

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 ۲۵ مهر - شماره ۱۷۲

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



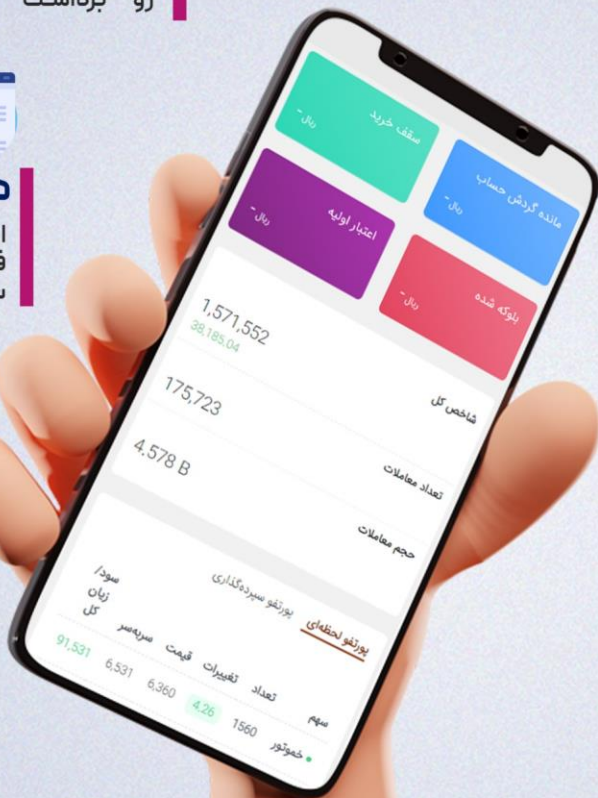
## برداشت وجه آئی

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

☎ ۰۲۱ ۸۶۷۹۱۰۰۰

🌐 nibb.ir

📷 nibb.ir

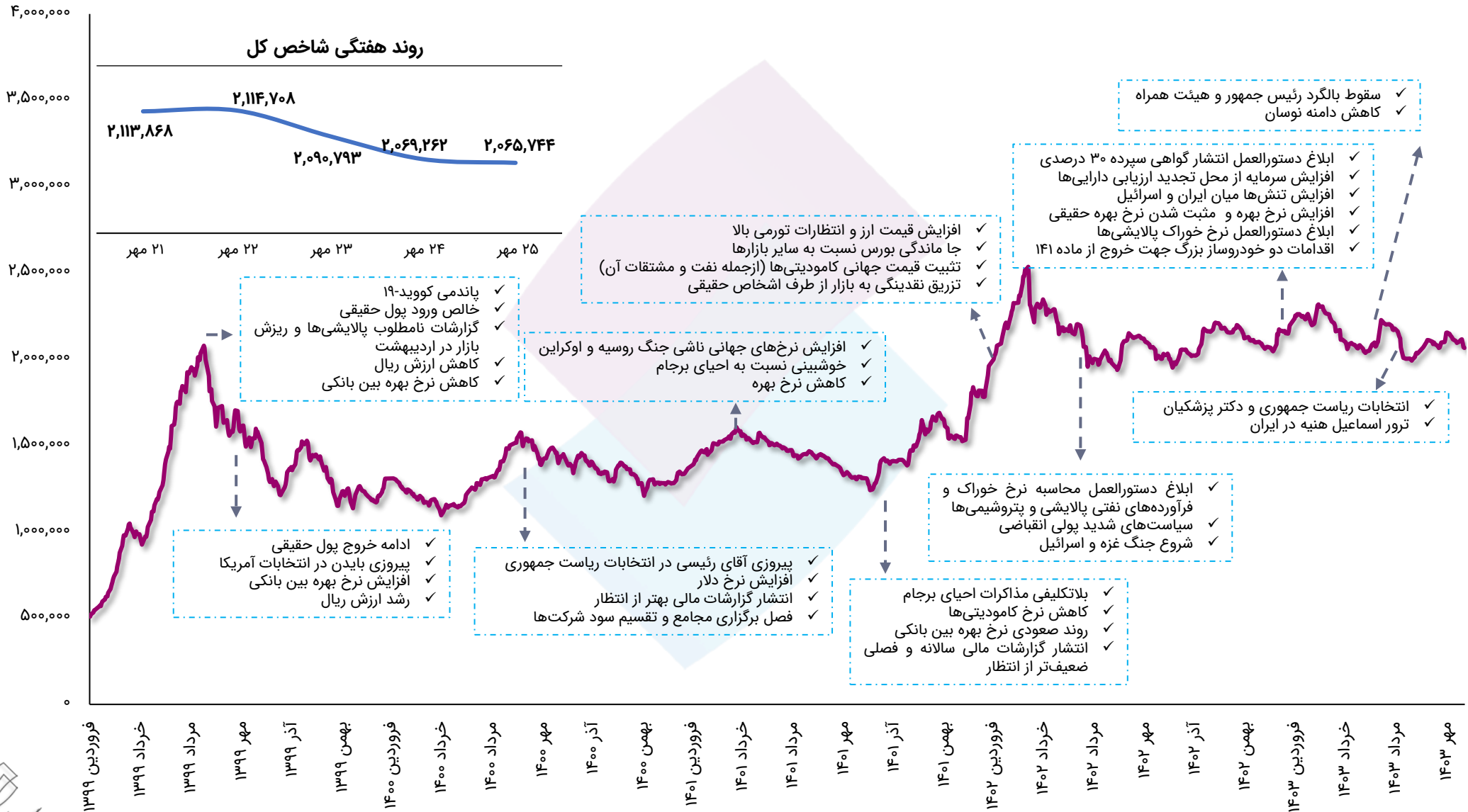
✈️ nibbroker

کارگزاری تأمین سرمایه نوین



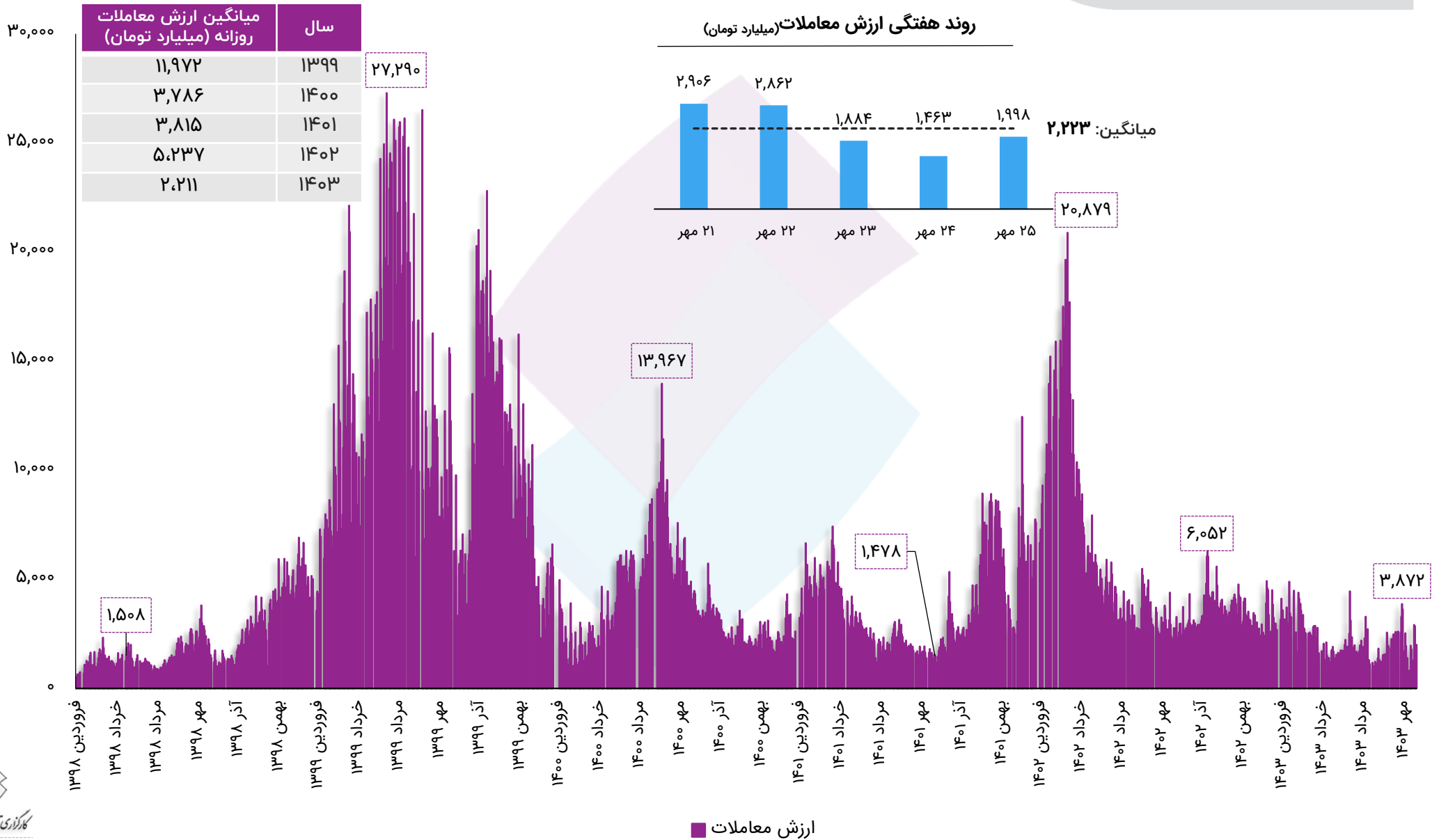
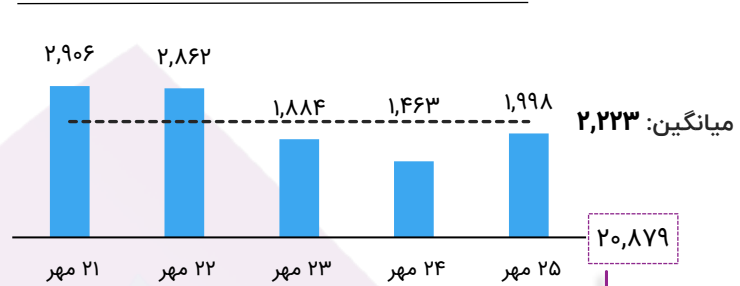
وضعیت بازار سرمایه  
در هفته‌ای که گذشت.

