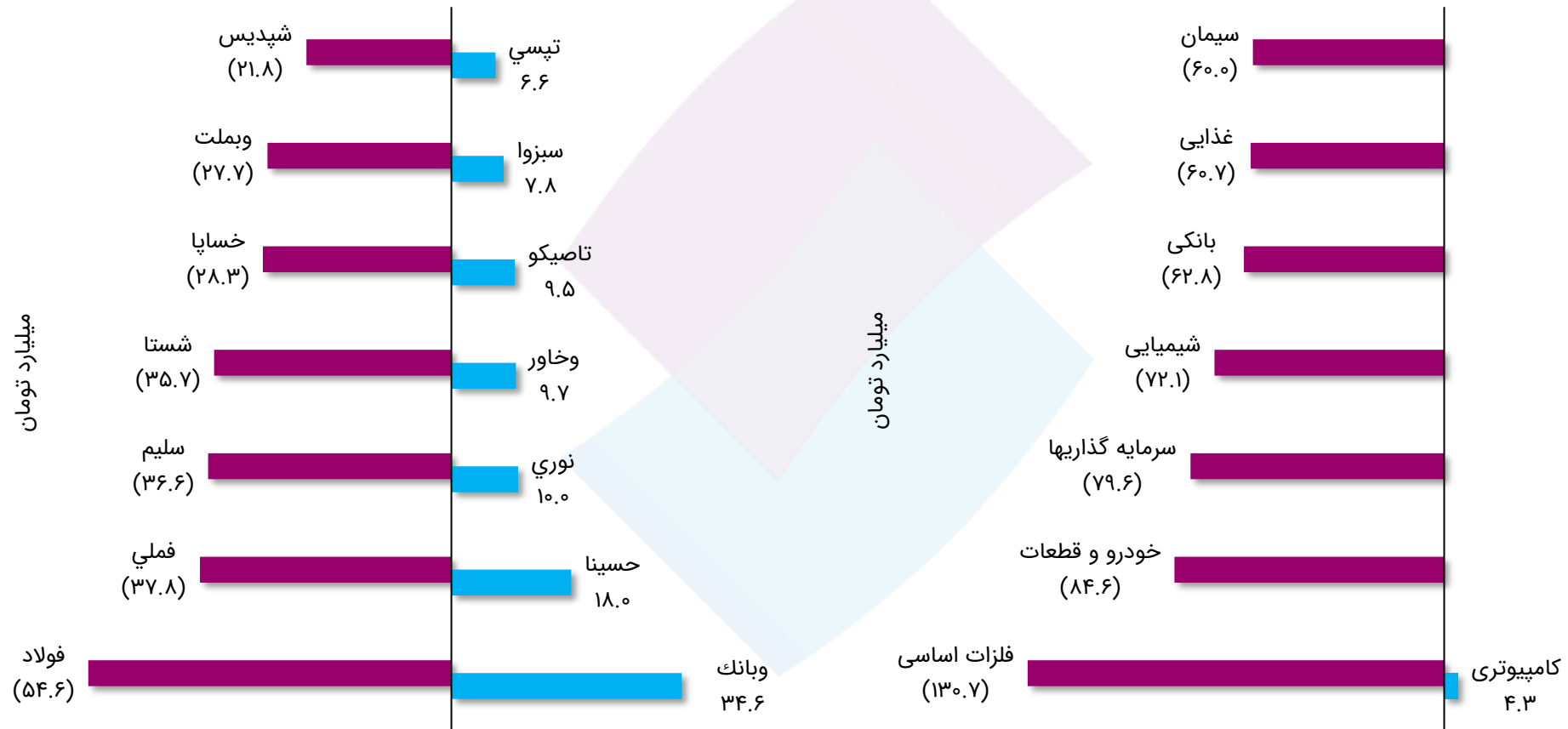
نماد	بازده ماهانه عادی	بازده ماهانه
توان	۲.۲%	-۱۴.۵%
شتاب	۲.۴%	-۱۷.۴%
اهرم	۲.۷%	-۲۱.۱%
موج	۲.۶%	-۲۲.۰%
نارنج اهرم	۲.۴%	-۲۴.۷%
بیدار	۲.۷%	-۲۶.۹%
جهش	۲.۶%	-۲۷.۹%

حباب = قیمت پایانی تابلو/NAV ابطال - ۱  
 بازده ماهانه = قیمت پایانی آخرین روز معاملاتی ماه / قیمت پایانی ۳۰ روز گذشته - ۱  
 بازده ماهانه 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 و وجه نقد) / خالص ارزش دارایی واحد ممتاز

## بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

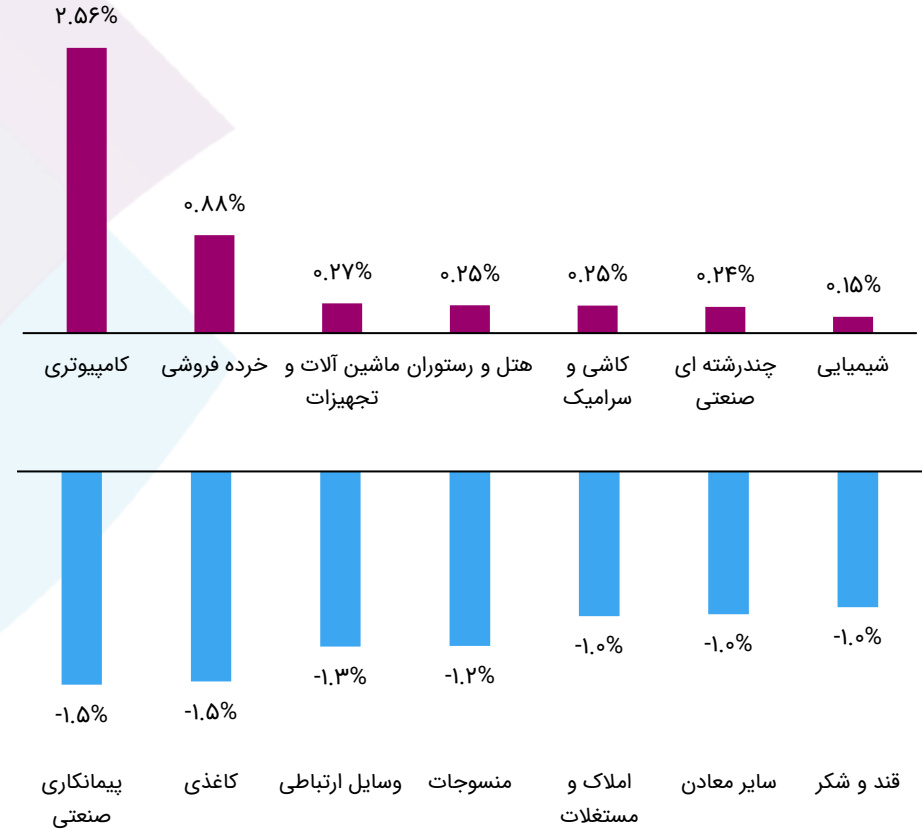
### صنعت

### نماد



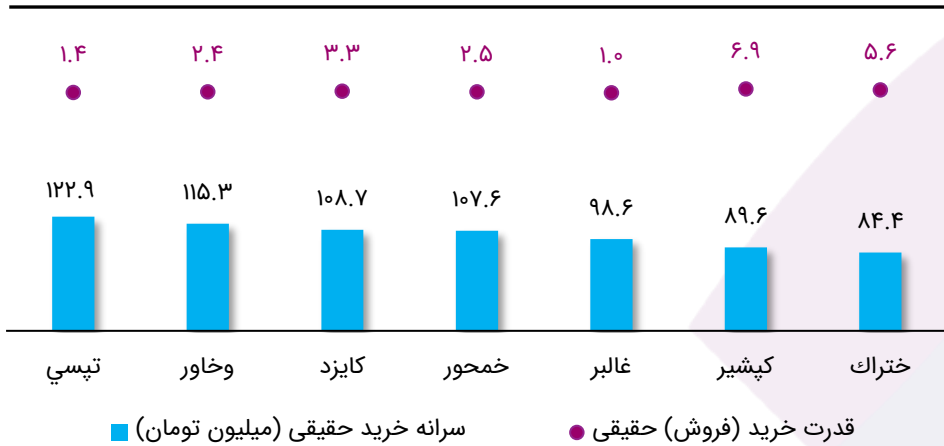
نماد

صنعت

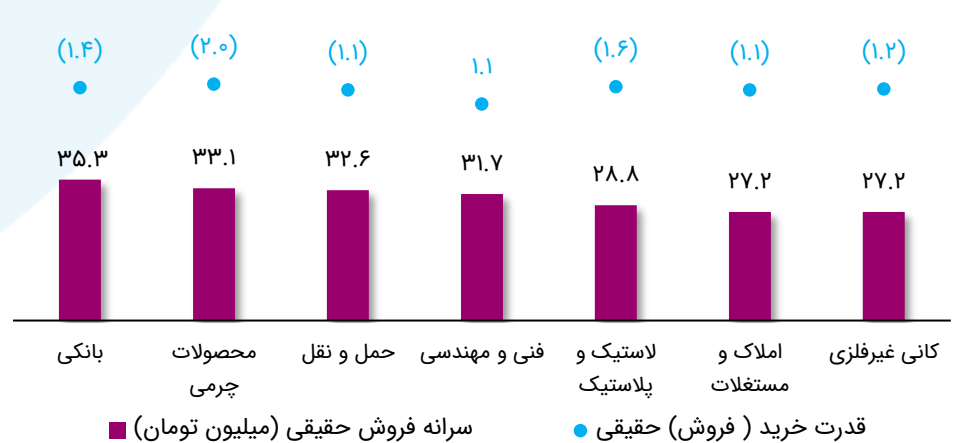
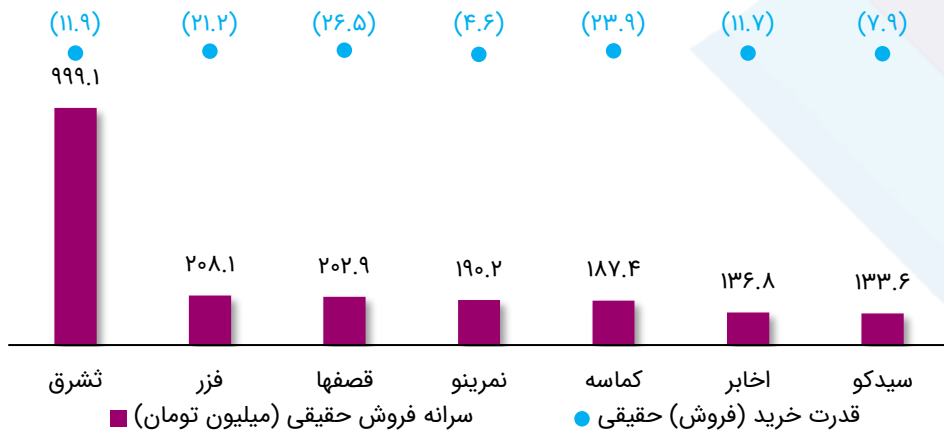
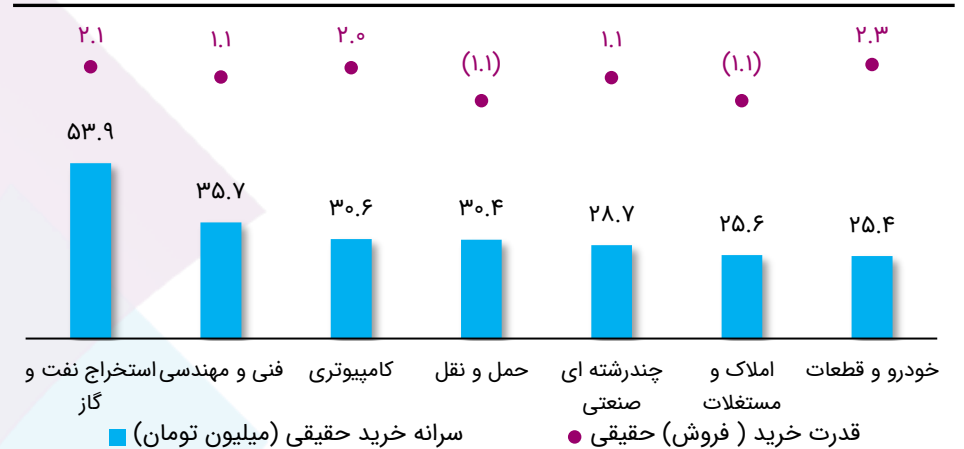


## بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

### نماد



### صنعت



موضوع افزایش سرمایه	نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید تغییرات (میلیارد تومان)	محل افزایش سرمایه (درصد)
<b>پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه</b>				
اصلاح ساختار مالی، جبران مخارج سرمایه گذاری انجام شده و استفاده از معافیت مالیاتی	کایزد	۱۰۰	۱۶۷	۶۸%
اصلاح ساختار مالی و بهره مندی از معافیت مالیاتی	فسوژ	۶۰	۲۴۰	۳۰۰%
<b>آگهی ثبت افزایش سرمایه</b>				
جبران مخارج انجام شده بابت سرمایه‌گذاریهای صورت گرفته (خرید کانتینر و کامیون کشنده) و جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر	حکشتی	۵,۷۷۲	۸,۲۵۰	۴۳%

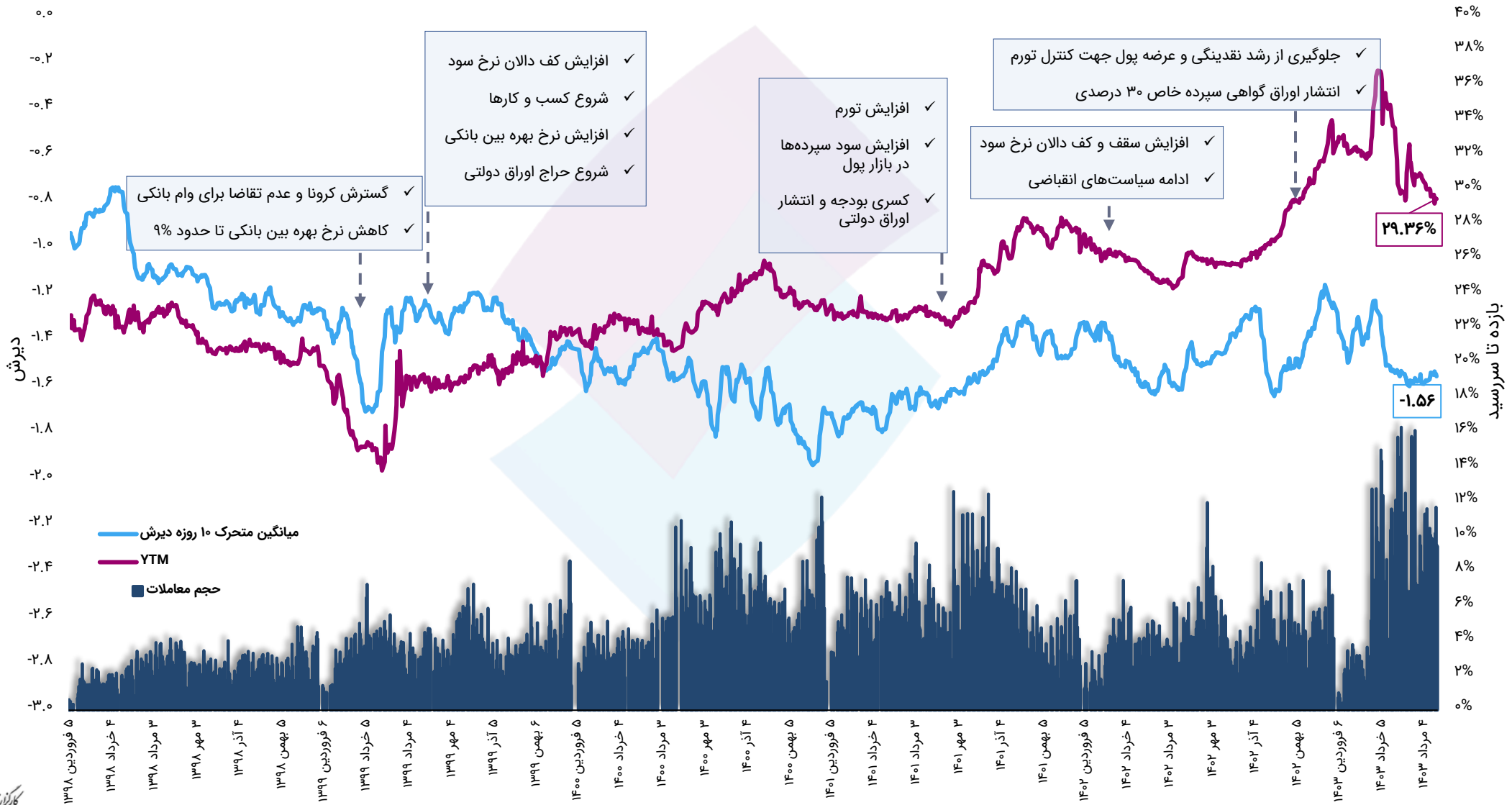


موضوع افزایش سرمایه	نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید تغییرات (میلیارد تومان)	محل افزایش سرمایه (درصد)
---------------------	------	-----------------------------	-------------------------------------	--------------------------

