

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 ۱۳ شهریور - شماره ۱۶۶

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



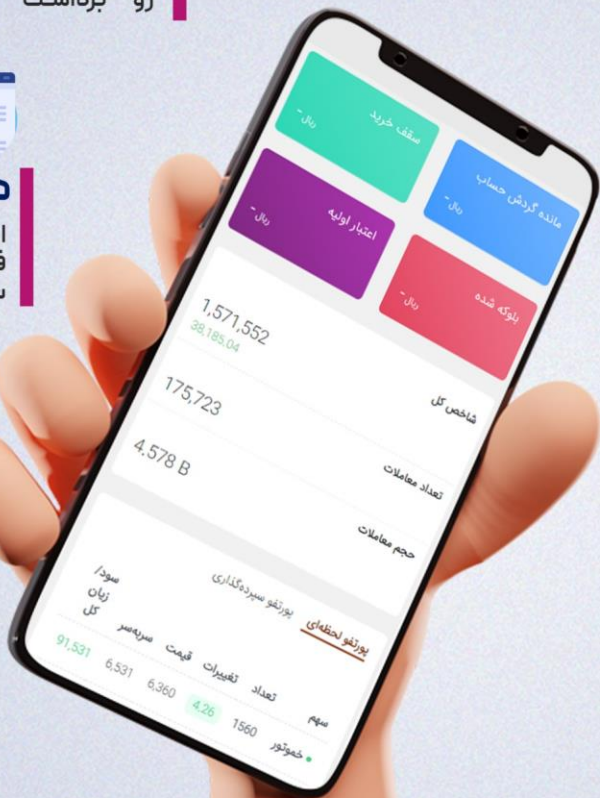
## برداشت وجه آئی

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

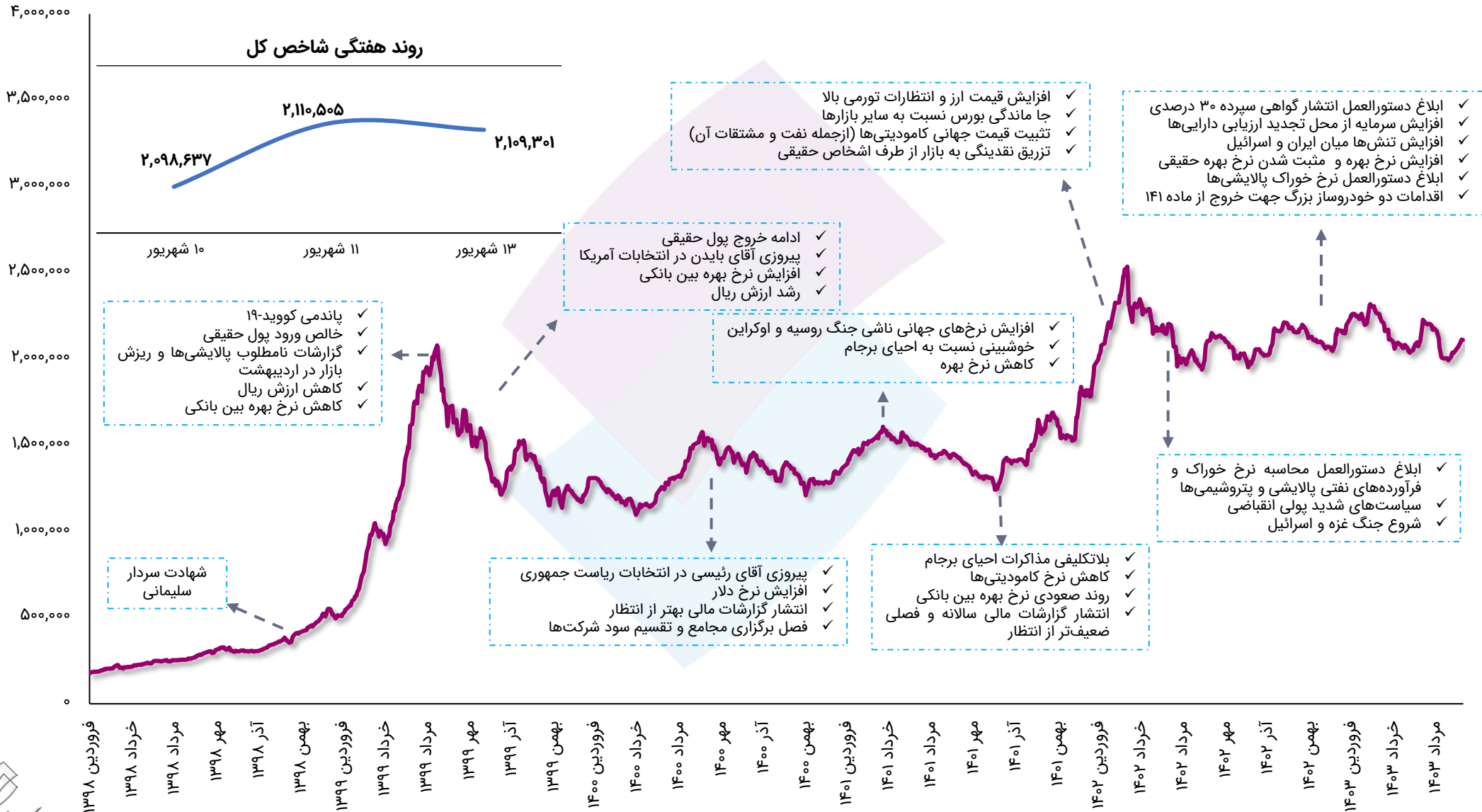
My.Nibb.ir

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

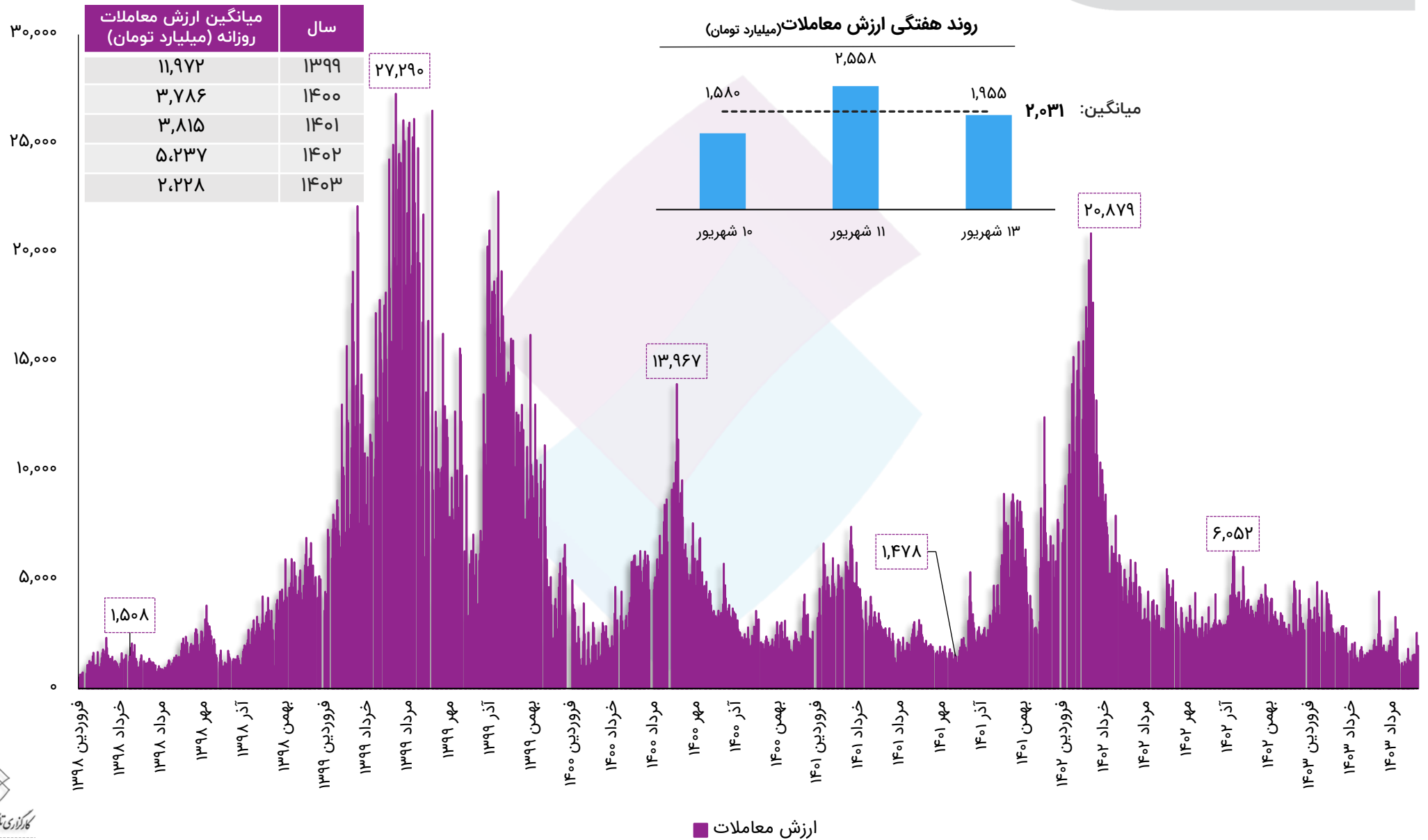


وضعیت بازار سرمایه  
در هفته‌ای که گذشت.