## نزول ۱.۶ درصدی شاخص کل در هفته جاری



# ارزش معاملات خرد بورس اوراق بهادار و فرابورس ایران

روند هفتگی ارزش معاملات (میلیارد تومان)

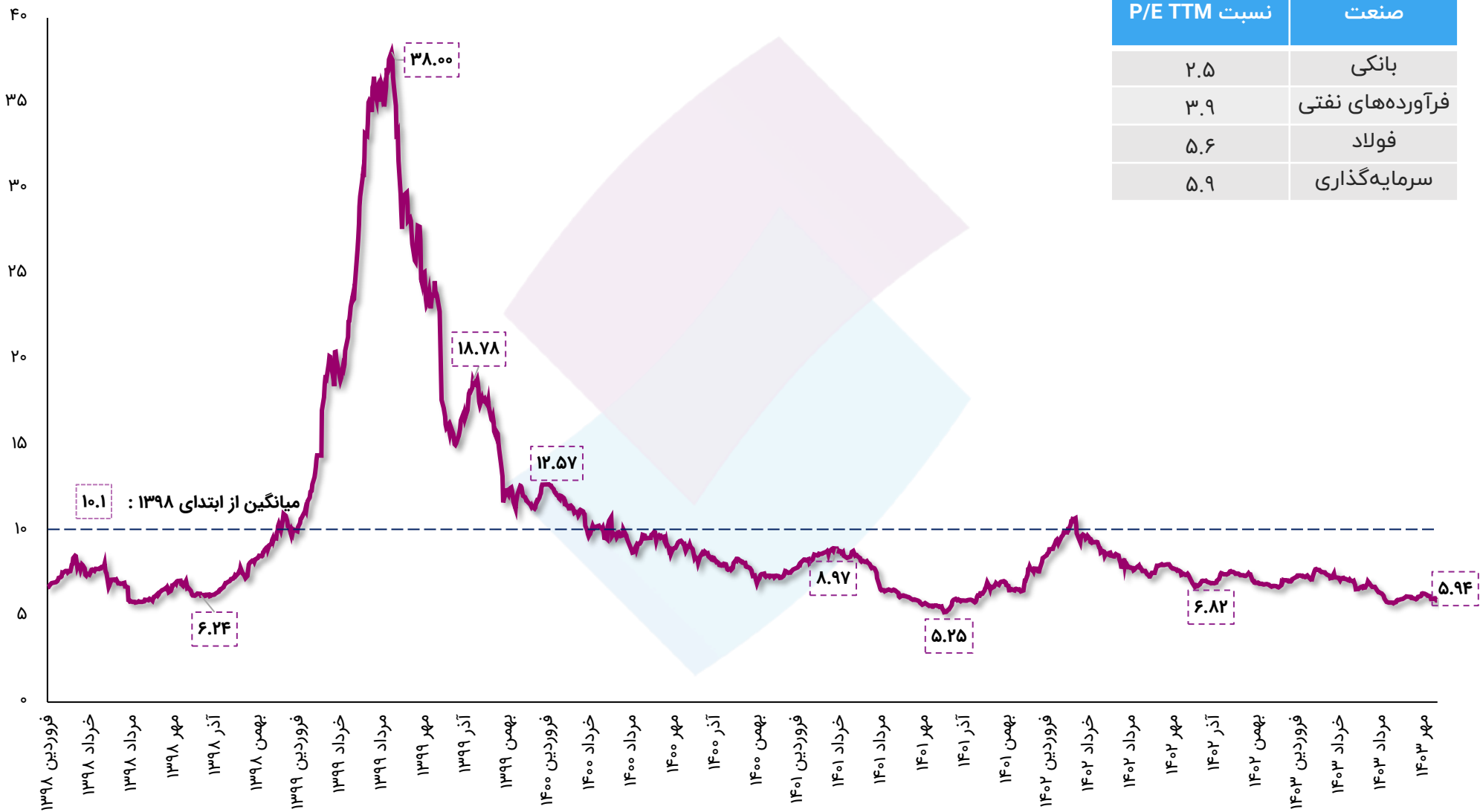


سال	میانگین ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)
۱۳۹۹	۱۱,۹۷۲
۱۴۰۰	۳,۷۸۶
۱۴۰۱	۳,۸۱۵
۱۴۰۲	۵,۲۳۷
۱۴۰۳	۲,۲۱۱