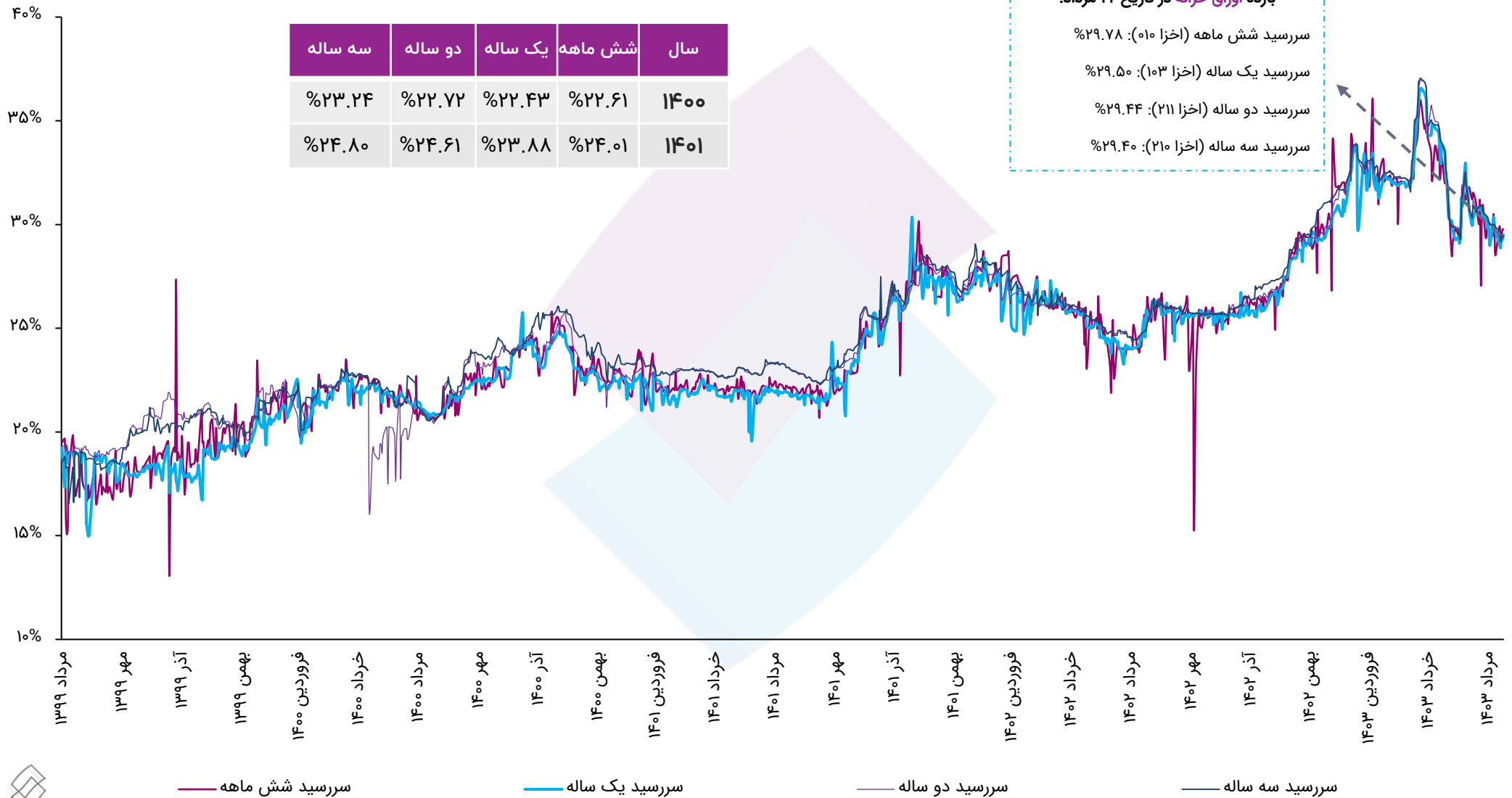
## صدور مجوز افزایش سرمایه

اصلاح ساختار مالی	پلاست	۹۰	۵۰۳	تجدید ارزیابی ۴۵۸%
اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالاهای ایرانی	سنیر	۲۳	۳۴۰	تجدید ارزیابی ۱۳۷۶%
اصلاح ساختار مالی	البرز	۴,۶۰۰	۷,۰۰۰	سودانباشته (۹۰%) اندوخته (۱۰%) ۵۲%
اصلاح ساختار مالی و جبران مخارج سرمایه ای	وامیر	۸	۶۳۰	سودانباشته ۷۴۰۰%
اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالاهای ایرانی	سفانو	۵۰	۱۶۰	سودانباشته (۲%) تجدید ارزیابی (۹۸%) ۲۲۰%
اصلاح ساختار مالی، جلوگیری از خروج نقدینگی و توسعه عملیات واسپاری	ولتجار	۲۲۰	۳۵۰	سودانباشته ۵۹%
اصلاح ساختار مالی	فن افزار	۱۵۰	۴۰۰	سودانباشته ۱۶۷%
اصلاح ساختار مالی و جبران مخارج سرمایه گذاری های انجام شده	وهامون	۵۰۰	۱,۰۰۰	آورده نقدی ۱۰۰%
توسعه فعالیت تامین مالی و بهبود نسبت کفایت سرمایه	تفارس	۱۰۰۰	۱,۵۰۰	آورده نقدی ۵۰%