## رشد ۱.۶ درصدی شاخص کل در هفته جاری

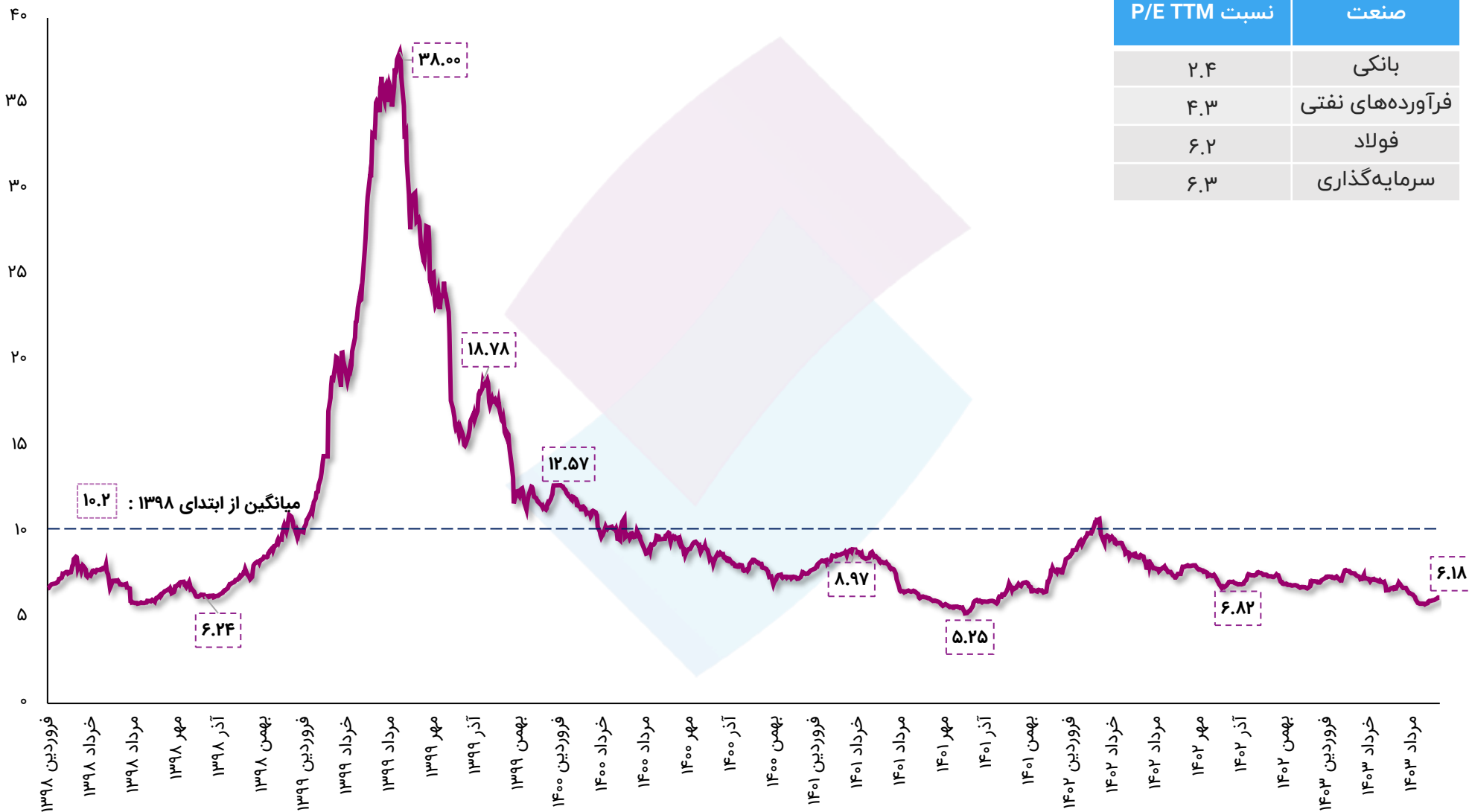


## ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران



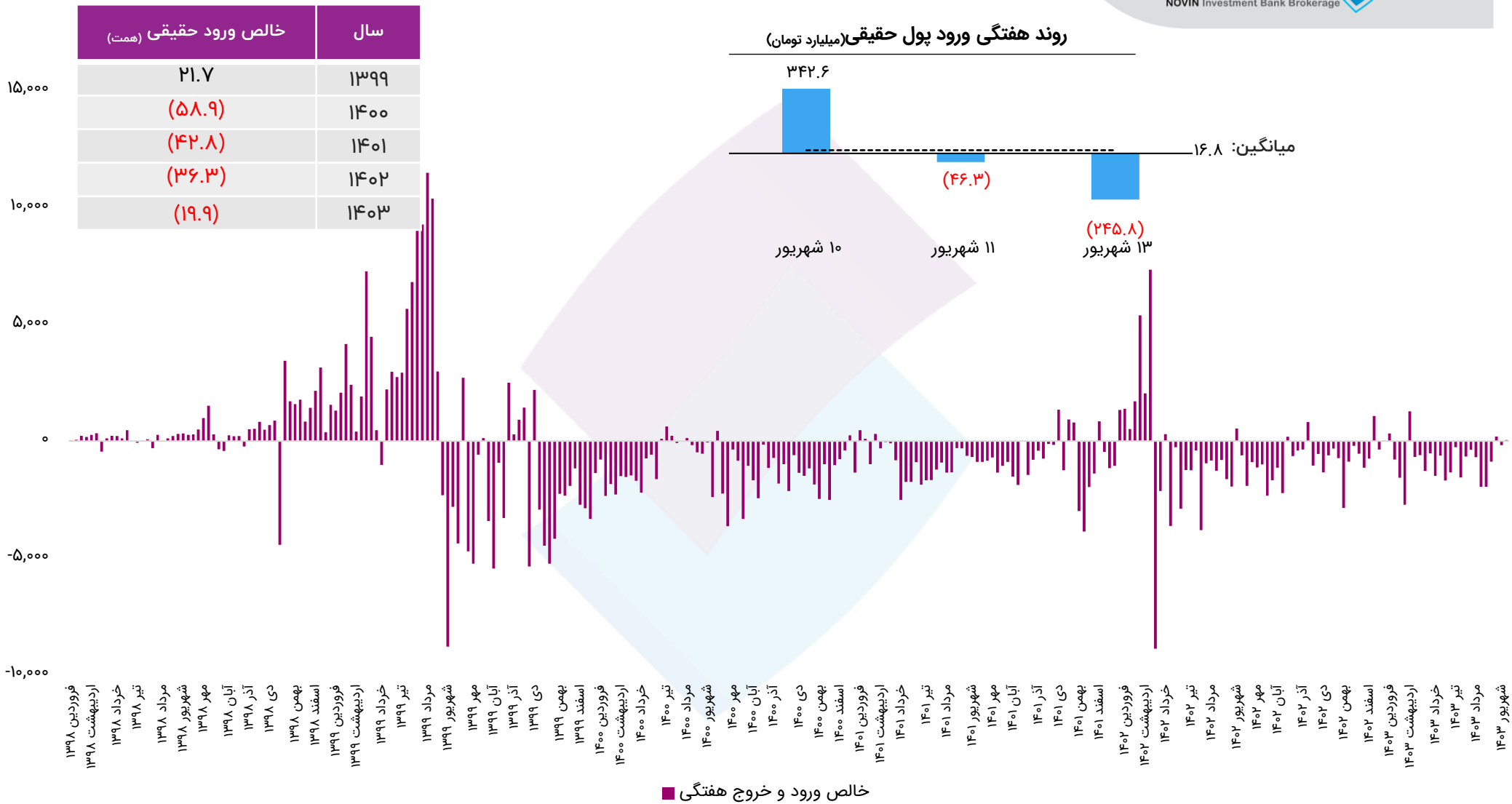


# نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



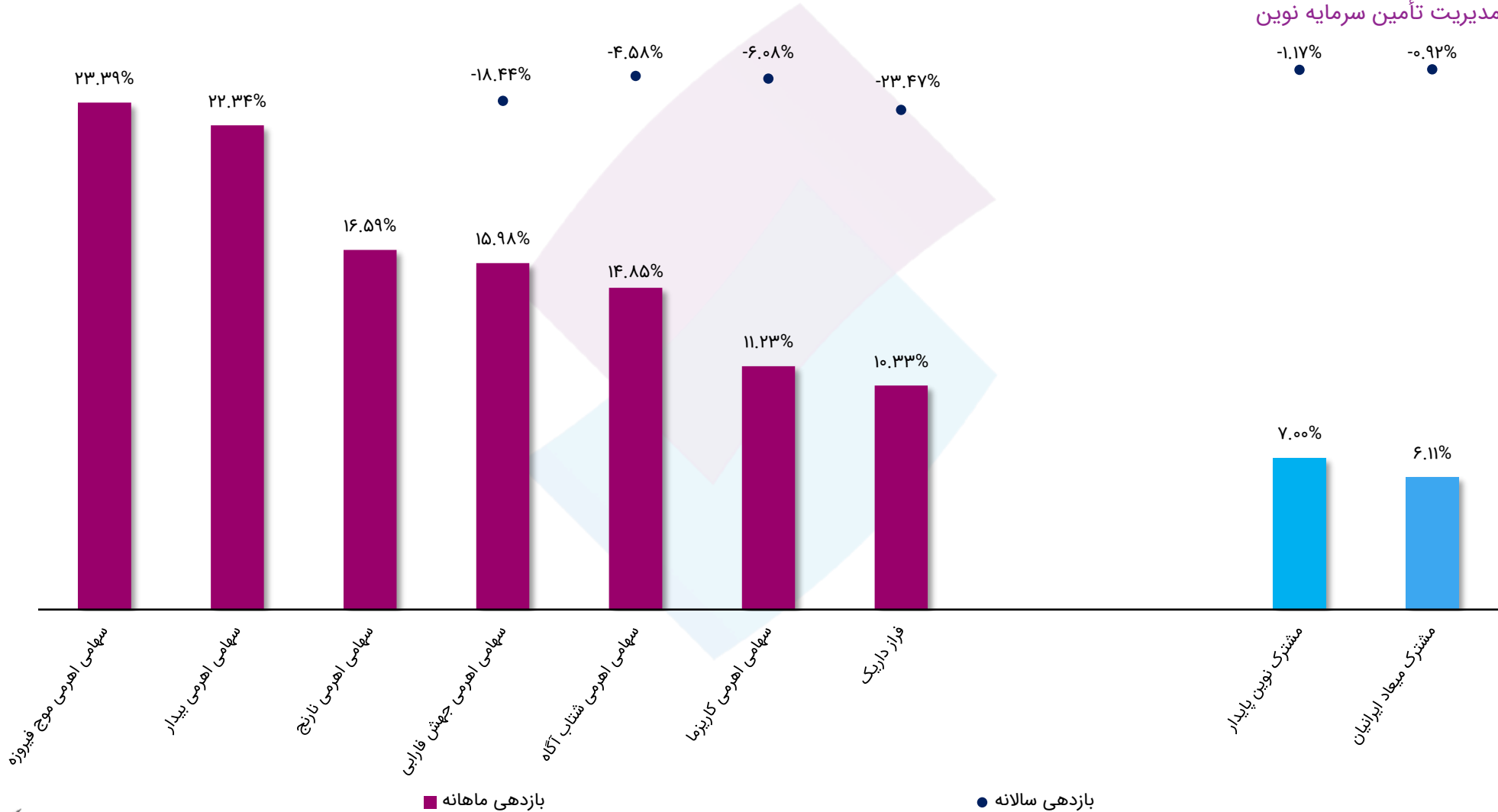
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۴	بانکی
۴.۳	فرآورده‌های نفتی
۶.۲	فولاد
۶.۳	سرمایه‌گذاری