ارزش معاملات

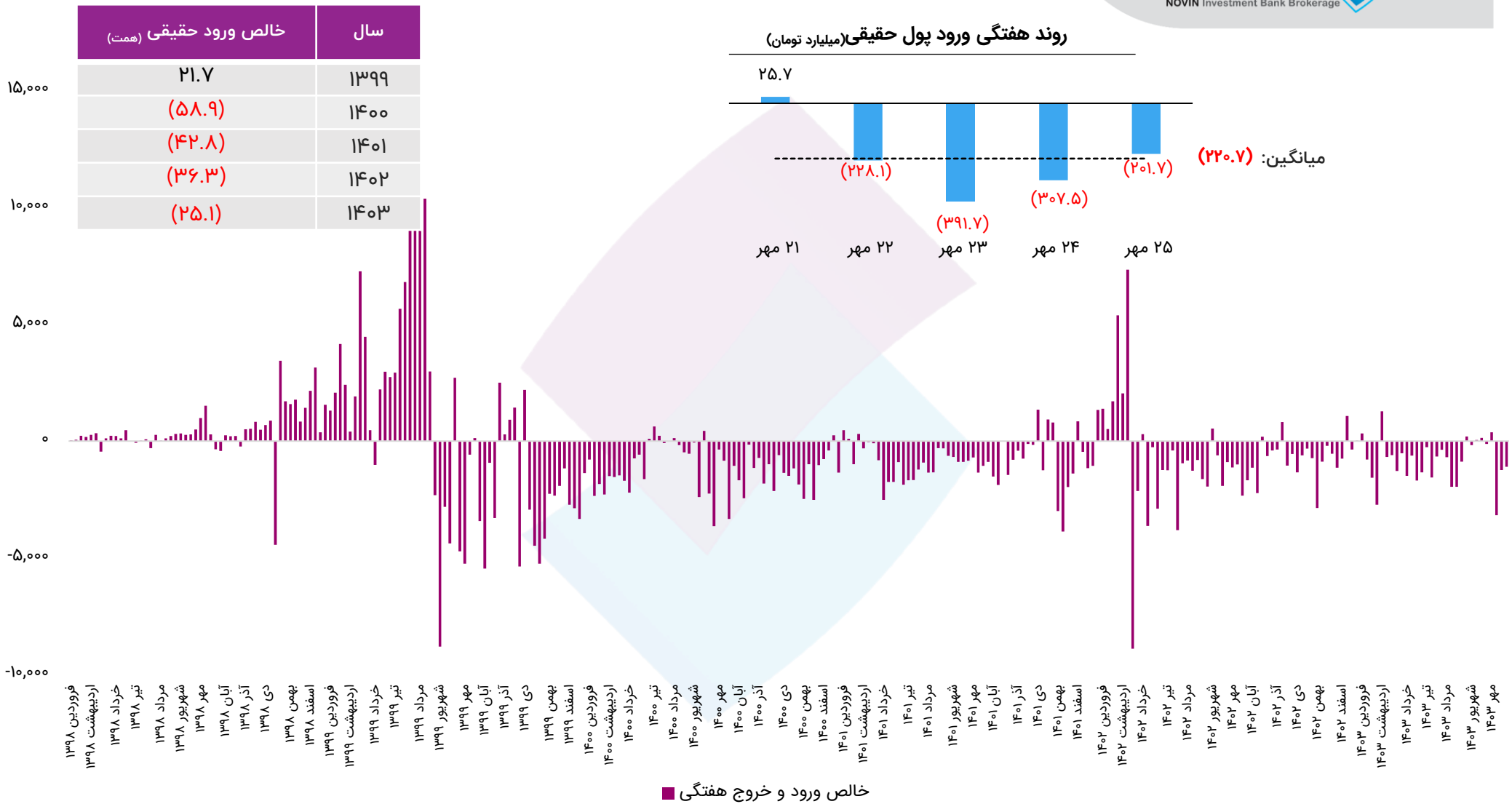


# نسبت P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران



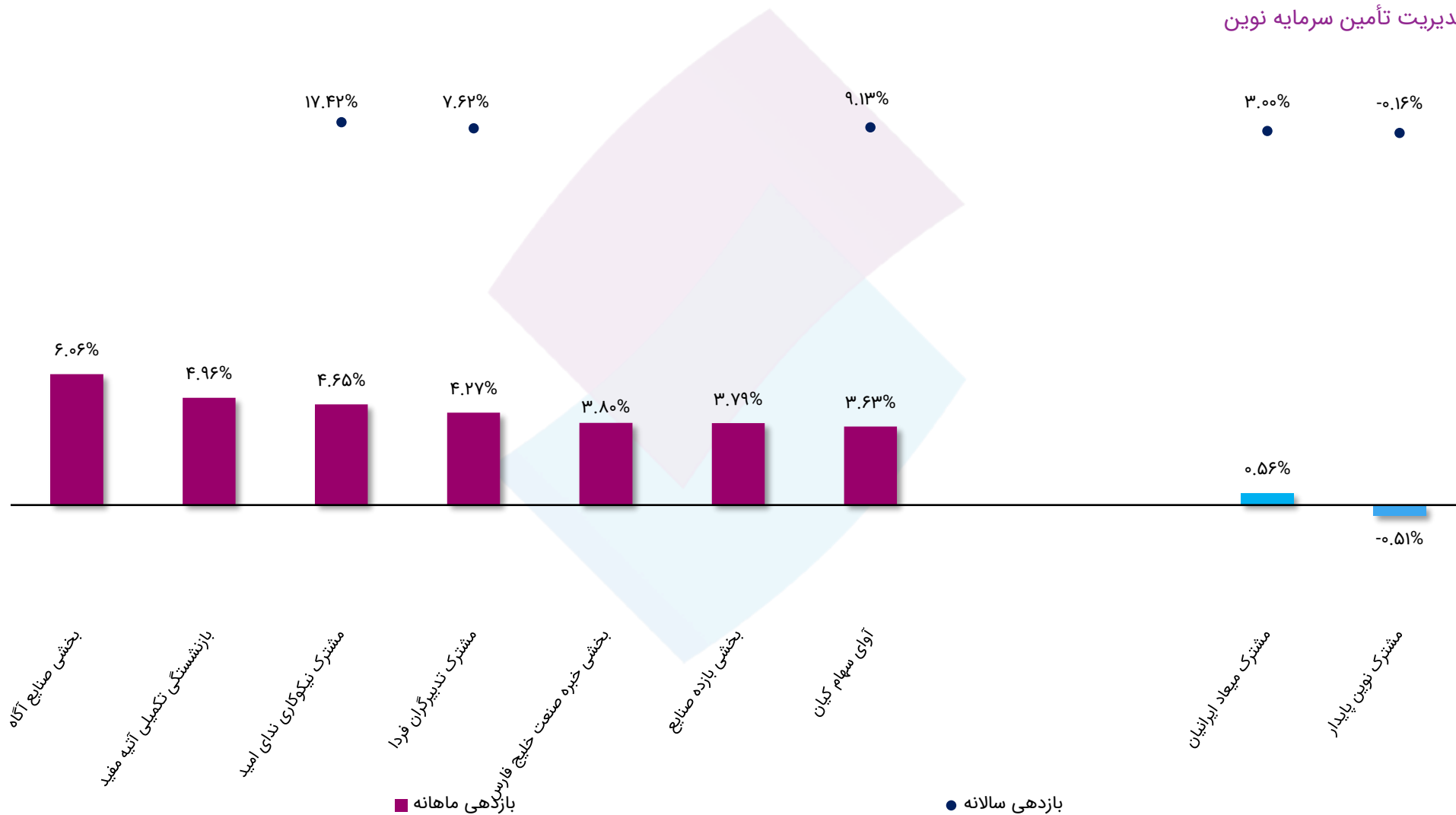
نسبت P/E TTM	صنعت
۲.۵	بانکی
۳.۹	فرآورده‌های نفتی
۵.۶	فولاد
۵.۹	سرمایه‌گذاری

## ۱،۱۰۳ میلیارد تومان خالص خروج پول حقیقی در هفته جاری در مقایسه با خروج ۱،۲۴۳ میلیارد تومانی هفته گذشته

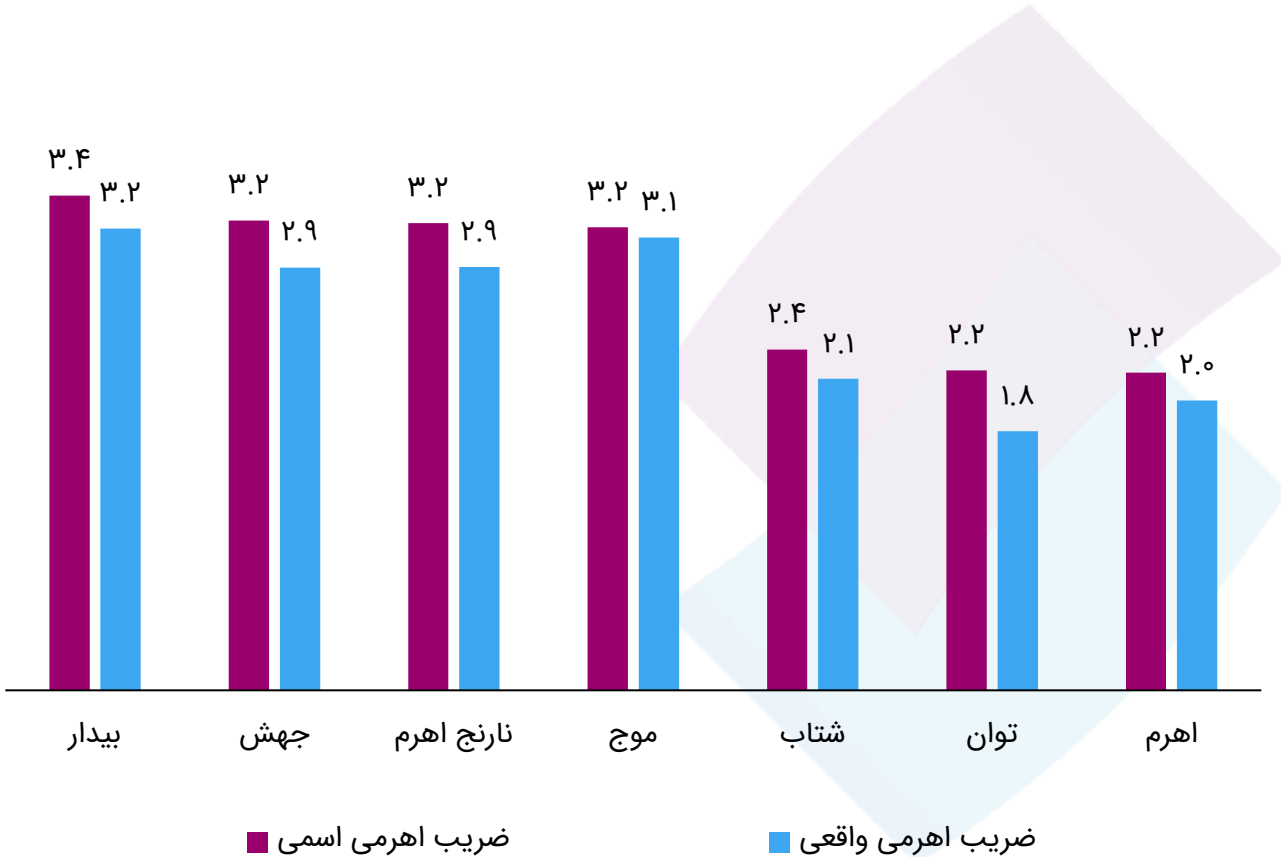


# صندوق‌های سهامی با بیشترین بازدهی طی یک ماه گذشته

## صندوق‌های تحت مدیریت تأمین سرمایه نوین



# صندوق‌های اهرمی



نماد	حباب	بتا
توان	-۶.۰%	۲.۰
موج	-۵.۴%	۲.۱
شتاب	-۵.۲%	۲.۱
اهرم	-۳.۲%	۲.۱
جهش	-۳.۱%	۲.۳
نارنج اهرم	-۱.۶%	۲.۵
بیدار	-۰.۱%	۳.۰