## کاهش ۰.۱۴ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۲۹.۳۶ درصد

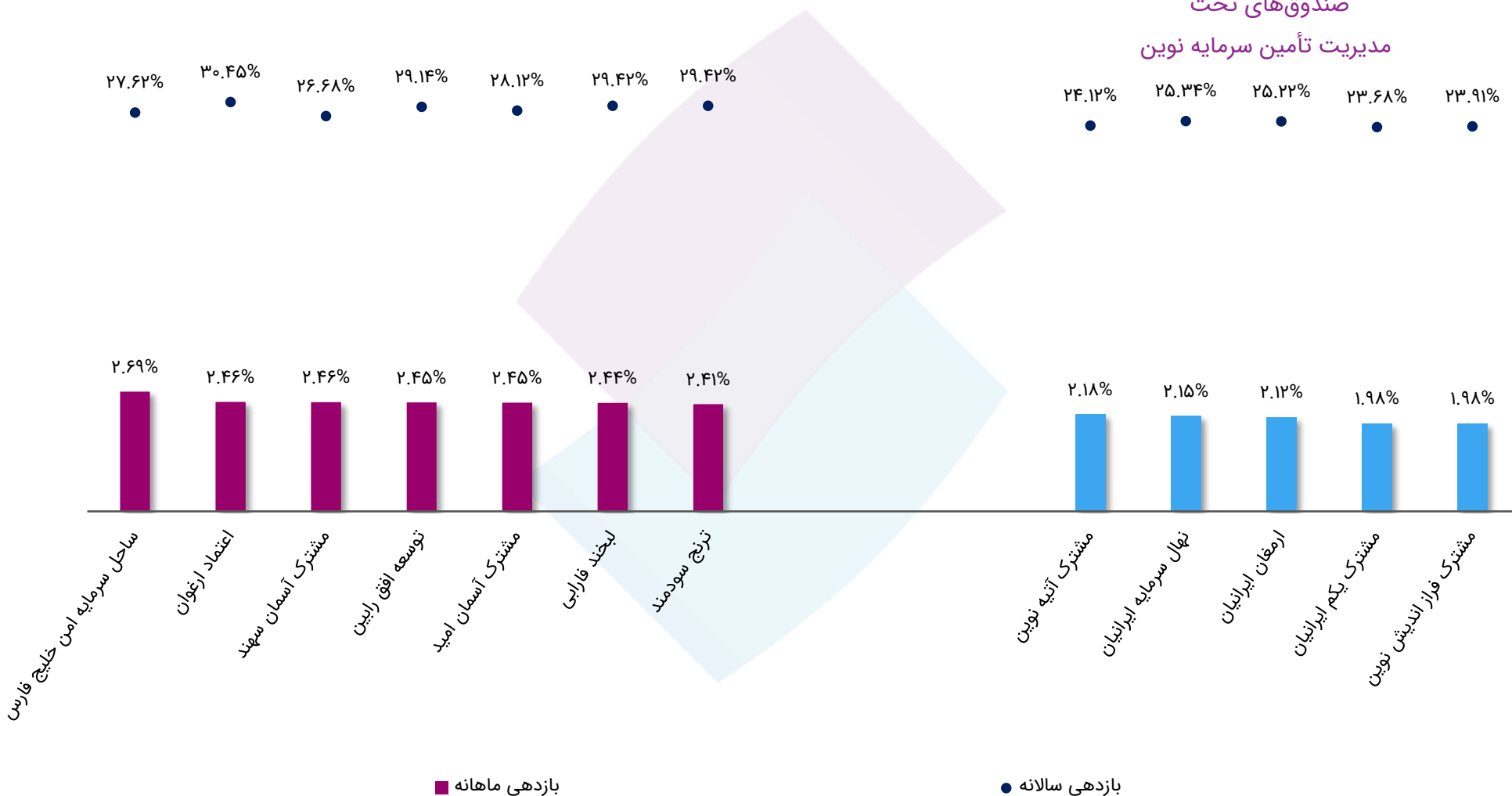


## بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

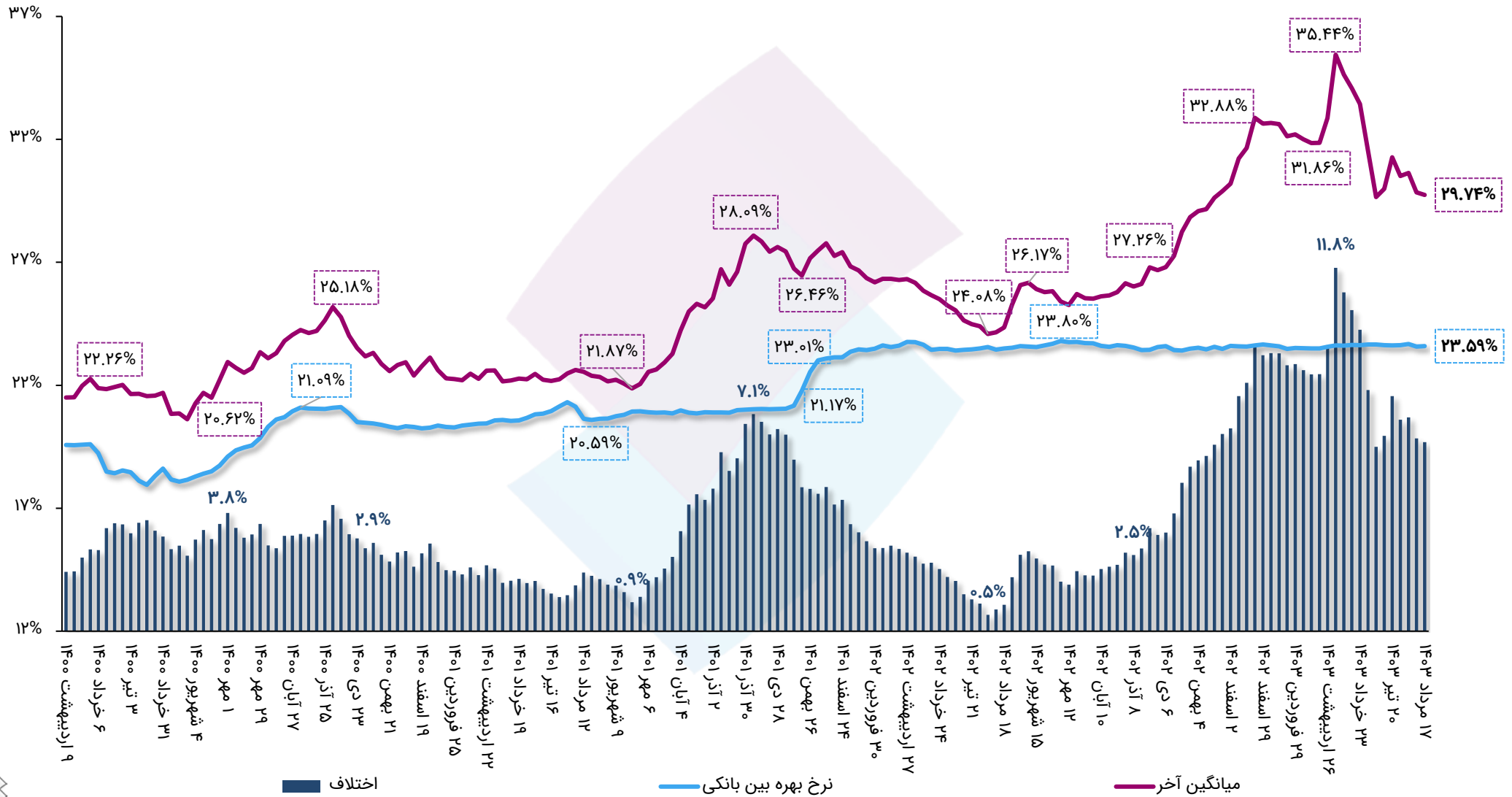


# صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

## صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین

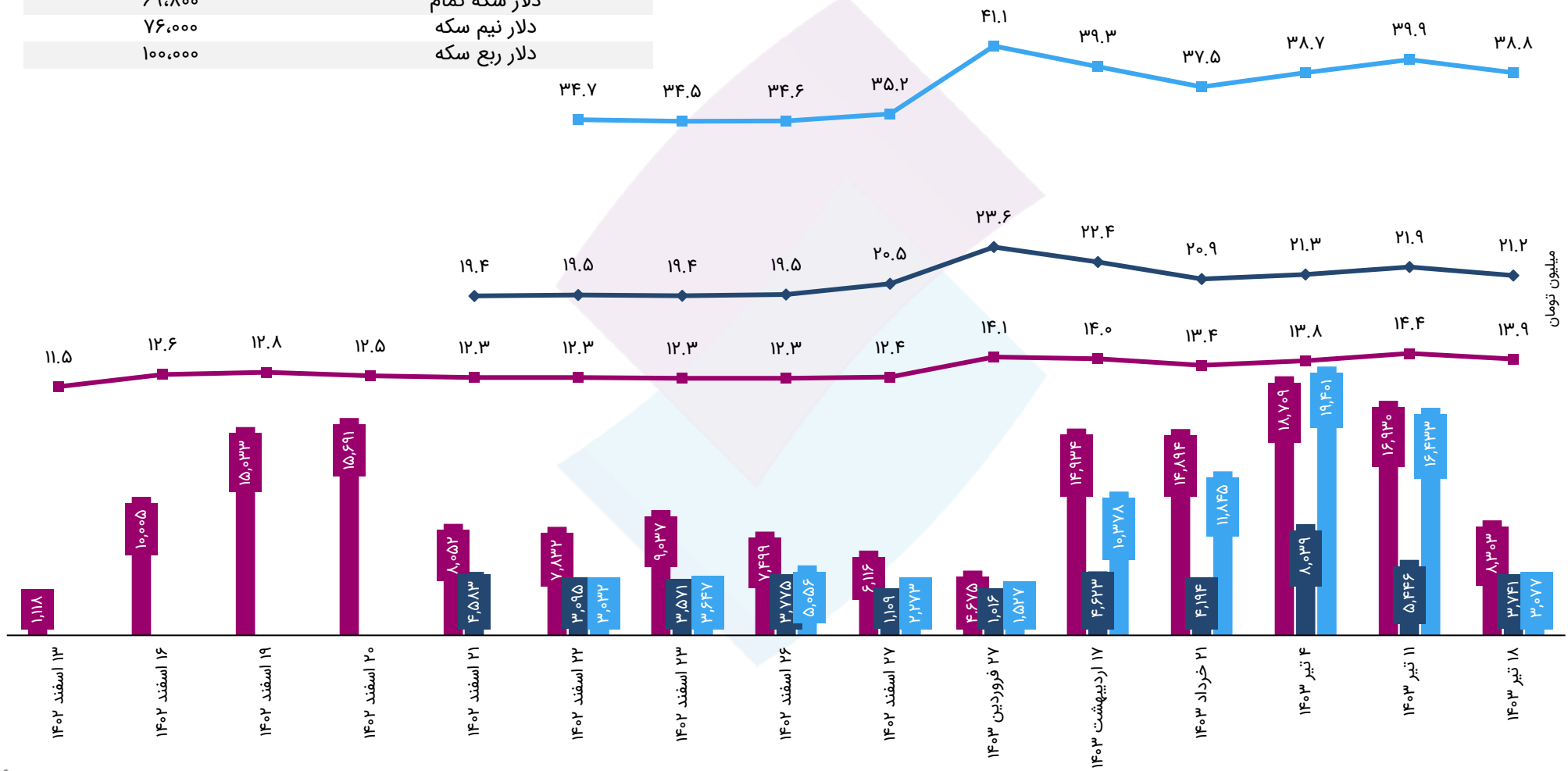


افزایش ۰.۰۲ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۵۹ درصد و اجرای پانزدهمین حراج اوراق مالی اسلامی دولتی به ارزش ۳.۷ همت