## ۵۱ میلیارد تومان خالص ورود پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱۶۸ میلیارد تومانی هفته گذشته

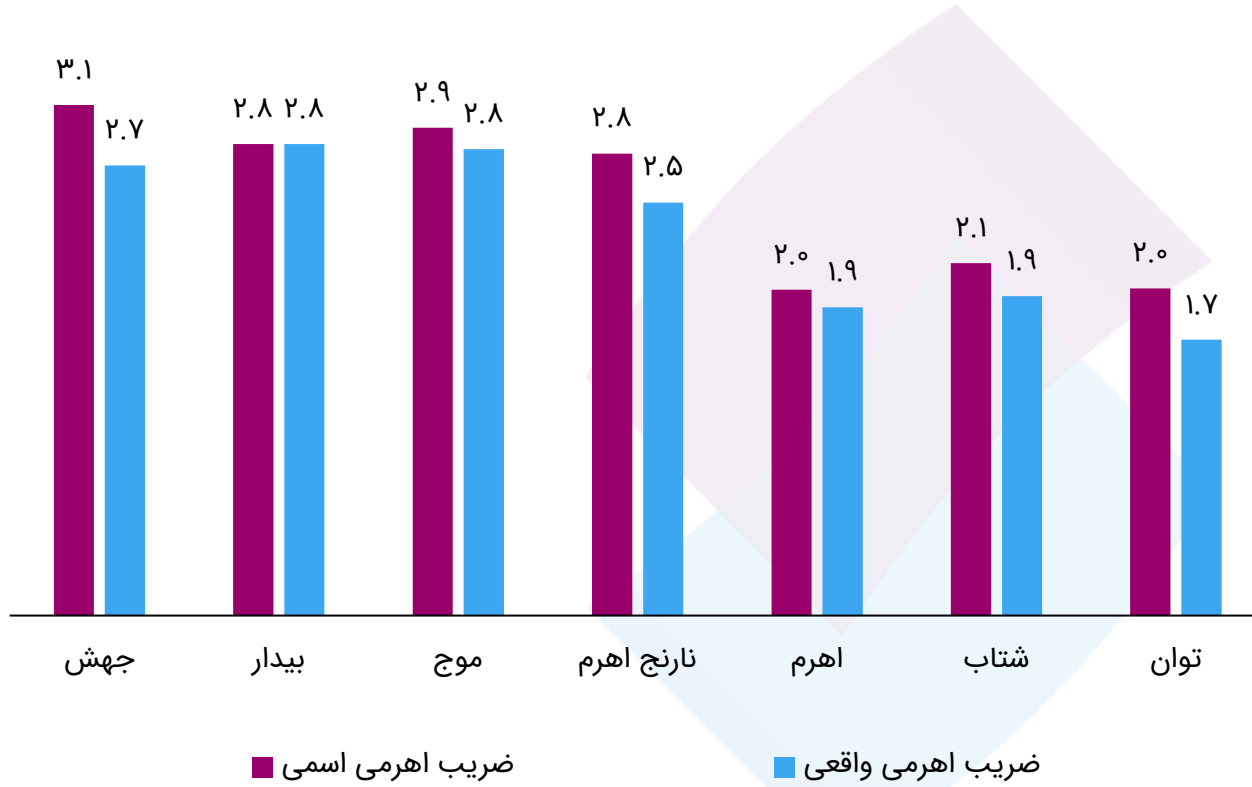


## صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

### صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



# صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب
اهرم	۱%
توان	۰%
موج	-۱%
نارنج اهرم	-۱%
جهش	-۲%
بیدار	-۲%
شتاب	-۳%

نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
موج	۲۴%	۳%
بیدار	۱۹%	۳%
شتاب	۱۹%	۲%
توان	۱۶%	۲%
نارنج اهرم	۱۴%	۳%
جهش	۱۴%	۳%
اهرم	۹%	۳%

حباب = قیمت پایانی تابو/NAV ابطال - ۱  
 بازده ماهانه = قیمت پایانی آخرین روز معاملاتی ماه / قیمت پایانی ۳۰ روز گذشته - ۱  
 بازده ماهانه واحد عادی = NAV/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

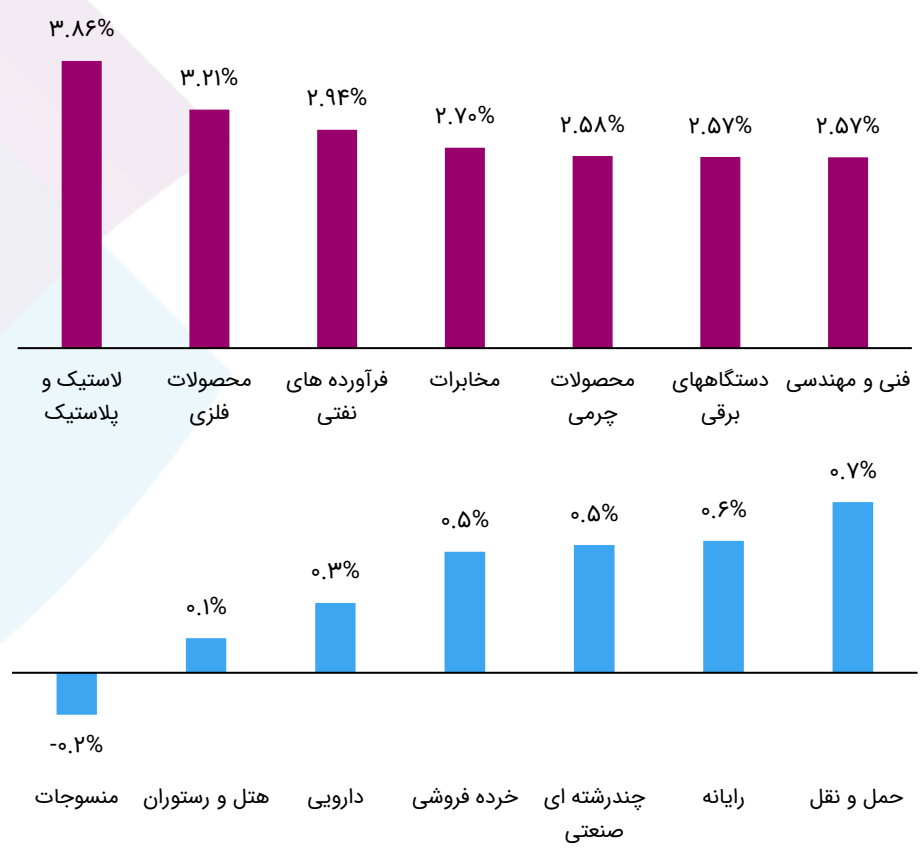
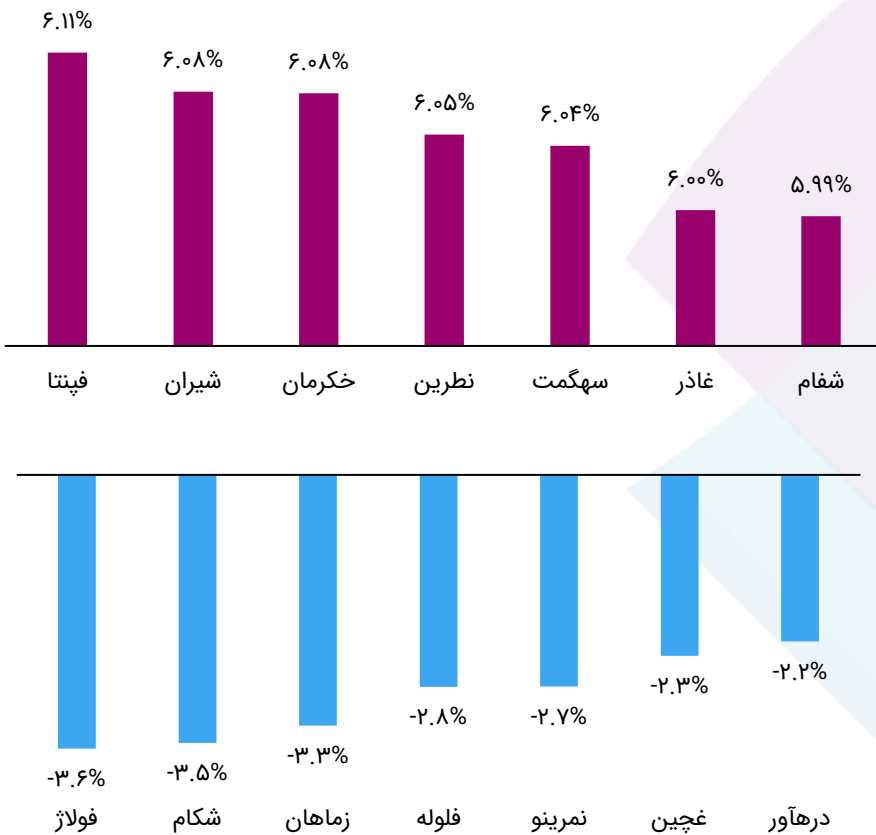


### نماد



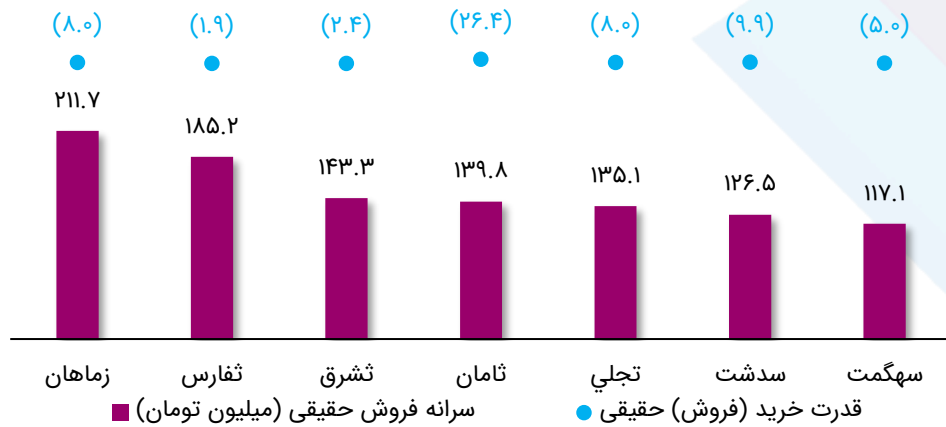
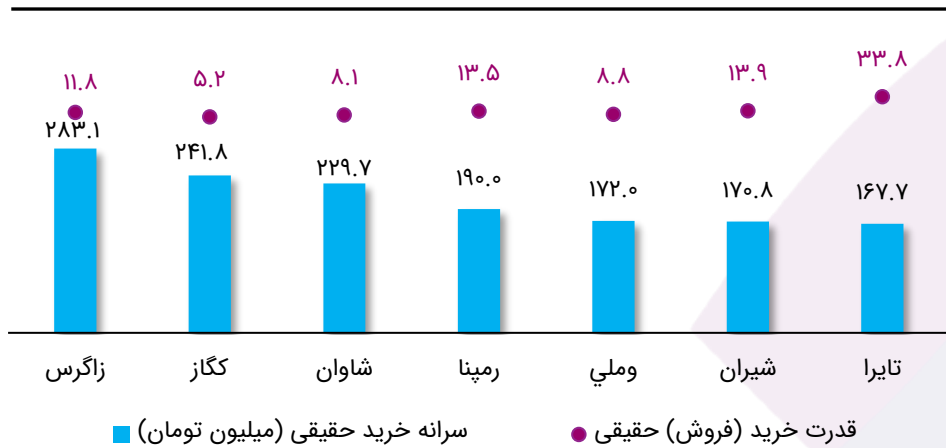
نماد