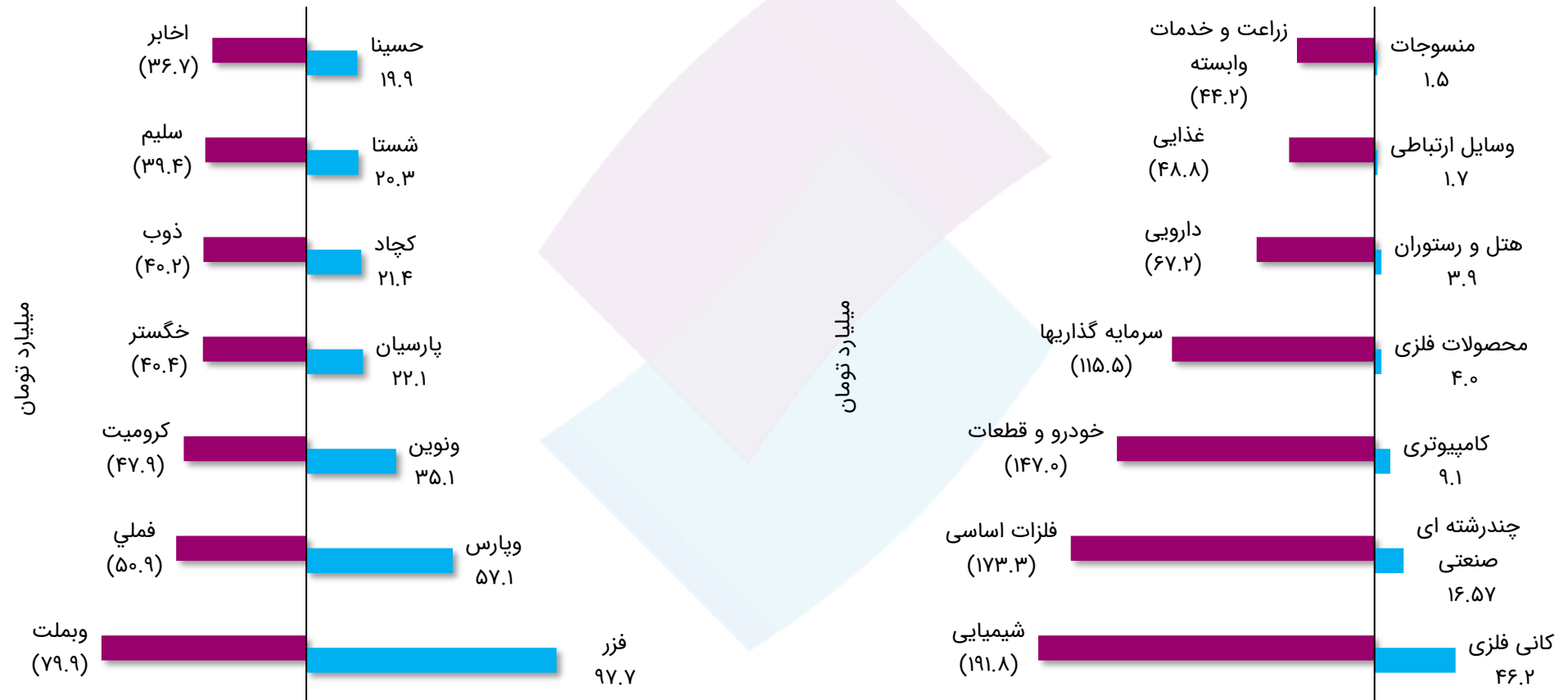
نماد	بازده ماهانه	بازده ماهانه واحد عادی
شتاب	-۱.۲%	۲.۴%
توان	-۲.۳%	۲.۲%
نارنج اهرم	-۲.۷%	۲.۵%
اهرم	-۲.۹%	۲.۵%
موج	-۳.۰%	۲.۵%
جهش	-۶.۰%	۲.۵%
بیدار	-۸.۲%	۲.۵%

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 طی ۲۴۵ روز گذشته استفاده شده است.

## بیشترین ورود و خروج پول حقیقی طی هفته جاری

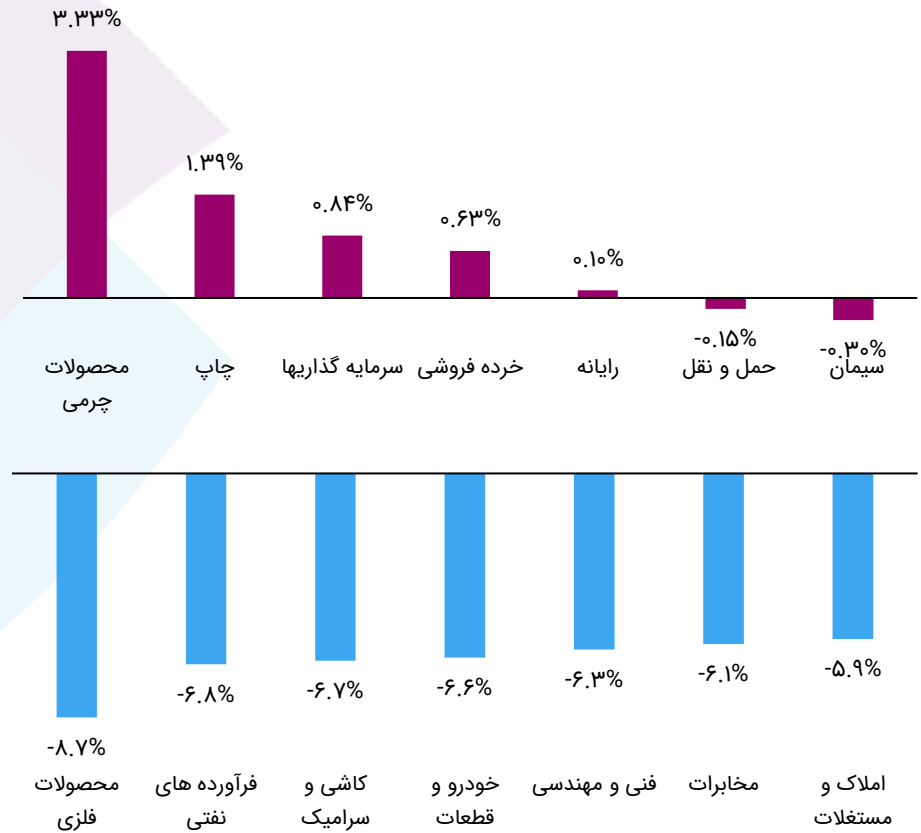
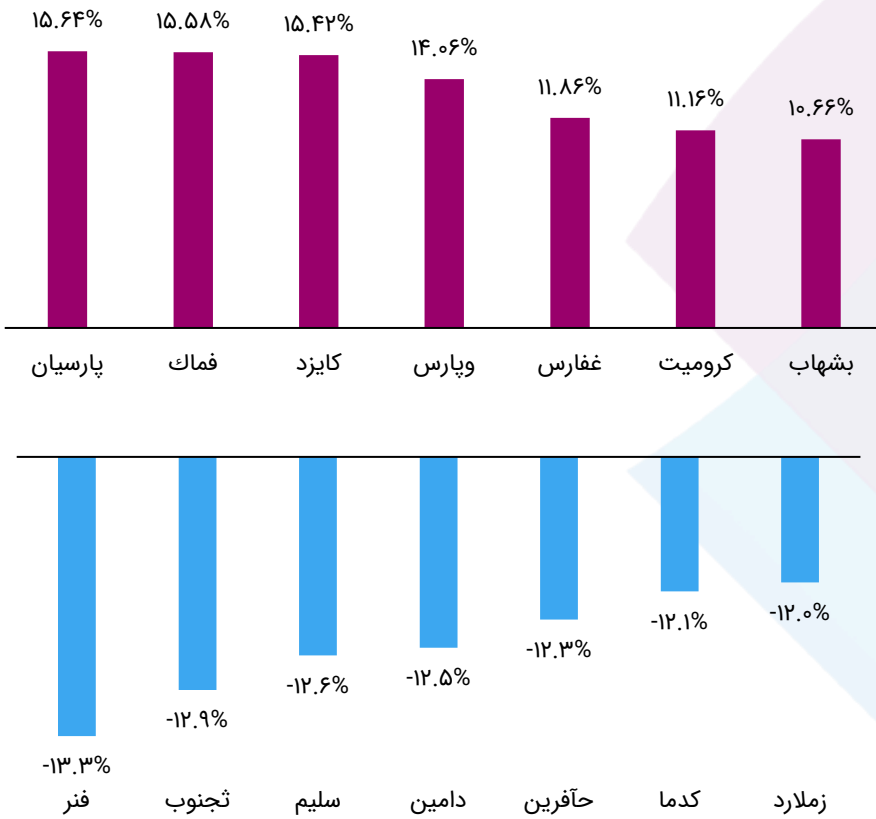
### صنعت