## معامله ۲۷۸ هزار و ۶۸۹ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

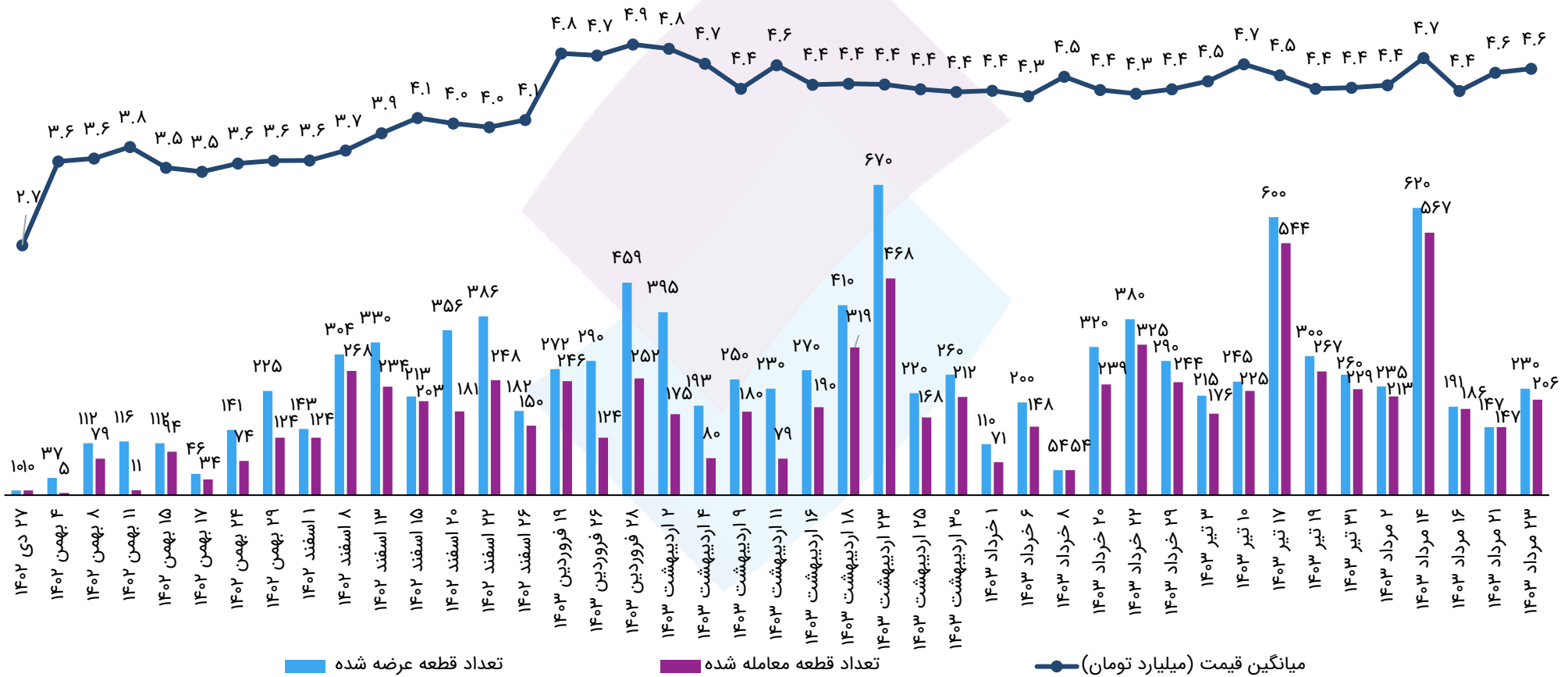
آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۶,۳۶۲
دلار سکه تمام	۶۹,۸۰۰
دلار نیم سکه	۷۶,۰۰۰
دلار ربع سکه	۱۰۰,۰۰۰



میلیون تومان

# معامله ۷ هزار و ۶۳۴ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۸,۸۵۷
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۵۸,۰۰۰



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

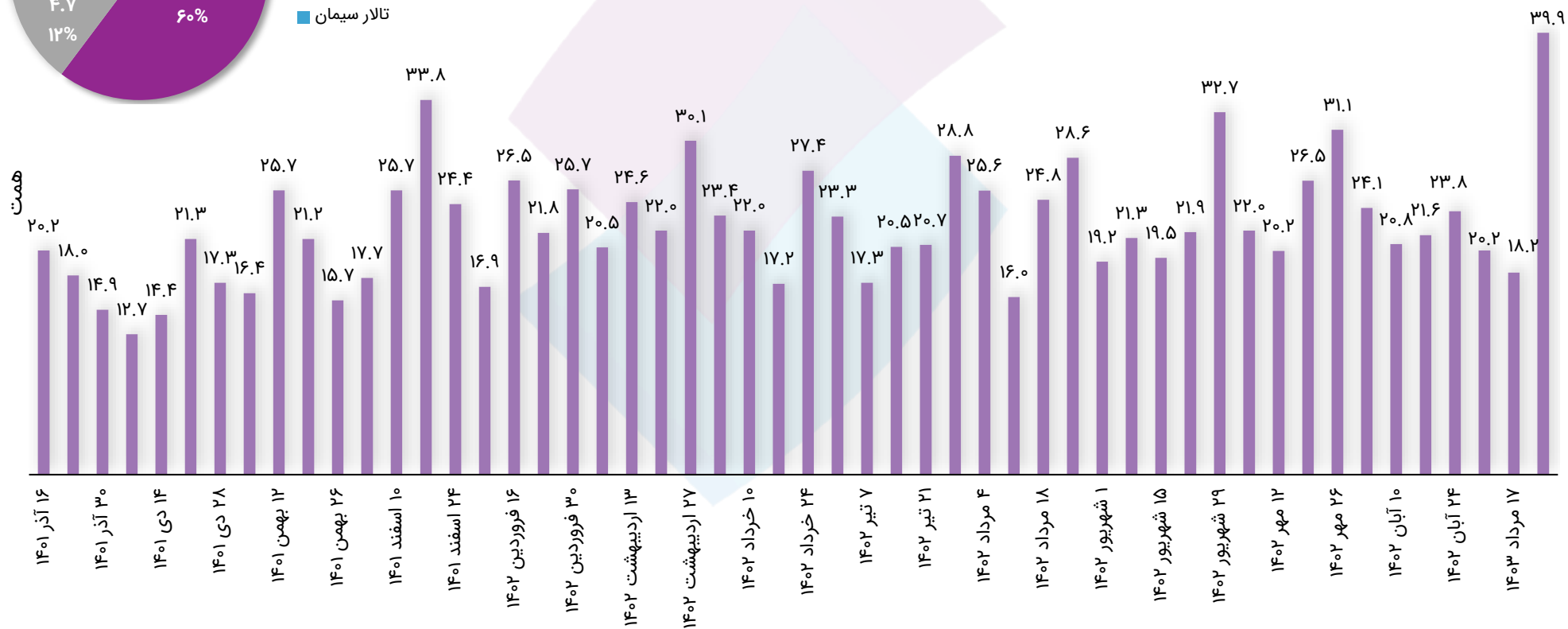
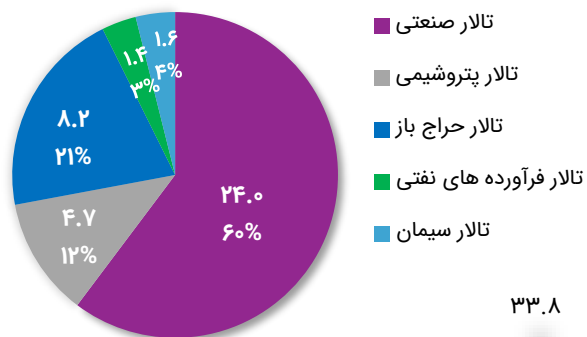
## افزایش ۴.۸ درصدی قیمت روی در پی کاهش ذخایر آن در انبارهای بورس فلزات لندن