صنعت

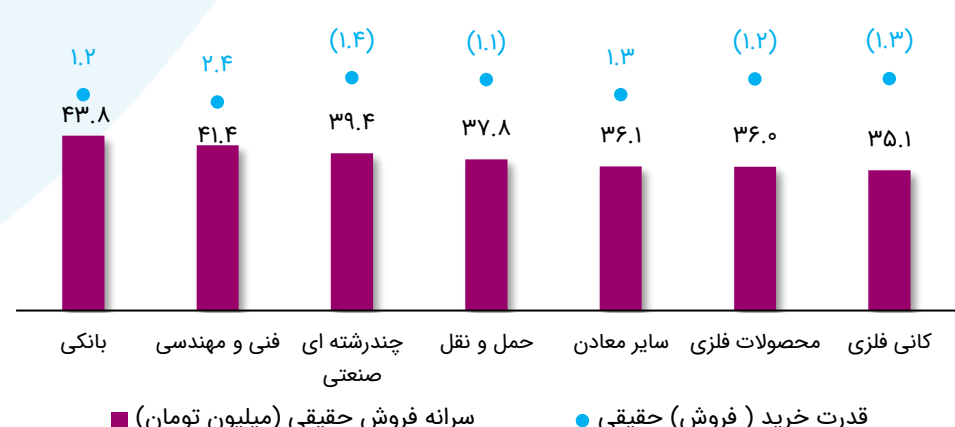
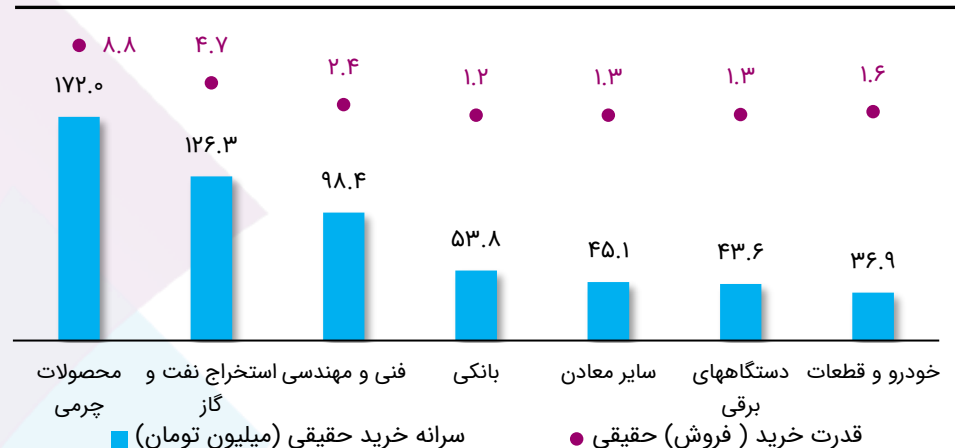


## بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

### نماد



### صنعت



## گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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

تامین بخشی از مخارج پروژه توسعه کارخانه و جلوگیری از خروج نقدینگی	پسهند	سودانباشته	۱۴۶%	۸۶	۳۵
جبران مخارج سرمایه ای انجام شده جهت انتقال کامل کارخانه به شهرک شکوهیه قم و اصلاح ساختار مالی	نمرینو	سودانباشته	۲۷۵%	۱۵۰	۴۰
اصلاح ساختار مالی	فولای	سودانباشته	۵۰%	۲۴۰	۱۶۰

### آگهی ثبت افزایش سرمایه

جبران مخارج انجام شده بابت تحصیل سرمایه‌گذارها، مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر و مشارکت در افزایش سرمایه در حال انجام شرکت‌های سرمایه‌پذیر	تجلی	آورده نقدی	۳۲%	۸,۲۰۰	۶,۲۰۰
جبران مخارج انجام شده طرح توسعه یزد یک و اجرای طرح توسعه نورد وایر	فولاژ	آورده نقدی (۷۹%) سودانباشته (۲۱%)	۱۴۲%	۵,۸۰۰	۲,۴۰۰
اصلاح ساختار مالی	تیمپی	سودانباشته	۲۰۰%	۶۶۰	۲۲۰
اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالاهای ایرانی	اتکاسا	تجدیدارزیابی	۱۰۰%	۵۰۰	۲۵۰
جبران مخارج انجام شده بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت‌های سرمایه‌پذیر	وغدیر	سودانباشته (۵۸%) اندوخته (۴۲%)	۲۰۰%	۲۱,۶۰۰	۷,۲۰۰



## گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

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

### اعلامیه پذیره نویسی عمومی

مهلته پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۱۱ تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۲۵ است.	وجامی	آورده نقدی	۱۰۰%	۵۰۰	۲۵۰
مهلته پذیره نویسی عمومی از تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۱۳ تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۲۷ است.	ولکار	آورده نقدی (۷۱%) سود انباشته (۲۹%)	۹۳%	۲۹۰	۱۵۰

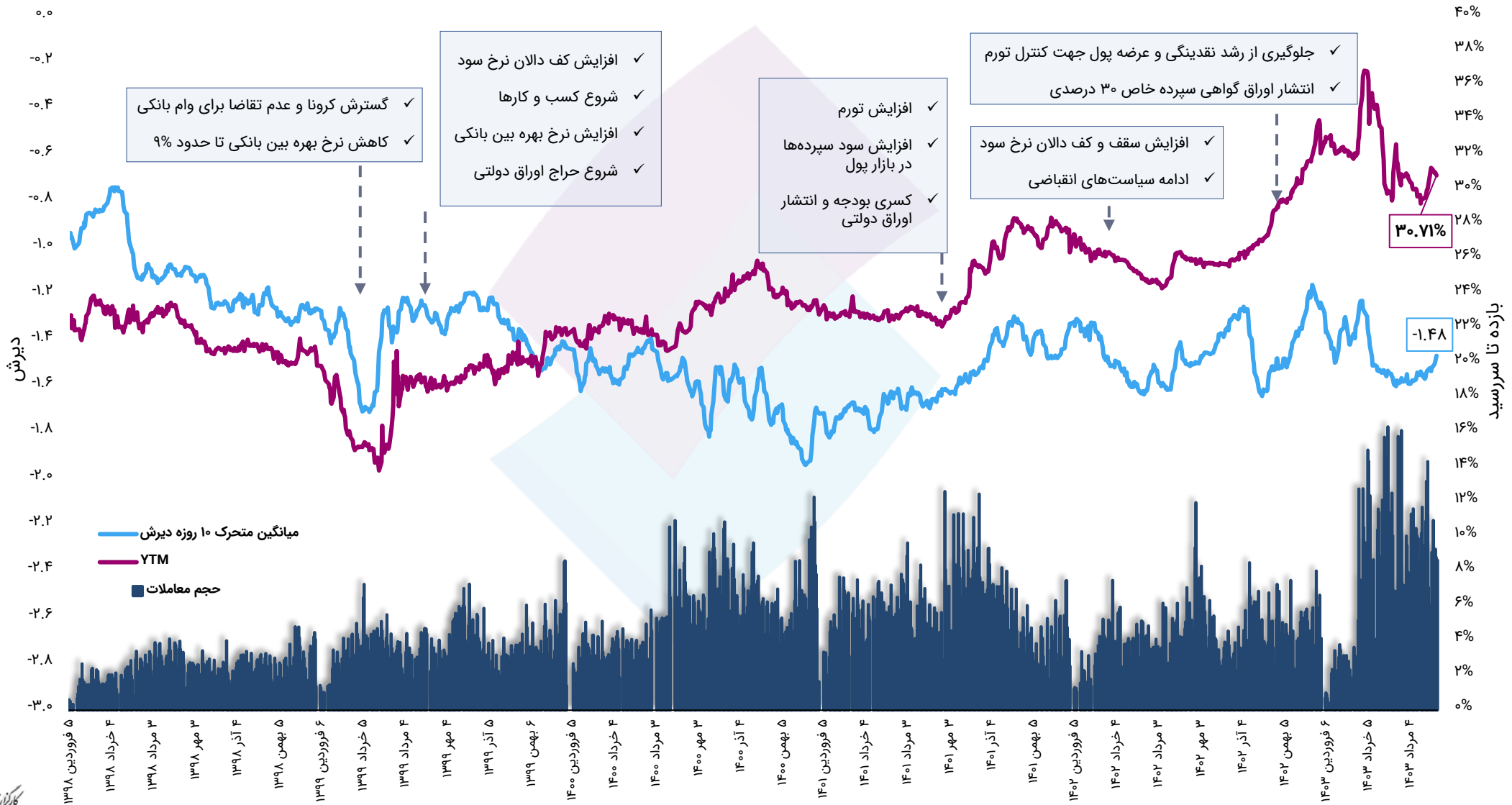
### تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه

اصلاح ساختار مالی در اجرای مفاد ماده ۱۴ قانون حداکثر استفاده از توان تولیدی و خدماتی کشور و حمایت از کالاهای ایرانی	سنیر	تجدید ارزیابی	۱۳۷۶%	۳۴۰	۲۳
اصلاح ساختار مالی و جبران مخارج سرمایه ای	وامیر	سود انباشته	۷۴۰۰%	۶۳۰	۸
جبران مخارج بابت مشارکت در افزایش سرمایه شرکت های زیرمجموعه و تحصیل سرمایه گاری جدید	فافق	سود انباشته (۳۹%) آورده نقدی (۶۱%)	۴۹%	۷۰۰	۴۷۰