### نماد



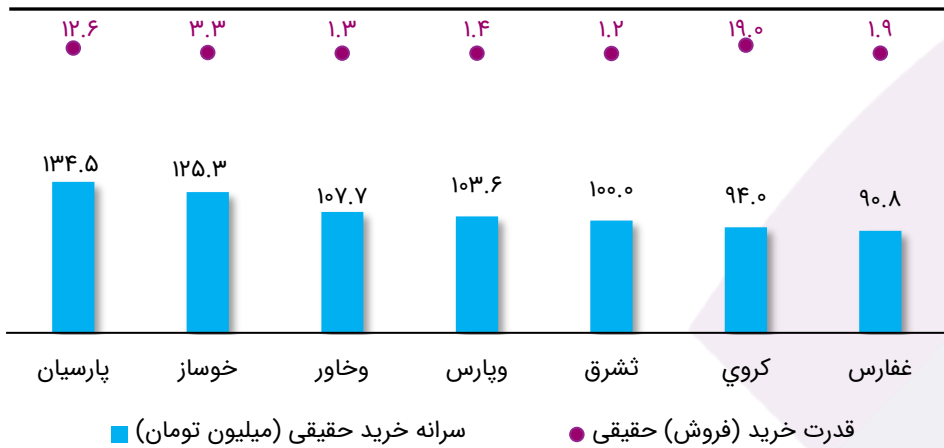
نماد

صنعت

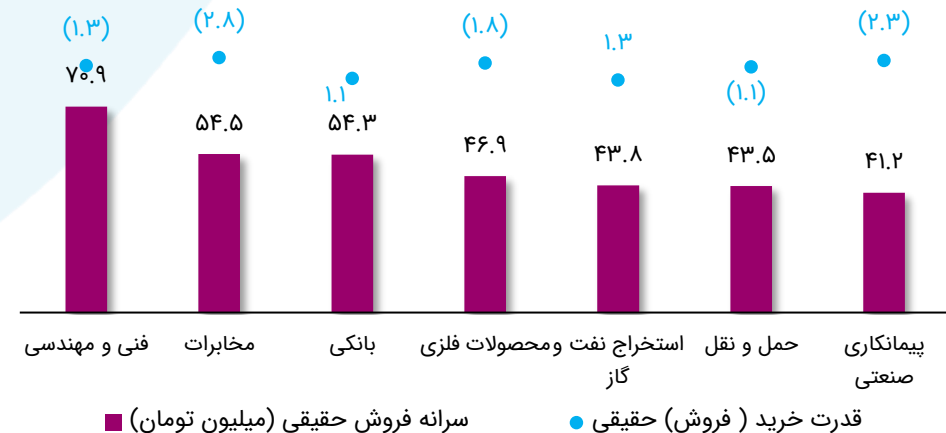
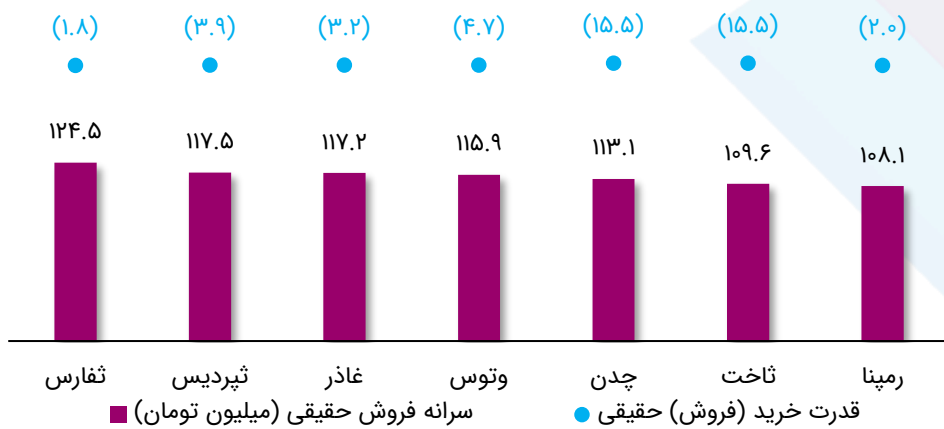
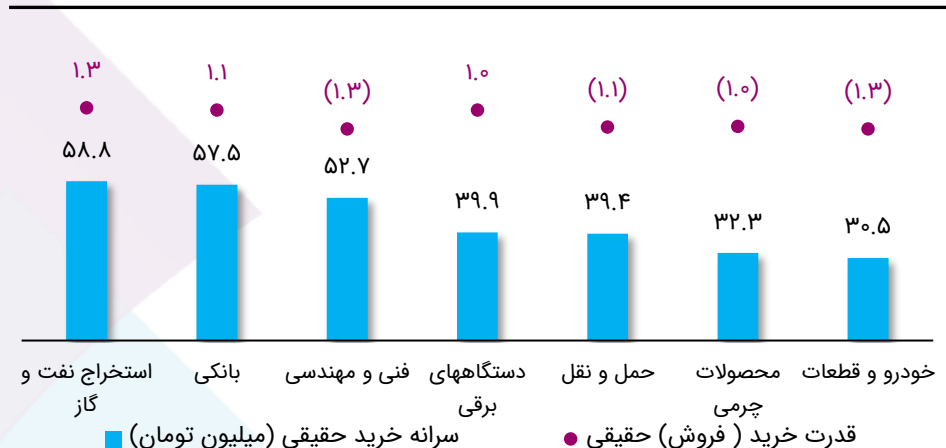


## بیشترین سرانه خرید و فروش طی هفته جاری

### نماد



### صنعت



## گزارشات مرتبط با افزایش سرمایه در هفته جاری

نماد	سرمایه فعلی (میلیارد تومان)	سرمایه جدید تغییرات (میلیارد تومان)	محل افزایش سرمایه (درصد)	موضوع افزایش سرمایه
<b>پیشنهاد هیئت مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه</b>				
آفتاب	۵۰۰	۱,۵۰۰	۲۰۰%	آورده نقدی
چکام	۴۷۵	۵,۶۲۱	۱۰۸۴%	تجدیدارزیابی
ثغرب	۱۲۰	۲۴۰	۱۰۰%	سودانباشته
واتی	۸۵۰	۱۵۵۰	۸۲%	سودانباشته تجدیدارزیابی
قاروم	۳۴	۹۴۸	۲۶۶۱%	تجدیدارزیابی
دفرا	۱۴۰	۲۸۰	۱۰۰%	سودانباشته
کنور	۳,۹۳۰	۹,۹۳۰	۱۵۳%	آورده نقدی سود انباشته
<b>تصمیمات مجمع عمومی فوق العاده صاحبان سهام در خصوص افزایش سرمایه</b>				
پاکشو	۴,۸۰۰	۷,۰۰۰	۴۶%	سودانباشته
سغرب	۵۰	۵۶۵	۱۰۳۰%	تجدیدارزیابی
نظرین	۷۸	۱۷۰	۱۱۹%	سودانباشته
سرود	۸۱	۹۶۰	۱۰۸۵%	تجدیدارزیابی
لبوتان	۲۵۰	۱,۴۲۷	۴۷۱%	تجدیدارزیابی