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۰.۱%	۱,۹۰۲	۲.۲%	۲,۴۲۲	۳.۸%	۲,۳۸۵	۲,۴۷۵	طلا (دلار/انس)
۴۸.۰%	۲۷۹,۳۴۰	۲.۲%	۴۰۴,۴۶۰	-۳.۸%	۴۲۹,۵۴۰	۴۱۳,۴۰۰	سکه (هزار ریال)
۱۸.۷%	۴۱۳,۲۳۸	۵.۰%	۴۶۶,۹۶۹	۱.۱%	۴۸۴,۹۶۶	۴۹۰,۵۳۹	دلار اسکناس (ریال)
۱۹.۸%	۳۷۵,۶۷۱	۳.۲%	۴۳۶,۰۱۲	۱.۱%	۴۴۴,۹۲۳	۴۵۰,۰۳۶	دلار حواله (ریال)
-۴.۹%	۸۵	-۴.۶%	۸۵	۳.۰%	۷۹	۸۱	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۰۸.۷%	۲۹,۱۷۰	-۶.۲%	۶۴,۸۷۰	۱۰.۶%	۵۵,۰۲۷	۶۰,۸۷۶	بیت کوین (دلار)
۸.۷%	۸,۱۲۶	-۸.۸%	۹,۶۷۹	۱.۷%	۸,۶۸۴	۸,۸۳۱	مس LME (دلار/تن)
۱۴.۱%	۲,۳۱۱	-۹.۲%	۲,۹۰۳	۴.۸%	۲,۵۱۵	۲,۶۳۶	روی LME (دلار/تن)
۸.۶%	۴۴۲	-۳.۷%	۴۹۸	-۰.۲%	۴۸۱	۴۸۰	بیلت CIS (دلار/تن)
-۲.۱%	۴۸۰	-۲.۱%	۴۸۰	۰.۰%	۴۷۰	۴۷۰	بیلت ایران (دلار/تن)
۷.۹%	۲۶۶	-۲.۷%	۲۹۵	-۰.۷%	۲۸۹	۲۸۷	متانول CFR (\$/mt)
-۱۸.۲%	۴۰۳	۰.۹%	۳۲۷	-۰.۹%	۳۳۳	۳۳۰	سید اوره (mt/\$)
-۱۸.۵%	۲.۶۵	۱.۹%	۲.۱۲	۲.۴%	۲.۱۱	۲.۱۶	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)



## روند ارزش معاملات بورس کالا

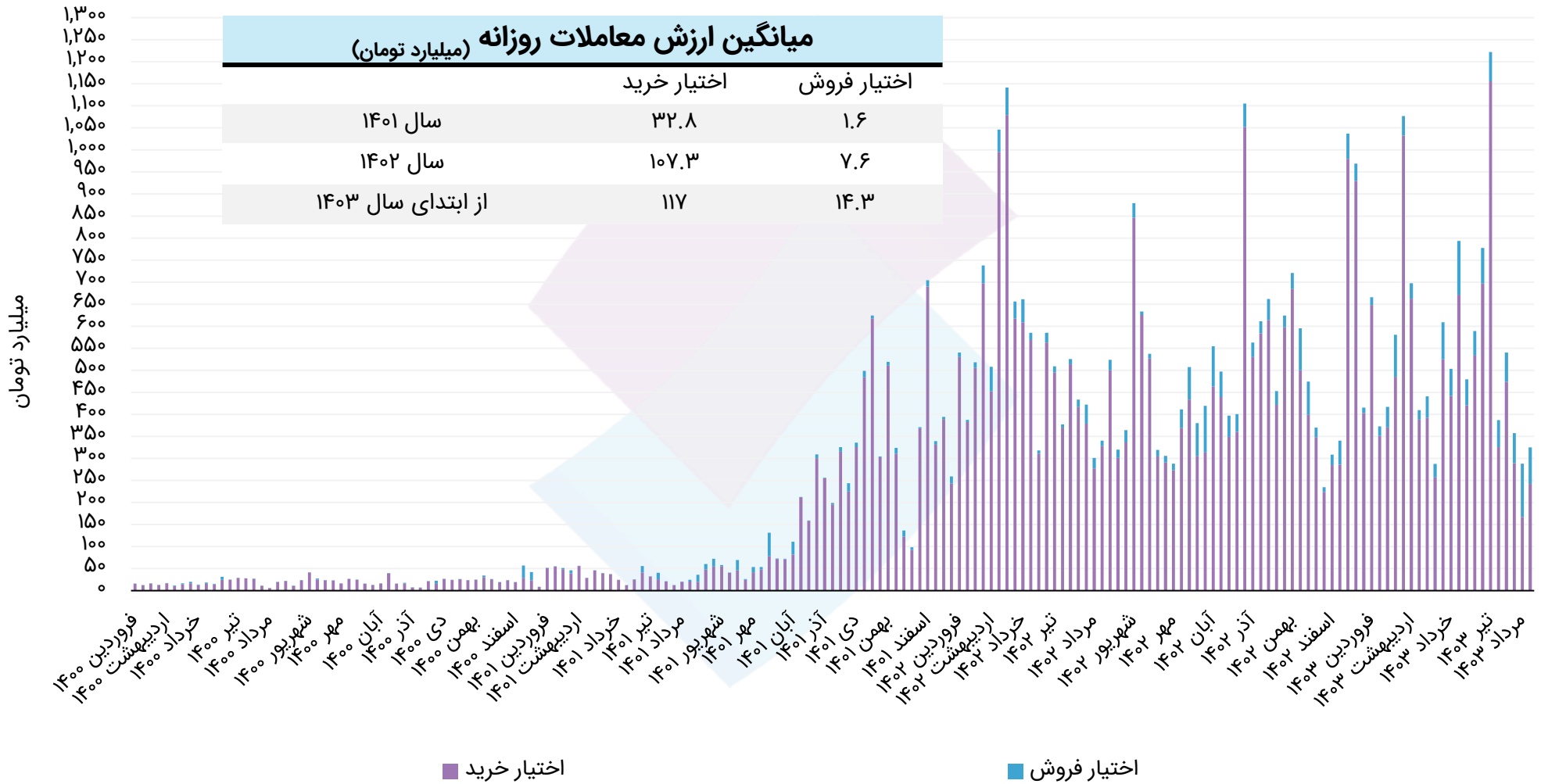
سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)