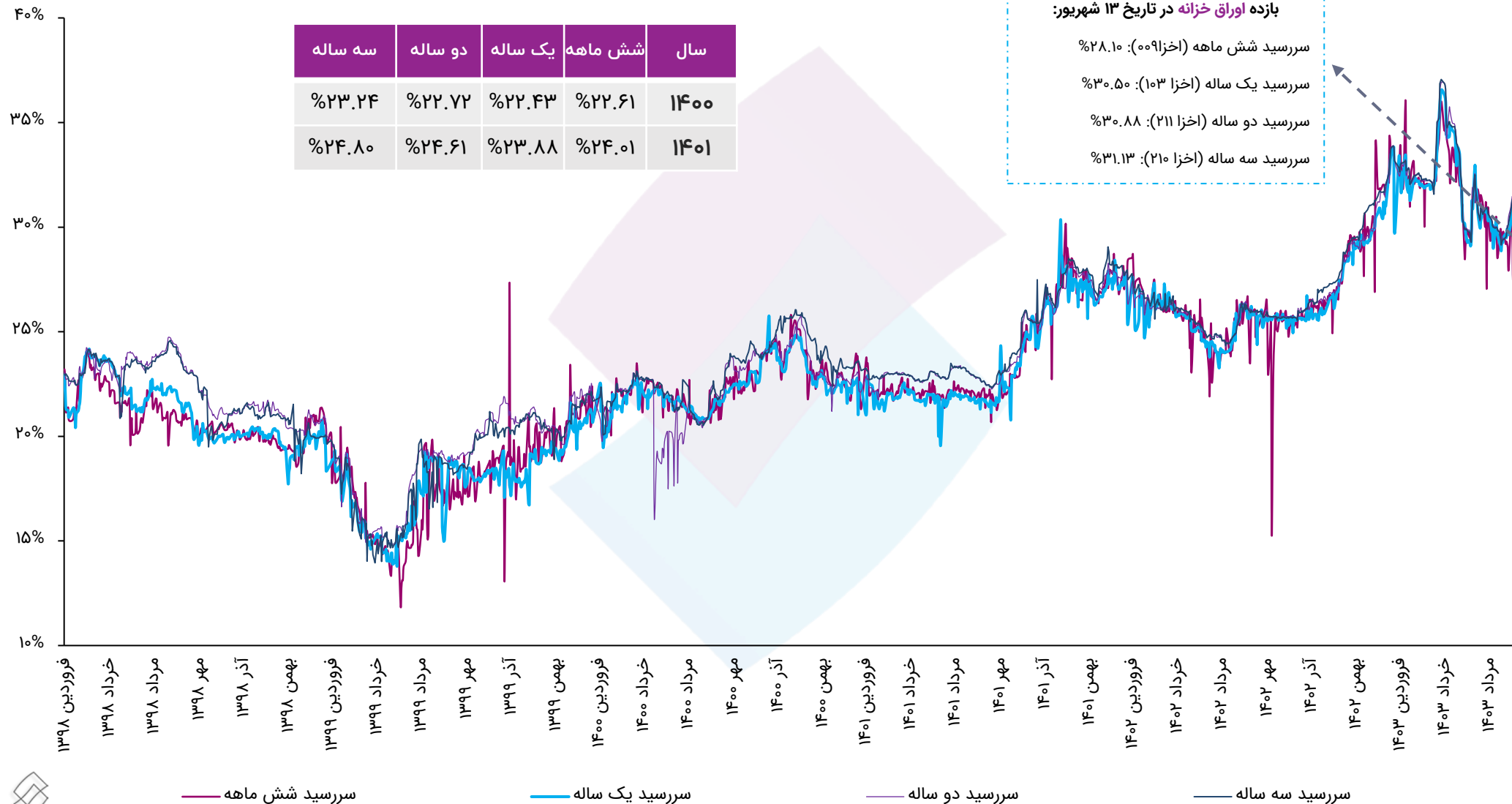
### صدور مجوز افزایش سرمایه

اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد	کیسون	سود انباشته	۳۹%	۲,۸۰۰	۲,۰۱۶
اصلاح ساختار مالی	وطوبی	آورده نقدی (۴۴%) سود انباشته (۵۶%)	۵۰%	۴۵۰	۳۰۰
اصلاح ساختار مالی و جلوگیری از خروج وجه نقد	سشرق	سود انباشته	۸۸%	۵۰۰	۲۶۵
اصلاح ساختار مالی	قرن	سود انباشته	۶۷%	۱,۰۰۰	۶۰۰
تأمین مخارج سرمایه ای مورد نیاز جهت پروژه های زیرساختی و جبران مخارج انجام شده بابت پروژه های زیرساختی	فجهان	سود انباشته	۲۳%	۱۳,۵۰۰	۱۱,۰۰۰
اصلاح ساختار مالی	کرومیت	سود انباشته	۹۰%	۲۹۵	۱۵۵

# کاهش ۰.۳۵ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۰.۷۱ درصد

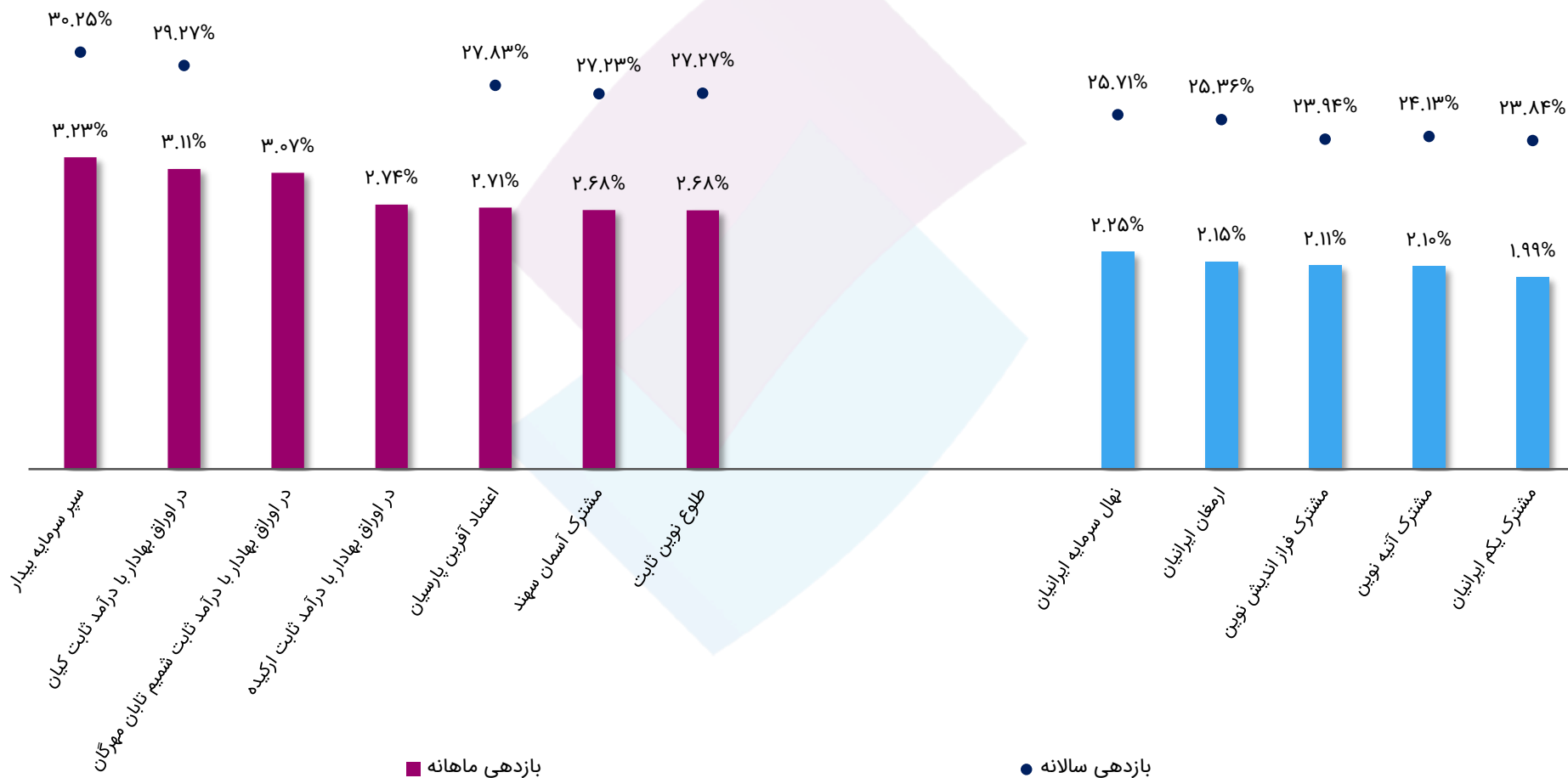


## بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه

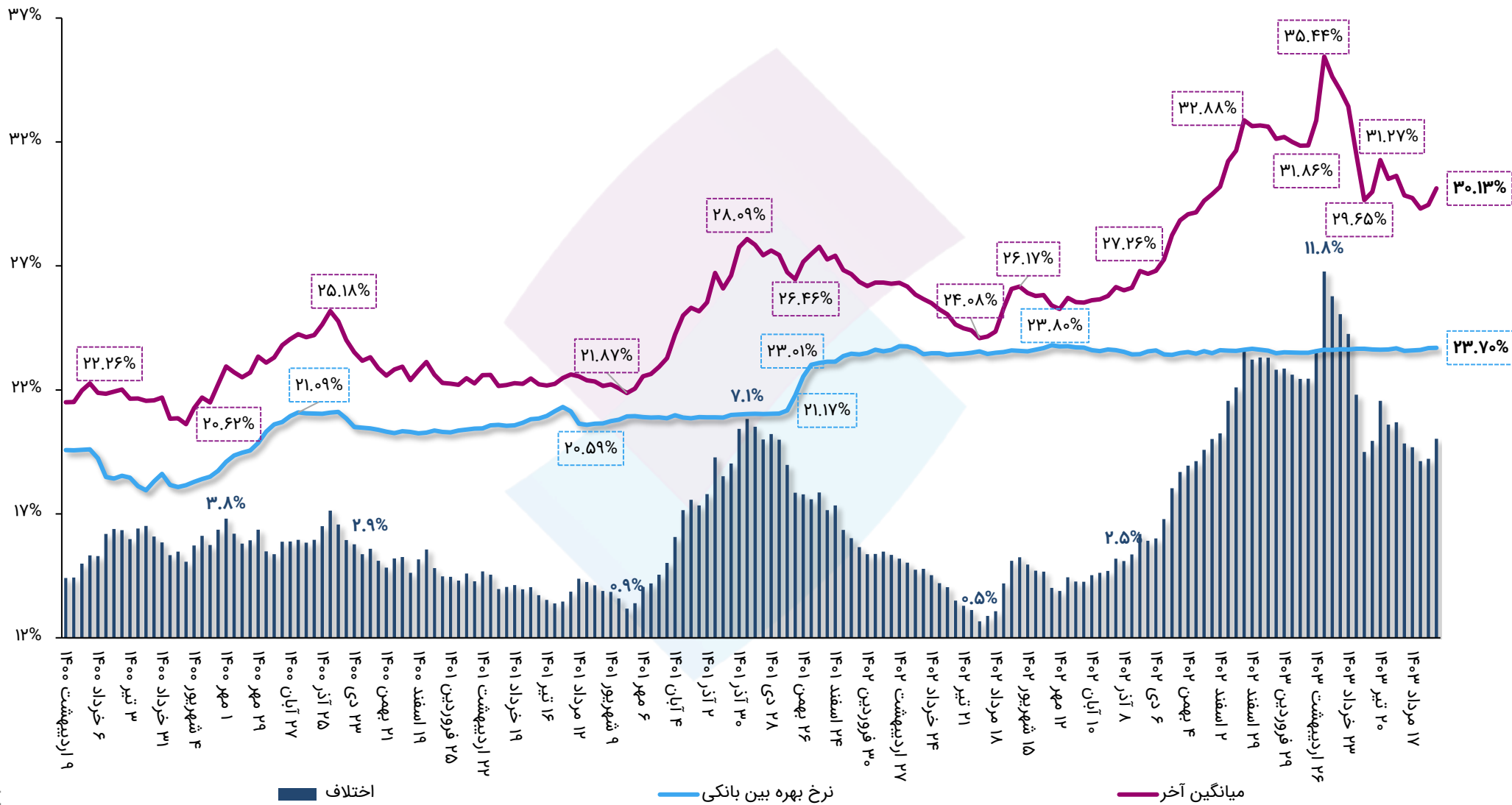


# صندوق‌های با درآمد ثابت با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

## صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



# افزایش ۰.۱ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۷ درصد و اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخرید به ارزش ۱۰.۶ همت