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

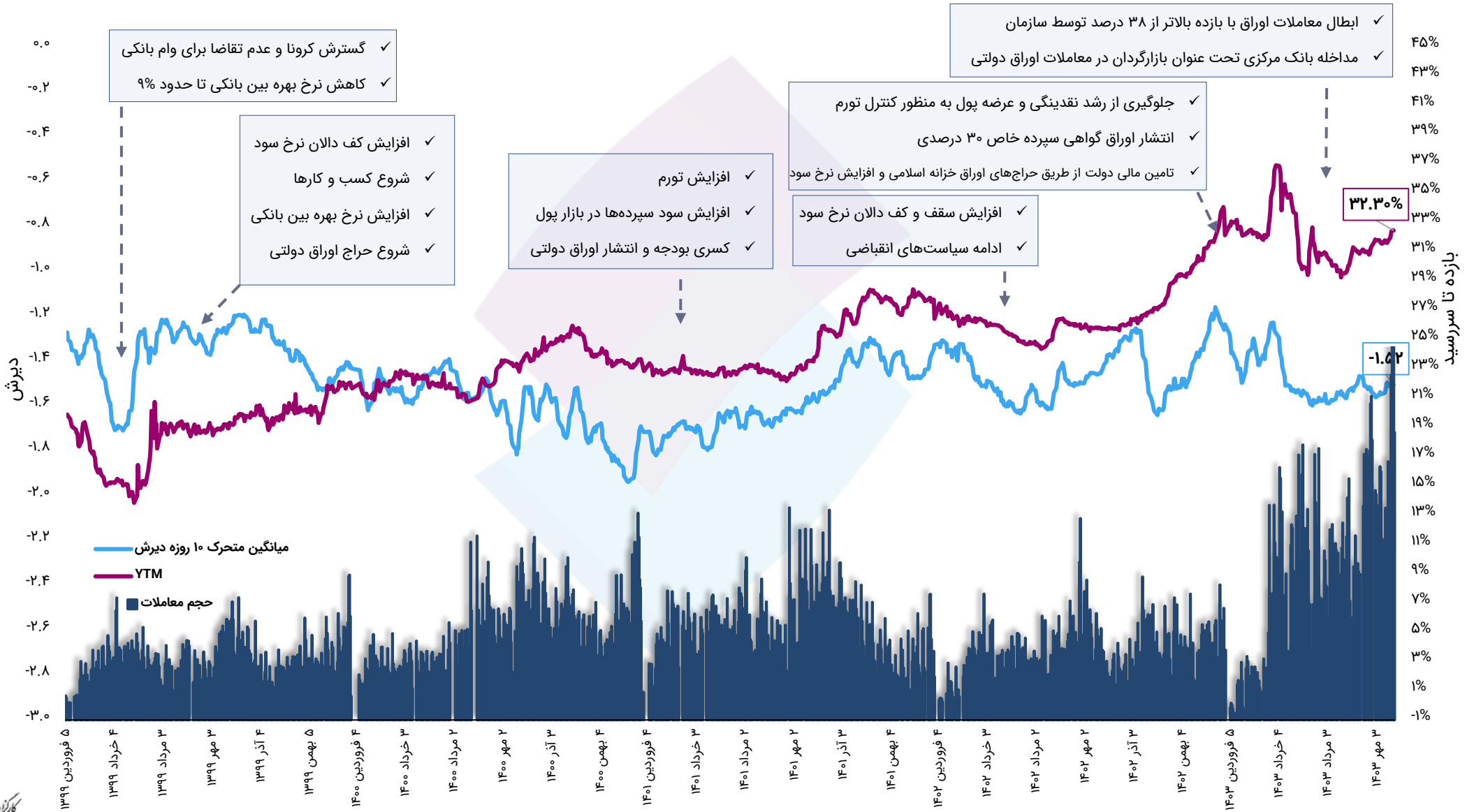
### مهلت استفاده از حق تقدم خرید سهام

مهلت استفاده از حق تقدم سهام از تاریخ ۱۴۰۳/۰۷/۲۵ تا ۱۴۰۳/۰۸/۲۴ است.	اصلاح ساختار مالی	آورده نقدی (۴۰٪) سود انباشته (۶۰٪)	۳۰۰	۴۵۰	وطوبی
---	-------------------	---------------------------------------	-----	-----	-------

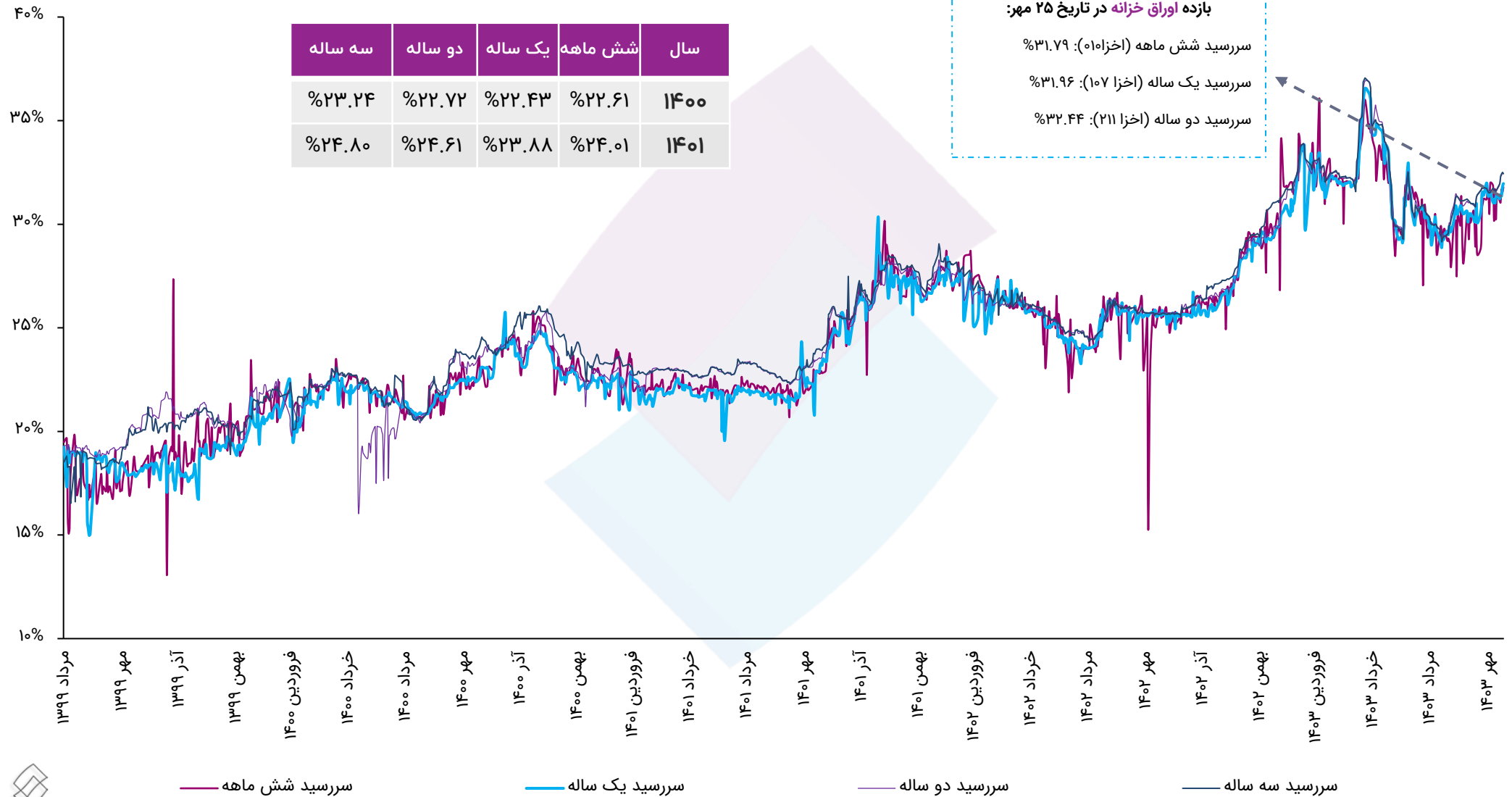
### آگهی ثبت افزایش سرمایه

تامین سرمایه در گردش مورد نیاز جهت خرید تجهیزات، زیر ساخت شبکه و نوسازی دستگاه‌های کارت خوان	آورده نقدی	۱۸٪	۸۵۰	۱,۰۰۰	رکیش
اصلاح ساختار مالی، تامین سرمایه در گردش و بهره مندی از معافیت مالیاتی مطابق با بند "ث" ماده ۱۴ قانون تامین مالی تولید و زیرساختها	سود انباشته	۲۱٪	۱,۴۰۰	۱,۷۰۰	چدن

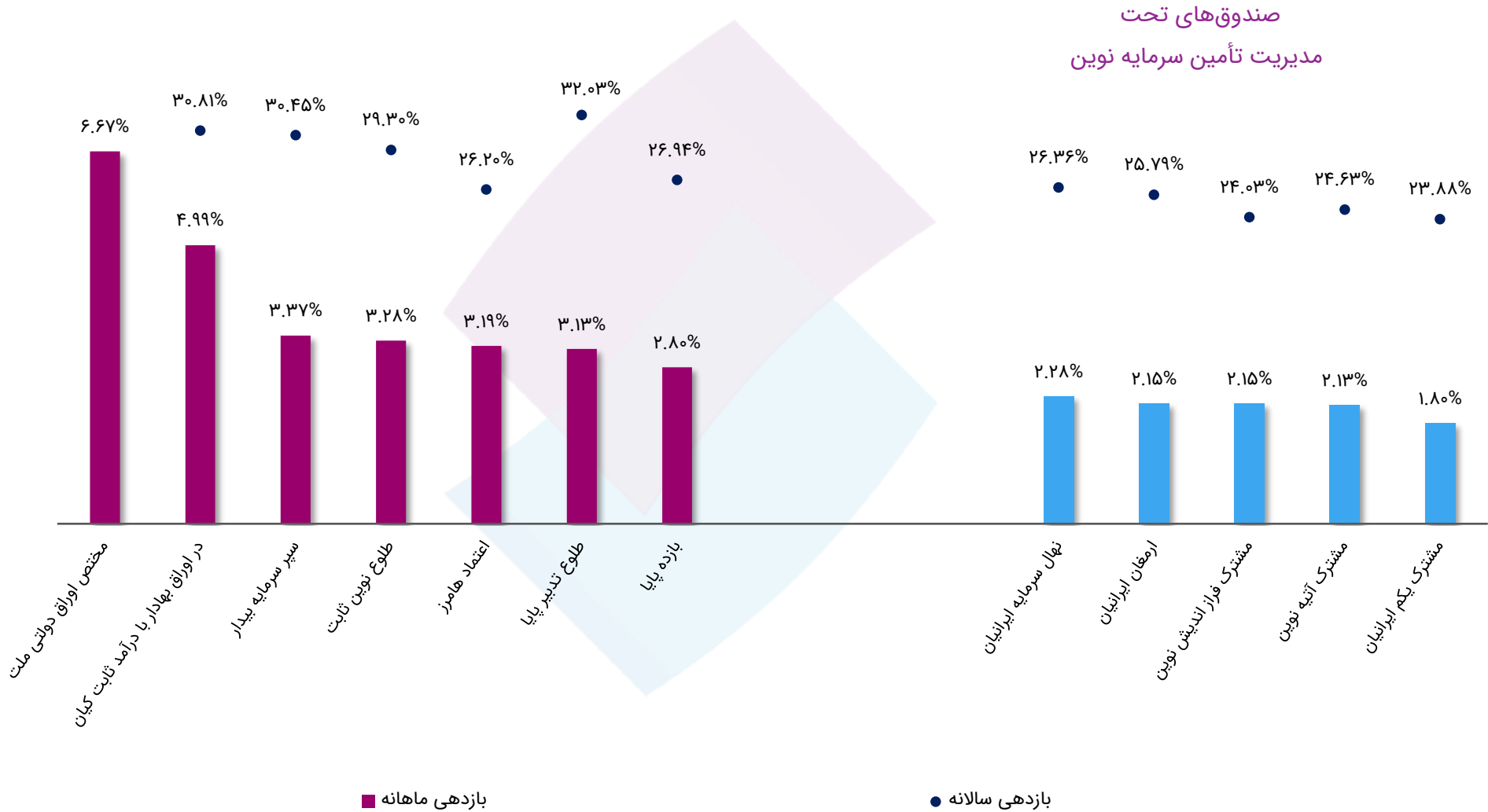
# رشد ۰.۷۲ واحد درصدی نرخ بهره بدون ریسک تا سطح ۳۲.۳۰ درصد