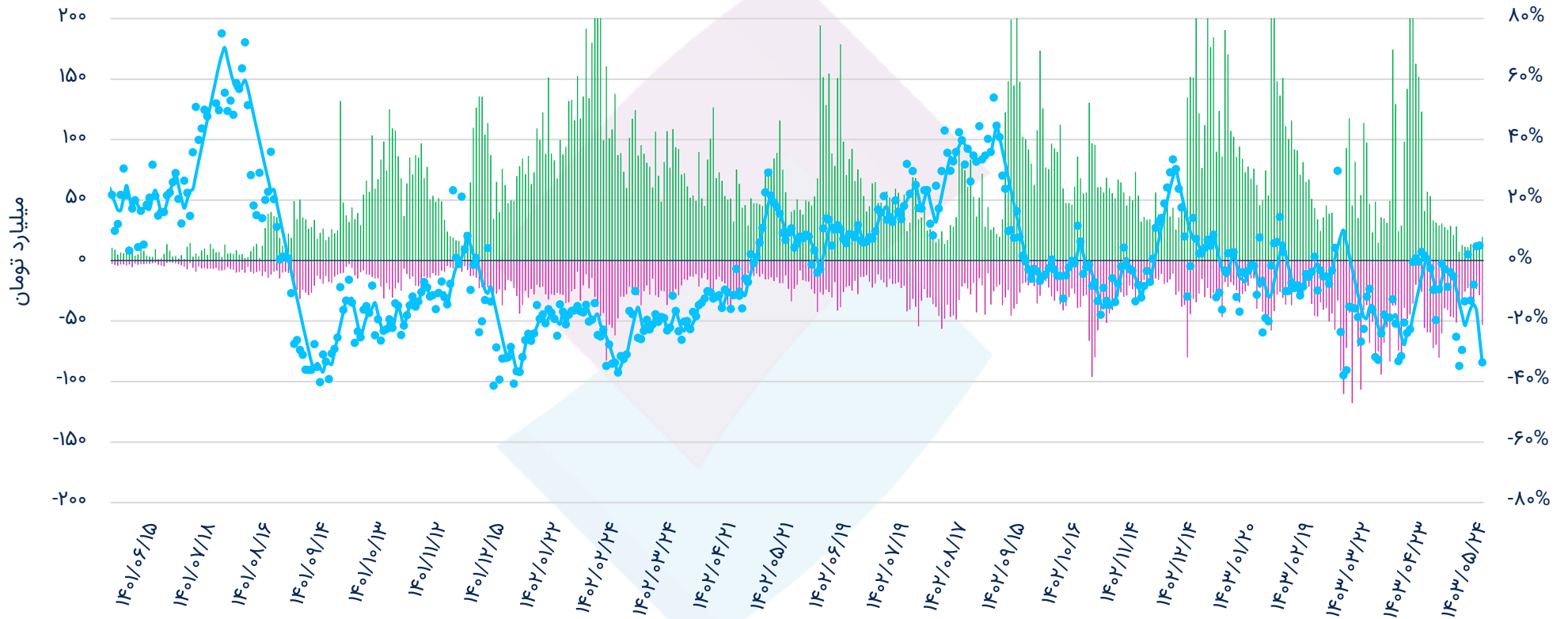
## کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات (تن)	عرضه کننده
ورق گرم	۳۱.۷	۳۴۲,۱۱۰	فولاد مبارکه اصفهان، نورد و تولید قطعات فولادی، فولاد اکسین خوزستان
وکیوم باتوم	۱۴.۴	۲۶۸,۵۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت امام خمینی (ره) شازند، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز
آهن اسفنجی	۱۲.۱	۱۷۲,۰۰۰	فولاد کاوه جنوب کیش، صنعت فولاد شادگان، فولاد خوزستان، توسعه آهن و فولاد گل گهر، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، پارس فولاد سبزواری، احیاء استیل فولاد بافت، فولاد غدیر نی ریز، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، جهان فولاد سیرجان
ورق سرد	۳۷.۶	۵۲,۳۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، صنایع هفت الماس، فولاد غرب آسیا، فولاد امیرکبیر کاشان
شمش بلوم	۲۲.۶	۸۶,۵۲۰	صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، آهن و فولاد ارفع، فولاد خوزستان، فولاد سیرجان ایرانیان، جهان فولاد سیرجان، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد آلیاژی ایران، غلتک سازان سپاهان، شرکت فولاد زرنده ایرانیان
گندله سنگ آهن	۵.۲	۳۷۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، توسعه معدنی و صنعتی صابنور، سنگ آهن مرکزی ایران
میلگرد	۲۶.۲	۷۲,۱۴۹	جهان فولاد سیرجان، ذوب آهن اصفهان، مجتمع فولاد خراسان، صنایع آهن و فولاد سرمد ابرکوه، فولاد شاهرود، نورد میلگرد کاسپین، صنایع نورد میلاد یزد، فولاد آلیاژی ایران، فولاد کاوه ارونده، فولاد آذربایجان، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب
تیرآهن	۲۶.۰	۶۴,۴۴۳	ذوب آهن اصفهان، نورد آریان فولاد
سیمان	۱.۴	۱,۱۰۳,۴۹۵	سیمان آبیگ، سیمان ساوه، سیمان تهران، سیمان صوفیان، سیمان مازندران، سیمان آرتا اردبیل، سیمان هگمتان، سیمان سپاهان، سیمان هرمزگان، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان نیاز قم، سیمان فراز فیروزکوه، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان عمران انارک، سیمان ارومیه، سیمان فیروزکوه، سیمان خزر، سیمان شرق، سیمان اردستان، صنایع سیمان شهرکرد، سیمان شاهرود، سیمان بجنورد
مس کاتد	۴۸۵.۴	۳,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
خاک روی	۱۰.۳	۱۱۸,۰۰۰	مجتمع سرب و روی انگوران
لوب کات	۲۲.۵	۵۰,۰۰۰	پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس
کنسانتره سنگ آهن	۳.۷	۲۳۵,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، بین‌المللی اسم ایران
پلی پروپیلن نساجی	۴۹.۳	۱۲,۵۷۷	پتروشیمی مارون، پتروشیمی شازند، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)، پتروشیمی رجال، پتروشیمی پلی نار، نوید زرشیمی
شمش آلومینیوم	۱۴۰.۷	۴,۲۷۵	آلومینیوم ایران (ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم مهدی، آلومینای ایران

## روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



## شاخص فاصله تا ارزش ذاتی<sup>(۱)</sup> - اختیار خرید



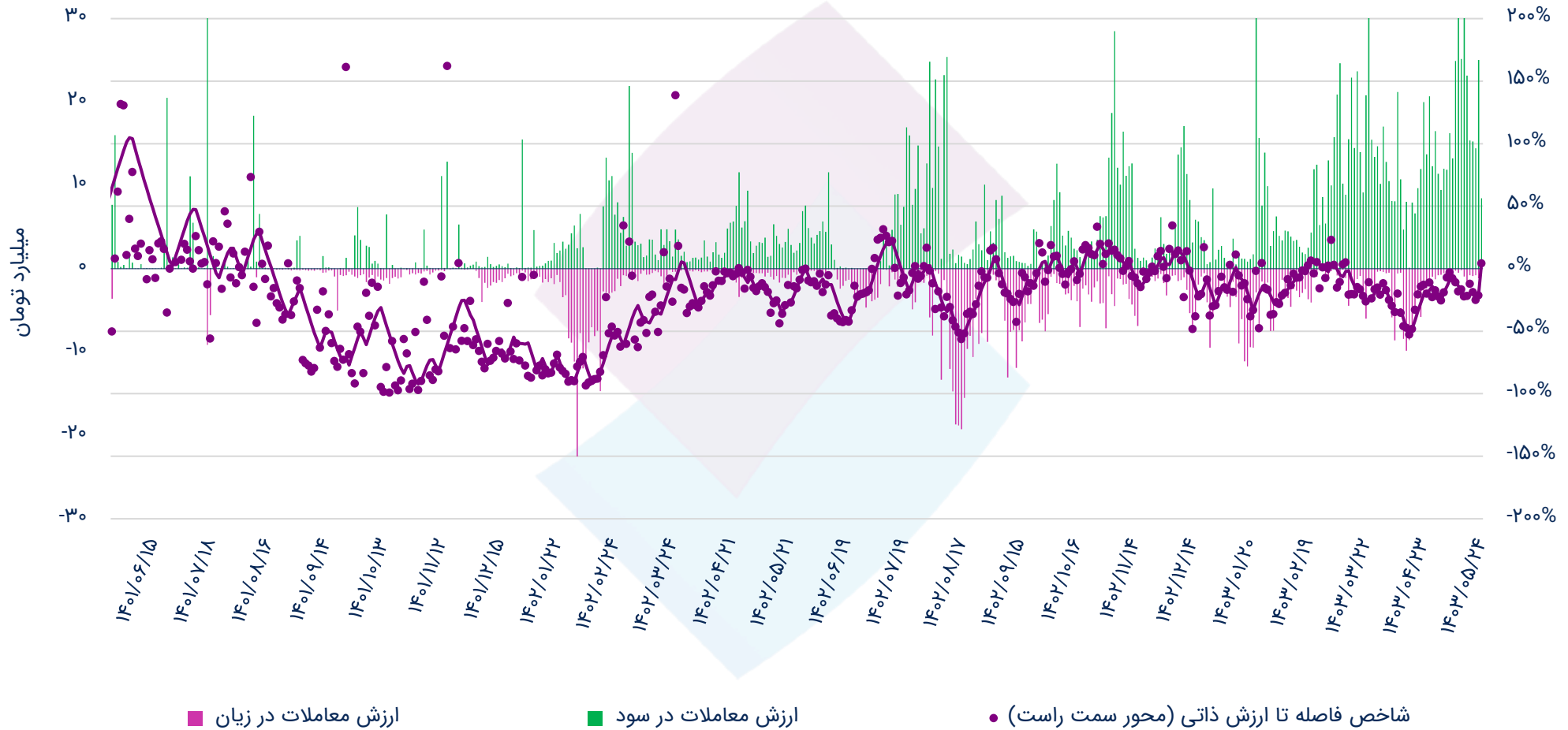
● شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (محور سمت راست)      ■ ارزش معاملات در سود      ■ ارزش معاملات در زیان

(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<sup>(۱)</sup> - اختیار فروش

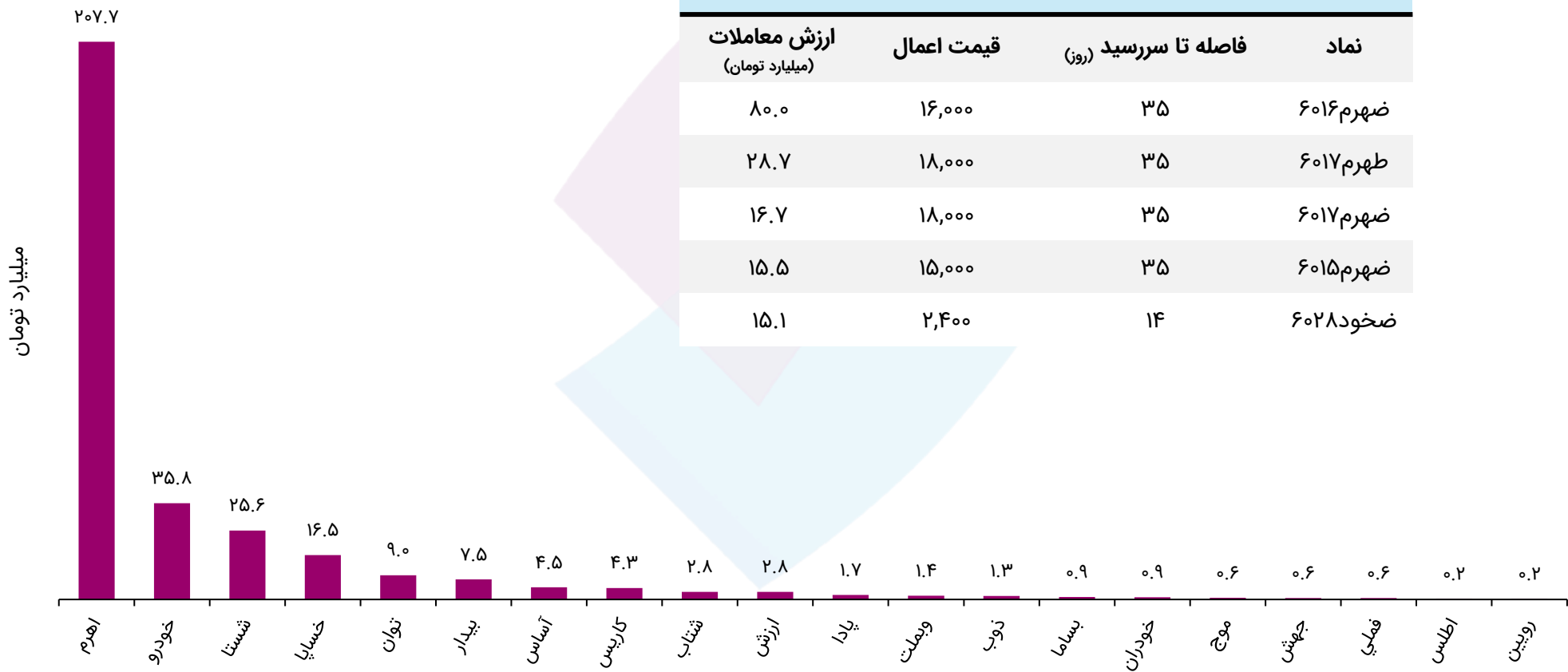


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).  
 (۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه  
 (۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

## 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 ۶۰۱۶	۳۵	۱۶,۰۰۰	۸۰.۰
طهرم ۶۰۱۷	۳۵	۱۸,۰۰۰	۲۸.۷
ضهرم ۶۰۱۷	۳۵	۱۸,۰۰۰	۱۶.۷
ضهرم ۶۰۱۵	۳۵	۱۵,۰۰۰	۱۵.۵
ضخود ۶۰۲۸	۱۴	۲,۴۰۰	۱۵.۱



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 هر بار گردش اعتبار
- ◆ اعطای اعتبار رایگان با حداقل ۱۴ بار گردش اعتبار در ماه

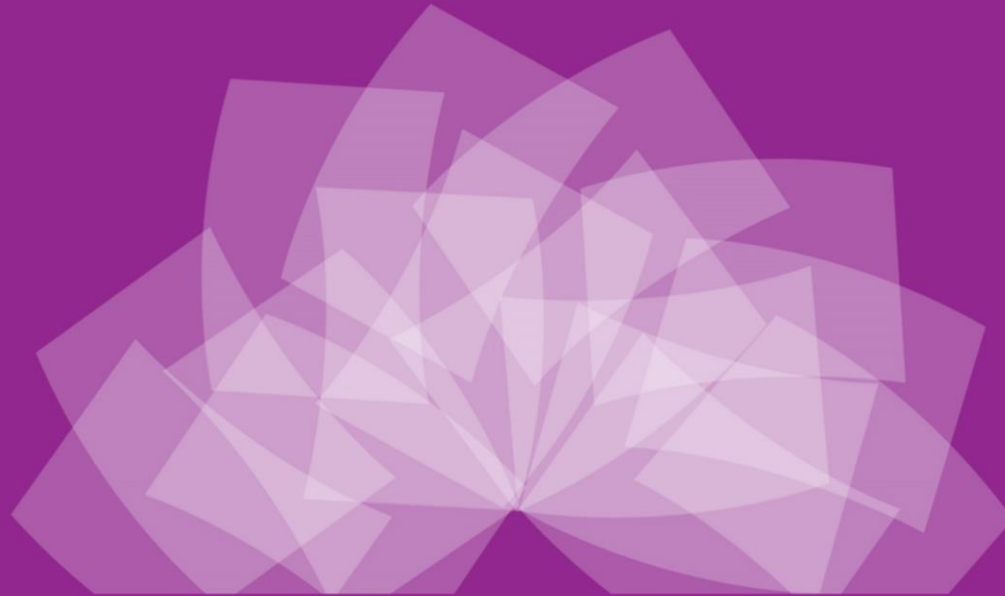




## سلب مسئولیت

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](http://www.nibb.ir)

✉ [info@nibb.ir](mailto: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)