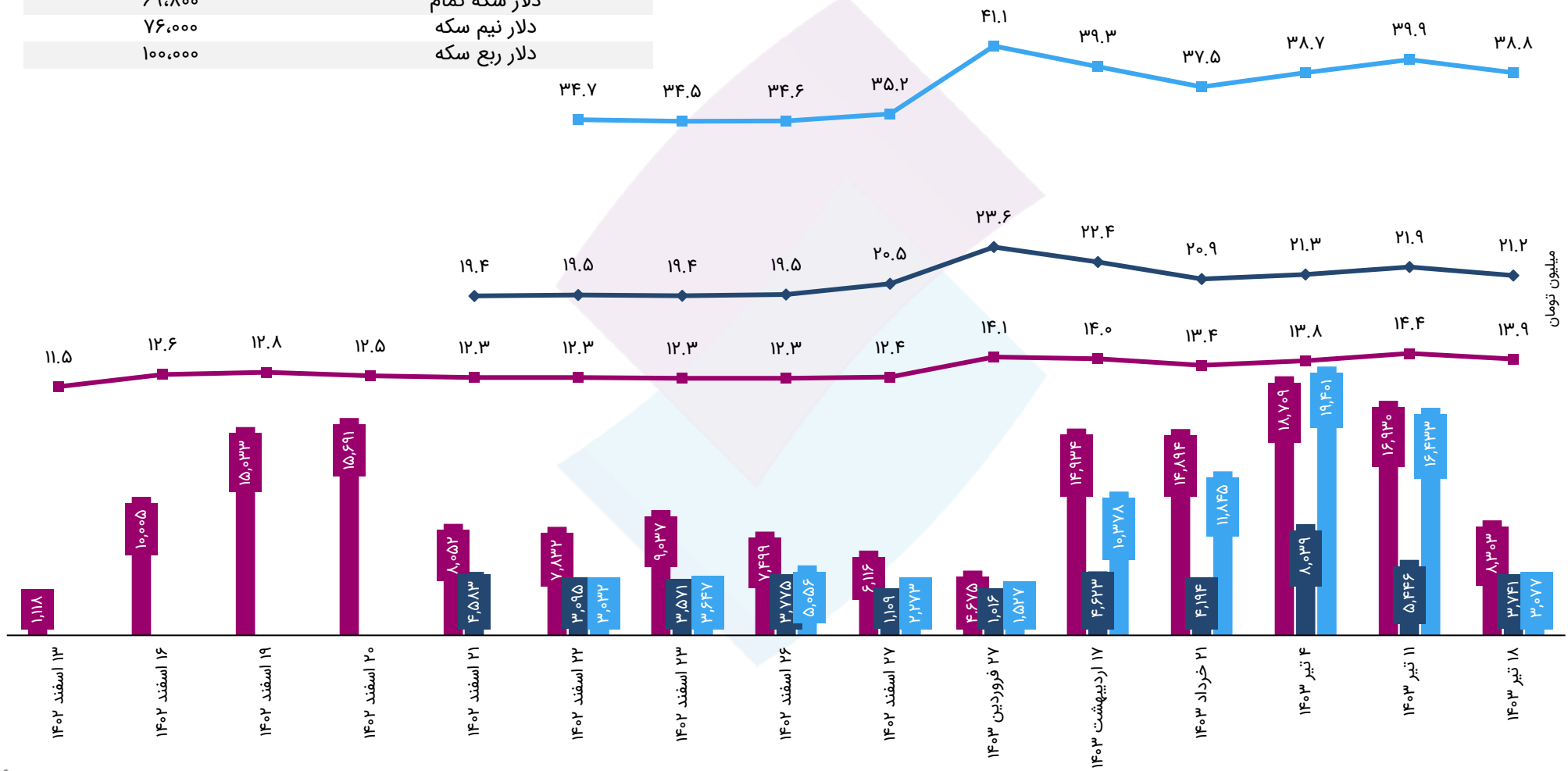
■ اختلاف

— نرخ بهره بین بانکی

— میانگین آخر

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

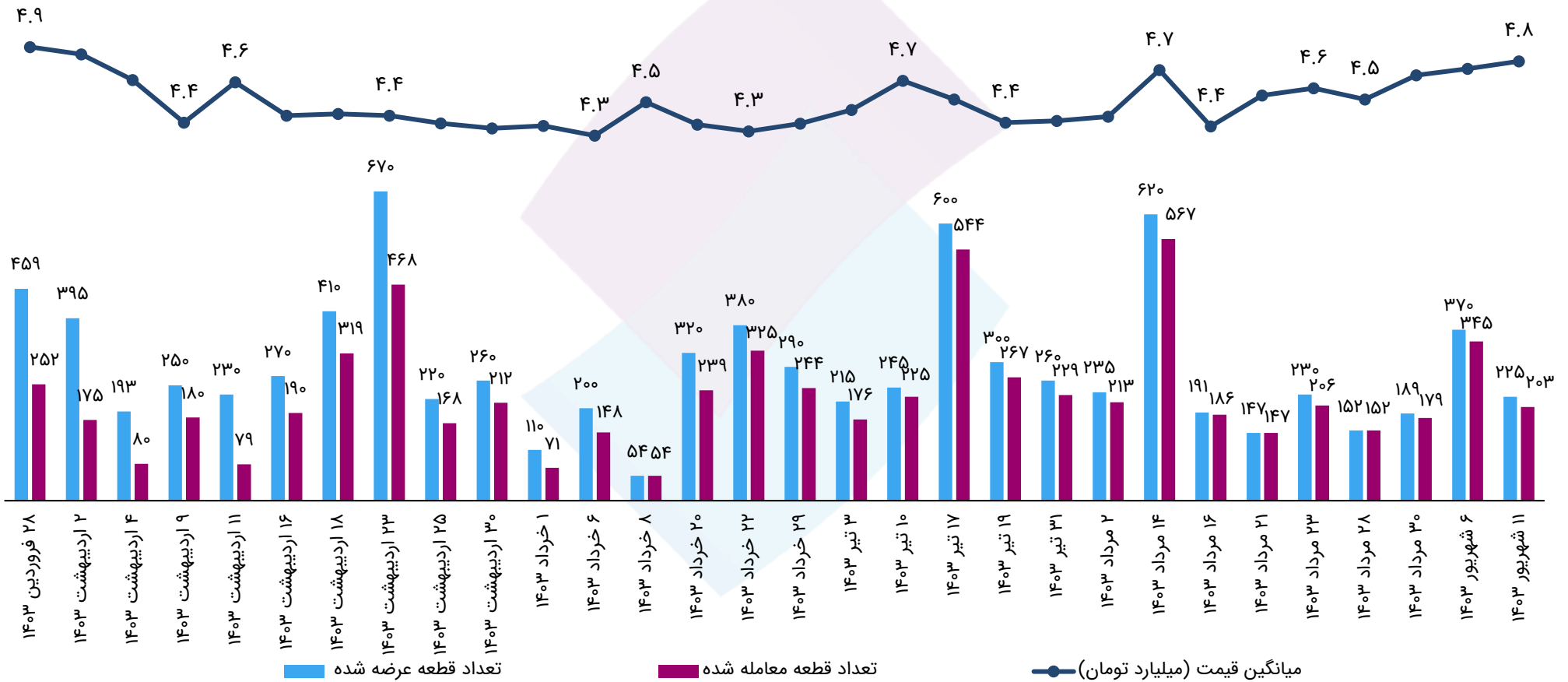
آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۶,۳۶۲
دلار سکه تمام	۶۹,۸۰۰
دلار نیم سکه	۷۶,۰۰۰
دلار ربع سکه	۱۰۰,۰۰۰



میلیون تومان

## معامله ۹ هزار و ۵۲ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۴۹,۲۹۰
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۵۹,۳۰۰



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

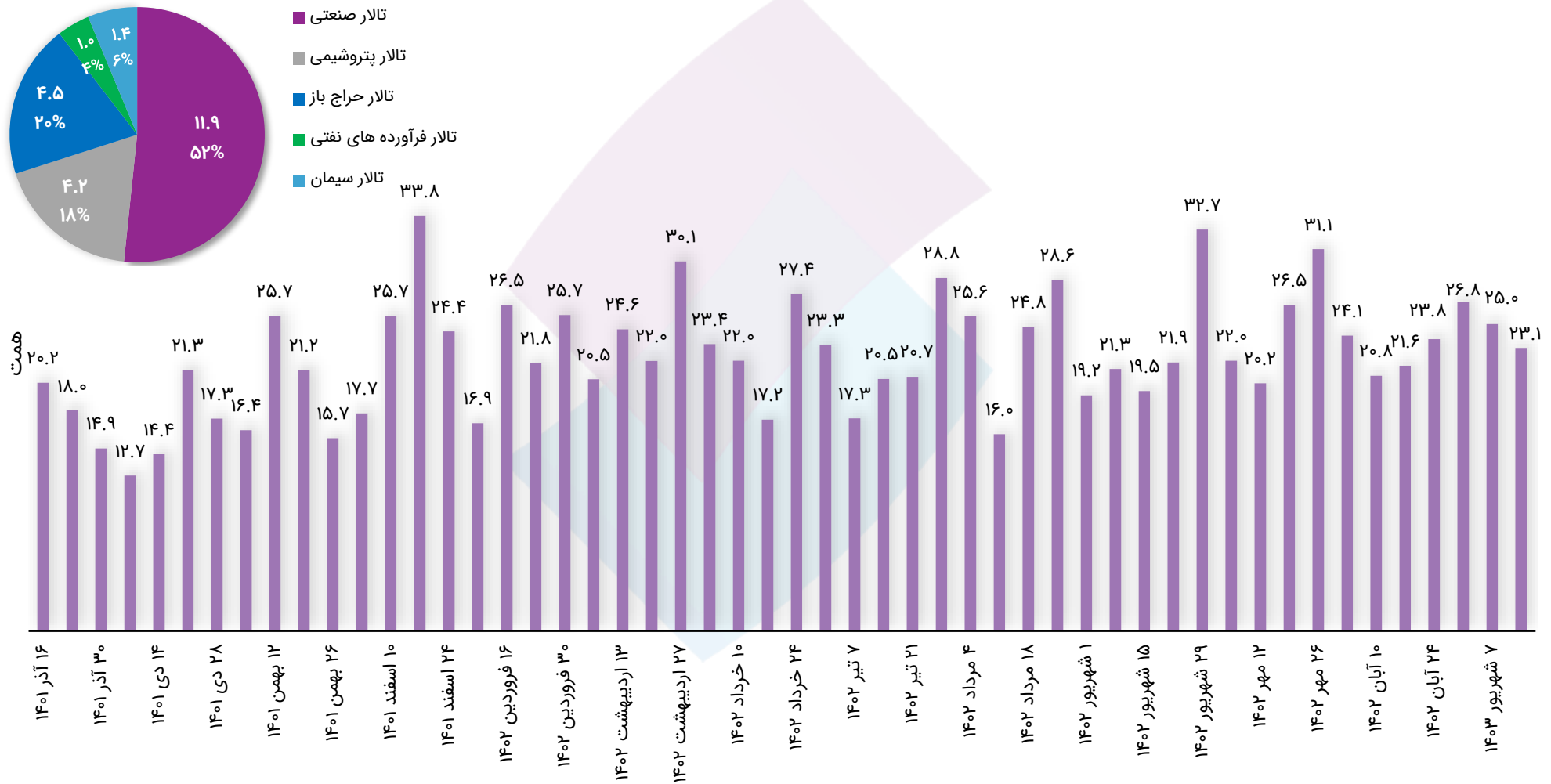
افزایش ۱۴ درصدی قیمت گاز طبیعی در پی اعلام انقضای قرارداد ترانزیت گاز روسیه از طریق اوکراین در تاریخ ۳۱ دسامبر و عدم تمایل به تمدید آن