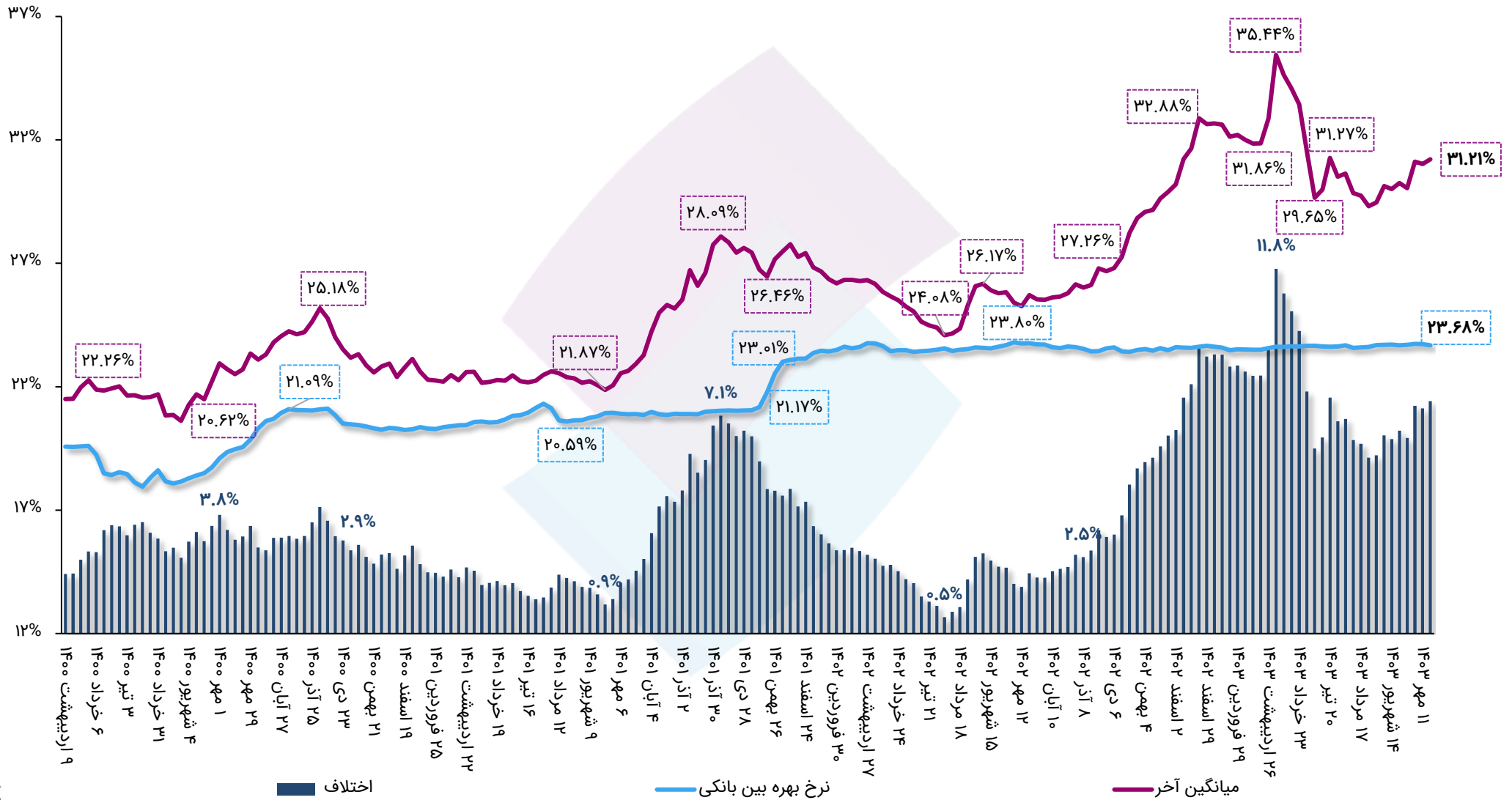
## بازده اوراق خزانه اسلامی در سررسیدهای متفاوت در بازار ثانویه



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

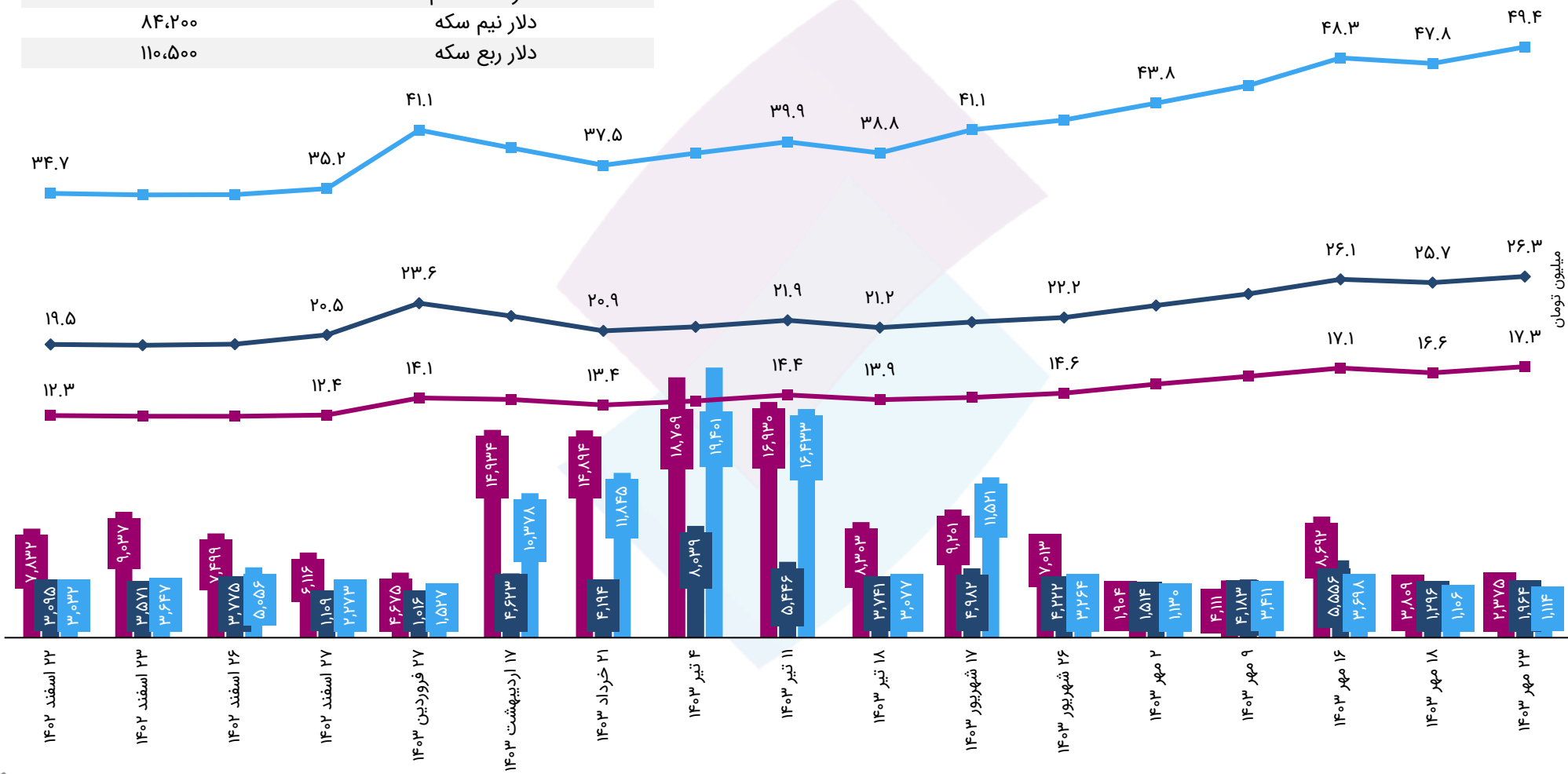


کاهش ۰.۰۵ واحد درصدی نرخ بهره بین بانکی تا رقم ۲۳.۶۸ درصد و اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخريد به ارزش ۲۴۹ همت