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۲۹.۲%	۱,۹۳۸	۲.۵%	۲,۴۴۳	-۰.۸%	۲,۵۲۵	۲,۵۰۴	طلا (دلار/انس)
۵۴.۳%	۲۸۱,۴۸۰	۱.۰%	۴۳۰,۱۰۰	۱.۹%	۴۲۶,۲۵۰	۴۳۴,۴۰۰	سکه (هزار ریال)
۱۹.۵%	۴۱۲,۸۵۵	۱.۸%	۴۸۴,۳۶۷	۰.۴%	۴۹۱,۴۵۹	۴۹۳,۳۱۲	دلار اسکناس (ریال)
۲۱.۵%	۳۷۵,۳۲۳	۲.۶%	۴۴۴,۳۷۳	۰.۷%	۴۵۲,۹۵۸	۴۵۵,۹۲۶	دلار حواله (ریال)
-۱۴.۸%	۸۹	-۱.۹%	۷۷	-۵.۱%	۸۰	۷۶	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۲۹.۱%	۲۵,۸۱۲	۱.۷%	۵۸,۱۱۷	-۰.۶%	۵۹,۵۰۴	۵۹,۱۳۱	بیت کوین (دلار)
۷.۵%	۸,۴۰۵	۰.۶%	۸,۹۷۷	-۲.۳%	۹,۲۴۷	۹,۰۳۳	مس LME (دلار/تن)
۱۳.۱%	۲,۴۵۵	۵.۷%	۲,۶۲۷	-۳.۷%	۲,۸۸۳	۲,۷۷۷	روی LME (دلار/تن)
۱.۸%	۴۶۱	-۴.۰%	۴۸۹	-۰.۴%	۴۷۱	۴۷۰	بیلت CIS (دلار/تن)
-۲.۱%	۴۷۳	-۲.۱%	۴۷۳	-۲.۰%	۴۷۲	۴۶۲	بیلت ایران (دلار/تن)
۱.۰%	۲۸۷	۰.۳%	۲۸۹	۰.۷%	۲۸۸	۲۹۰	متانول CFR (\$/mt)
-۱۱.۳%	۳۶۴	-۳.۱%	۳۳۳	-۱.۵%	۳۲۸	۳۲۳	سبب اوره (mt/\$)
-۱۹.۳%	۲.۷	۱۵.۳%	۱.۸۹	۱۴.۱%	۱.۹۱	۲.۱۸	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)



## روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

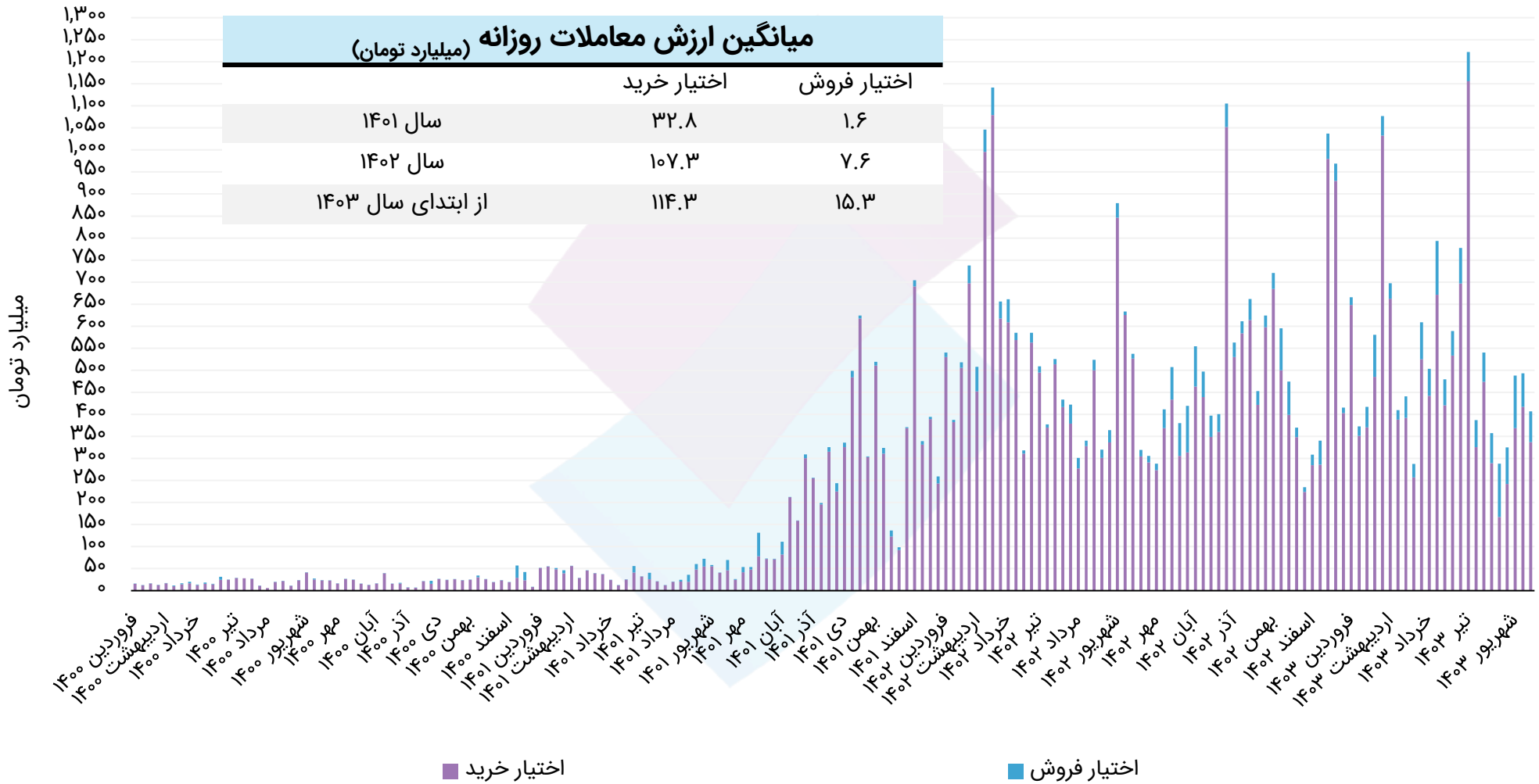


ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

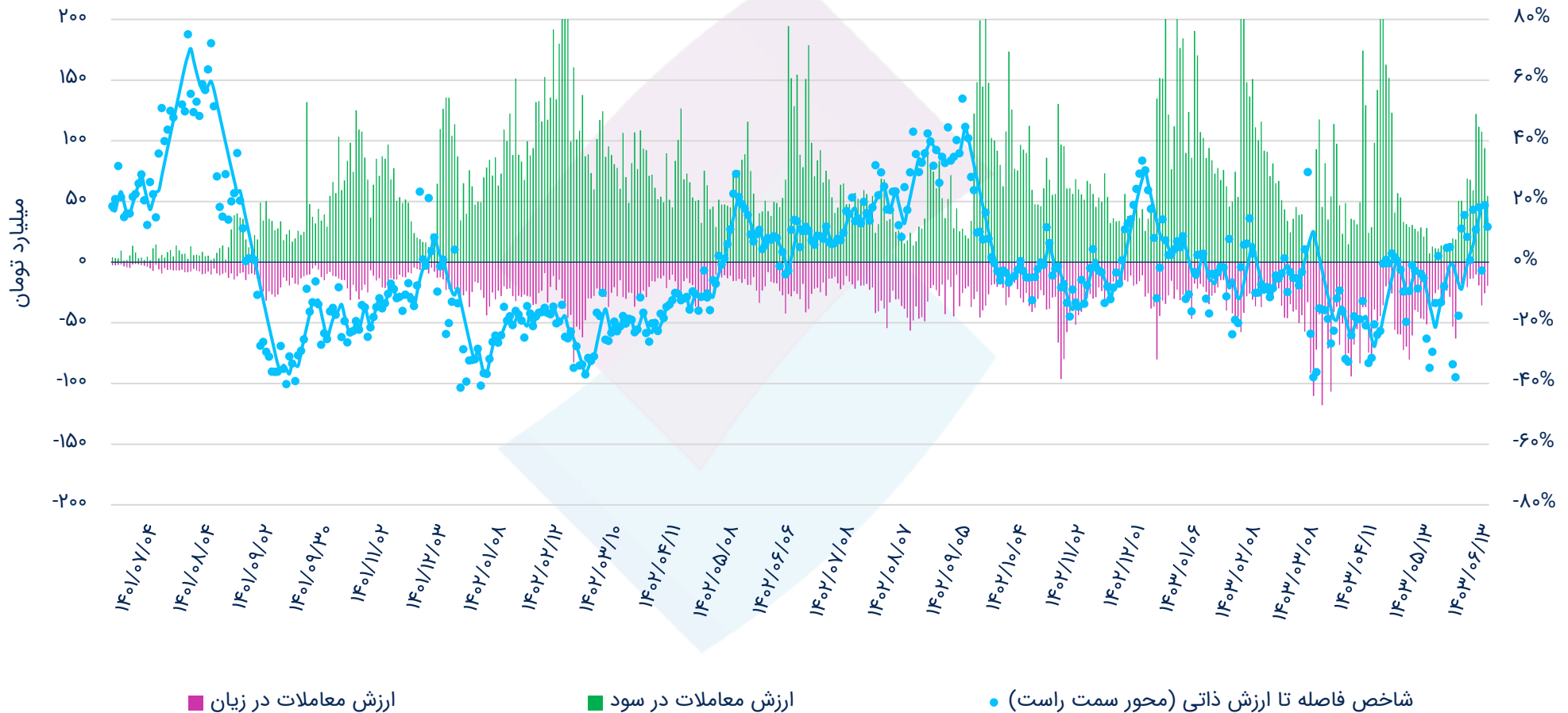
## کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات(تن)	عرضه کننده
میلگرد	۲۸.۵	۸۷,۵۴۰	فولاد آلیاژی ایران، ذوب آهن اصفهان، جهان فولاد سیرجان، مجتمع فولاد خراسان، نورد فولاد صنعتی و ساختمانی یزد، مجتمع معدنی و صنعت آهن و فولاد بافق، فولاد آذربایجان، ذوب آهن و تولید میلگرد سیرجان حدید جنوب
شمش بلوم	۲۲.۳	۹۳,۵۹۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرمو، شرکت فولاد زرد ایرانیان، آهن و فولاد ارفع، فولاد بوتیای ایرانیان، فولاد سیرجان ایرانیان، صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، جهان فولاد سیرجان، ذوب و نورد زرفام، پردیس صنعت زنده رود
مس کاتد	۴۹۸.۱	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
آهن اسفنجی	۱۲.۲	۱۲۹,۶۵۰	آهن و فولاد غدیر ایرانیان، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، فولاد خوزستان، فولاد غدیر نی ریز، صنعت فولاد شادگان، توسعه آهن و فولاد گل گهر، احیاء استیل فولاد بافت، صبا فولاد خلیج فارس
گندله سنگ آهن	۵.۳	۲۹۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)
سیمان	۱.۴	۱,۰۳۹,۰۲۱	سیمان ساوه، سیمان آبیگ، سیمان تهران، سیمان ارومیه، سیمان صوفیان، سیمان مازندران، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان سپاهان، سیمان آرتا اردبیل، سیمان هرمزگان، سیمان خزر، سیمان فارس نو، سیمان هگمتان، سیمان غرب، سیمان آذر آبادگان خوی، سیمان فیروزکوه، سیمان نیزار قم، سیمان ممتازان کرمان، صنایع سیمان شهرکرد، سیمان فراز فیروزکوه، سیمان عمران انارک
وکیوم باتوم	۱۴.۱	۸۳,۵۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت شیراز، پالایش نفت تبریز
ورق سرد	۳۷.۷	۲۹,۵۰۰	فولاد مبارکه اصفهان، فولاد غرب آسیا، صنایع هفت الماس، فولاد امیرکبیر کاشان
لوب کات	۲۱.۸	۳۸,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)
کنسانتره سنگ آهن	۳.۸	۲۱۰,۰۰۰	شرکت معدنی و صنعتی چادرمو، معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، بین‌المللی اسم ایران
ورق گالوانیزه	۴۶.۵	۱۶,۹۰۰	ورق خودروی چهارمحال و بختیاری، فولاد امیرکبیر کاشان، فولاد تاراز چهارمحال، مجتمع فولادی روی اندودکاوه، صنایع هفت الماس
شمش آلومینیوم	۱۴۶.۵	۵,۰۰۰	مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم ایران(ایرالکو)، آلومینیوم مهدی، آلومینای ایران
تیر آهن	۲۶.۲	۲۴,۴۵۱	ذوب آهن اصفهان، مجتمع جهان فولاد غرب، مجتمع فولاد ظفر بناب
پلی اتیلن ترفتالات	۴۹.۱	۱۲,۰۹۳	پتروشیمی تندگویان، Wankai New Materials Co.,Ltd، پتروشیمی محب پلی استر خاوران
پلی پروپیلن نساجی	۴۹.۱	۱۰,۴۴۰	پتروشیمی مارون، پتروشیمی رجال، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)، پتروشیمی شازند، دی آریا پلیمر، پتروشیمی پلی نار، نوید زرشیمی

## روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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

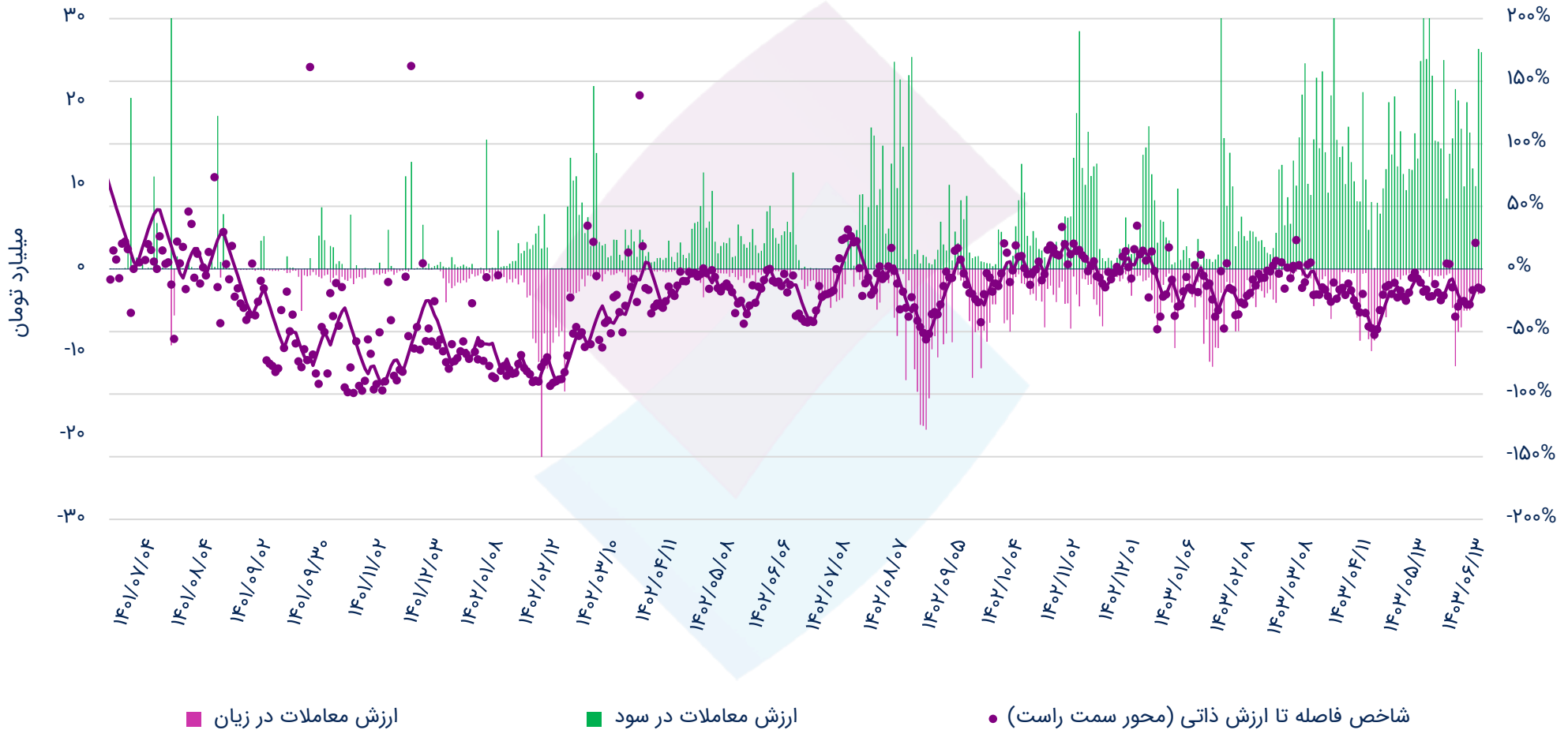


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).

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

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

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

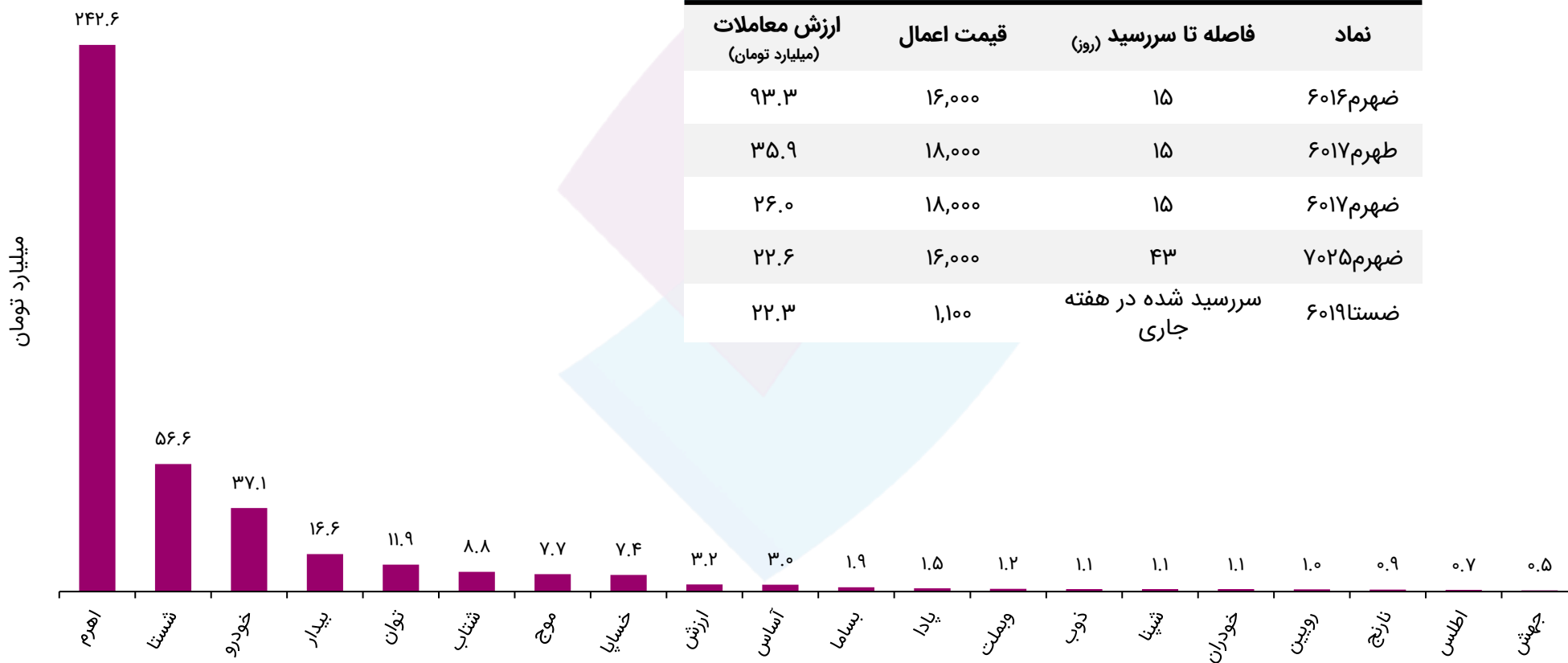


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).  
 (۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه  
 (۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

# 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	۱۵	۱۶,۰۰۰	۹۳.۳
طهرم ۶۰۱۷	۱۵	۱۸,۰۰۰	۳۵.۹
ضهرم ۶۰۱۷	۱۵	۱۸,۰۰۰	۲۶.۰
ضهرم ۷۰۲۵	۴۳	۱۶,۰۰۰	۲۲.۶
ضستا ۶۰۱۹	سررسید شده در هفته جاری	۱,۱۰۰	۲۲.۳



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

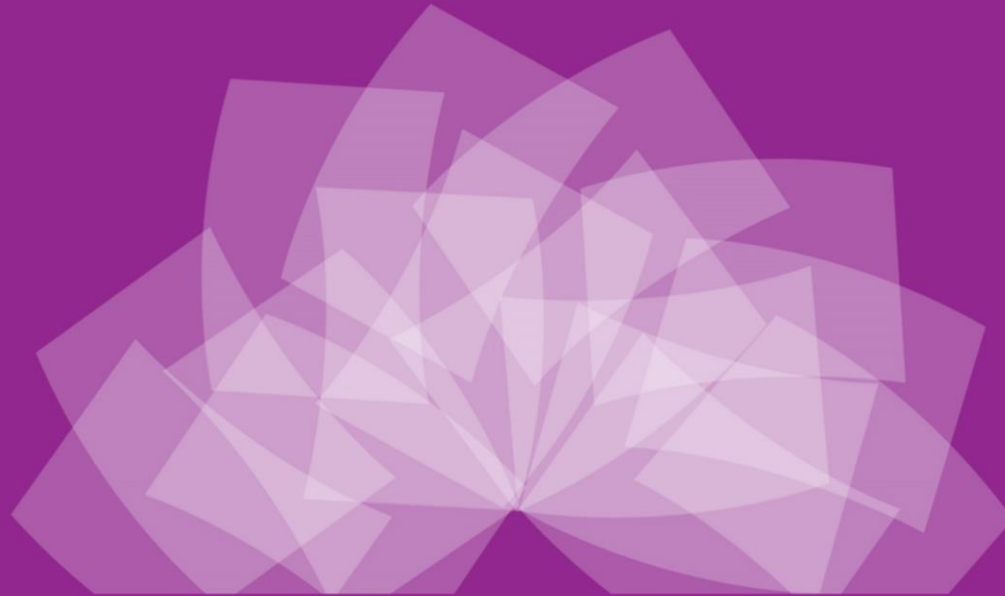




## سلب مسئولیت

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 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)