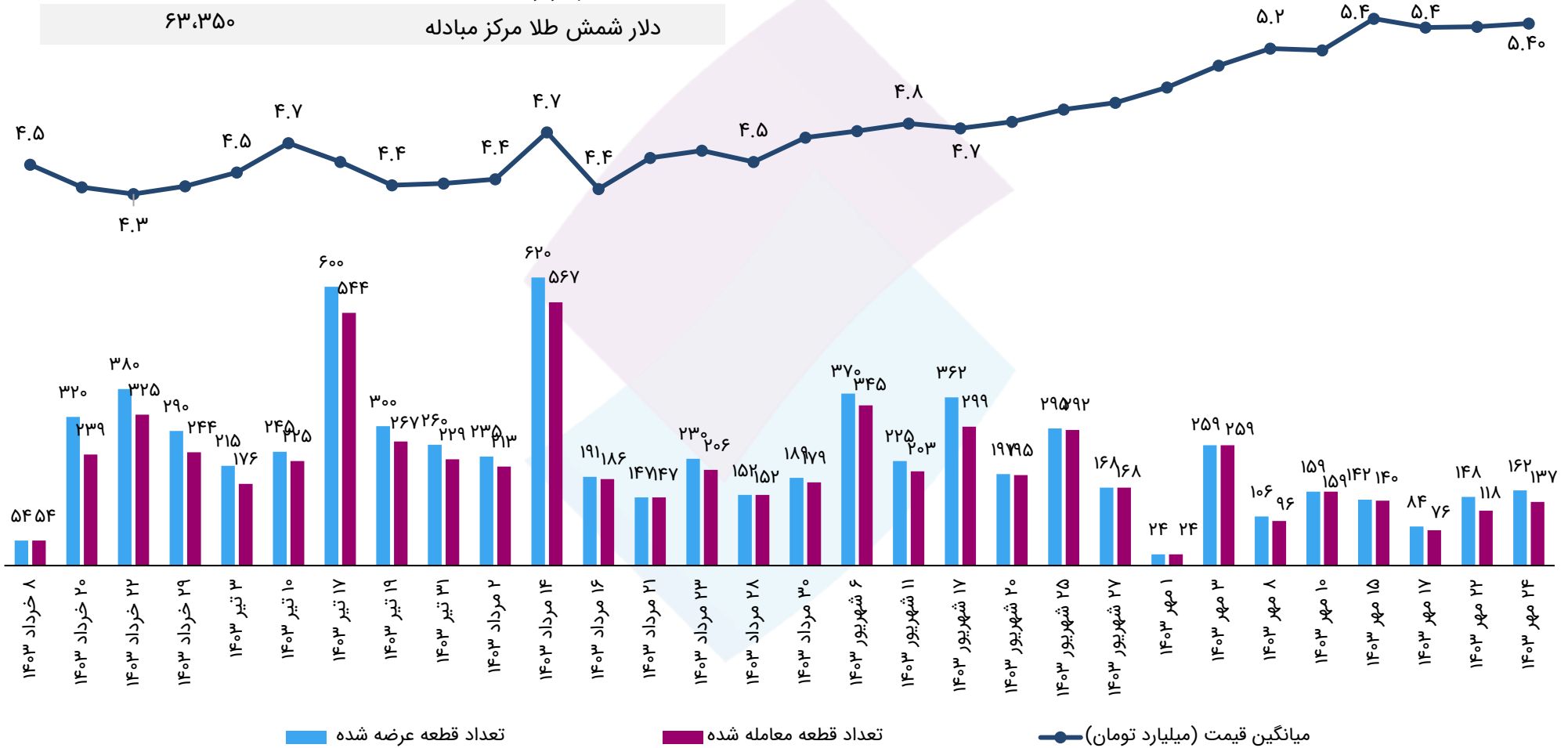
## معامله ۳۶۴ هزار و ۷۵۵ قطعه سکه در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان)
دلار مرکز مبادله	۵۰,۰۶۵
دلار سکه تمام	۷۹,۱۰۰
دلار نیم سکه	۸۴,۲۰۰
دلار ربع سکه	۱۱۰,۵۰۰



## معامله ۱۱ هزار و ۱۵ کیلوگرم شمش طلا در مرکز مبادله ایران

آخرین نرخ	مبلغ (تومان) در تاریخ آخرین حراج
دلار مرکز مبادله	۵۰،۱۱۲
دلار شمش طلا مرکز مبادله	۶۳،۳۵۰



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

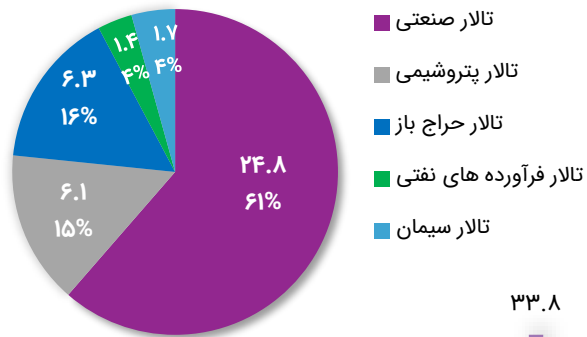
کاهش ۷.۱ درصدی گاز طبیعی در پی هشدار آمریکا و تصمیم رژیم صهیونیستی برای اجتناب از حمله به اهداف نفتی و هسته‌ای ایران

سال گذشته		ماه گذشته		هفته گذشته		آخرین قیمت	شرح
تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات	قیمت		
۳۹.۳%	۱,۹۲۳	۳.۷%	۲,۵۸۳	۲.۷%	۲,۶۰۸	۲,۶۷۹	طلا (دلار/انس)
۷۶.۶%	۲۸۸,۰۱۰	۱۶.۵%	۴۳۶,۷۵۰	۴.۱%	۴۸۸,۷۰۰	۵۰۸,۷۰۰	سکه (هزار ریال)
۲۱.۷%	۴۱۲,۲۲۲	۱.۵%	۴۹۴,۳۶۰	۰.۵%	۴۹۹,۴۴۸	۵۰۱,۸۶۴	دلار اسکناس (ریال)
۲۸.۹%	۳۷۴,۷۴۷	۴.۸%	۴۶۰,۷۲۷	۱.۷%	۴۷۴,۷۶۰	۴۸۳,۰۲۶	دلار حواله (ریال)
-۱۸.۹%	۹۱	۱.۰%	۷۳	-۳.۹%	۷۷	۷۴	نفت برنت (دلار/بشکه)
۱۳۹.۳%	۲۸,۴۱۶	۱۶.۹%	۵۸,۱۹۳	۱۲.۳%	۶۰,۵۸۲	۶۸,۰۱۲	بیت کوین (دلار)
۱۹.۸%	۷,۸۴۶	۲.۰%	۹,۲۱۶	-۱.۵%	۹,۵۴۹	۹,۴۰۱	مس LME (دلار/تن)
۲۶.۲%	۲,۳۷۵	۳.۵%	۲,۸۹۶	-۰.۱%	۳,۰۰۰	۲,۹۹۷	روی LME (دلار/تن)
۰.۹%	۴۷۸	۳.۸%	۴۶۵	۳.۱%	۴۶۸	۴۸۳	بیلت CIS (دلار/تن)
۰.۴%	۴۶۰	۰.۴%	۴۶۰	۱.۹%	۴۵۳	۴۶۲	بیلت ایران (دلار/تن)
۶.۴%	۲۸۲	۶.۰%	۲۸۳	۱.۷%	۲۹۵	۳۰۰	متانول CFR (\$/mt)
-۱۰.۳%	۳۹۷	۸.۰%	۳۳۰	۲.۳%	۳۴۸	۳۵۶	سبب اوره (mt/\$)
-۱۶.۰%	۲.۹۴	۱۰.۸%	۲.۲۳	-۷.۱%	۲.۶۶	۲.۴۷	گاز طبیعی Henry Hub (\$/MBtu)



## روند ارزش معاملات بورس کالا

سهام هر تالار از ارزش معاملات (هزار میلیارد تومان)

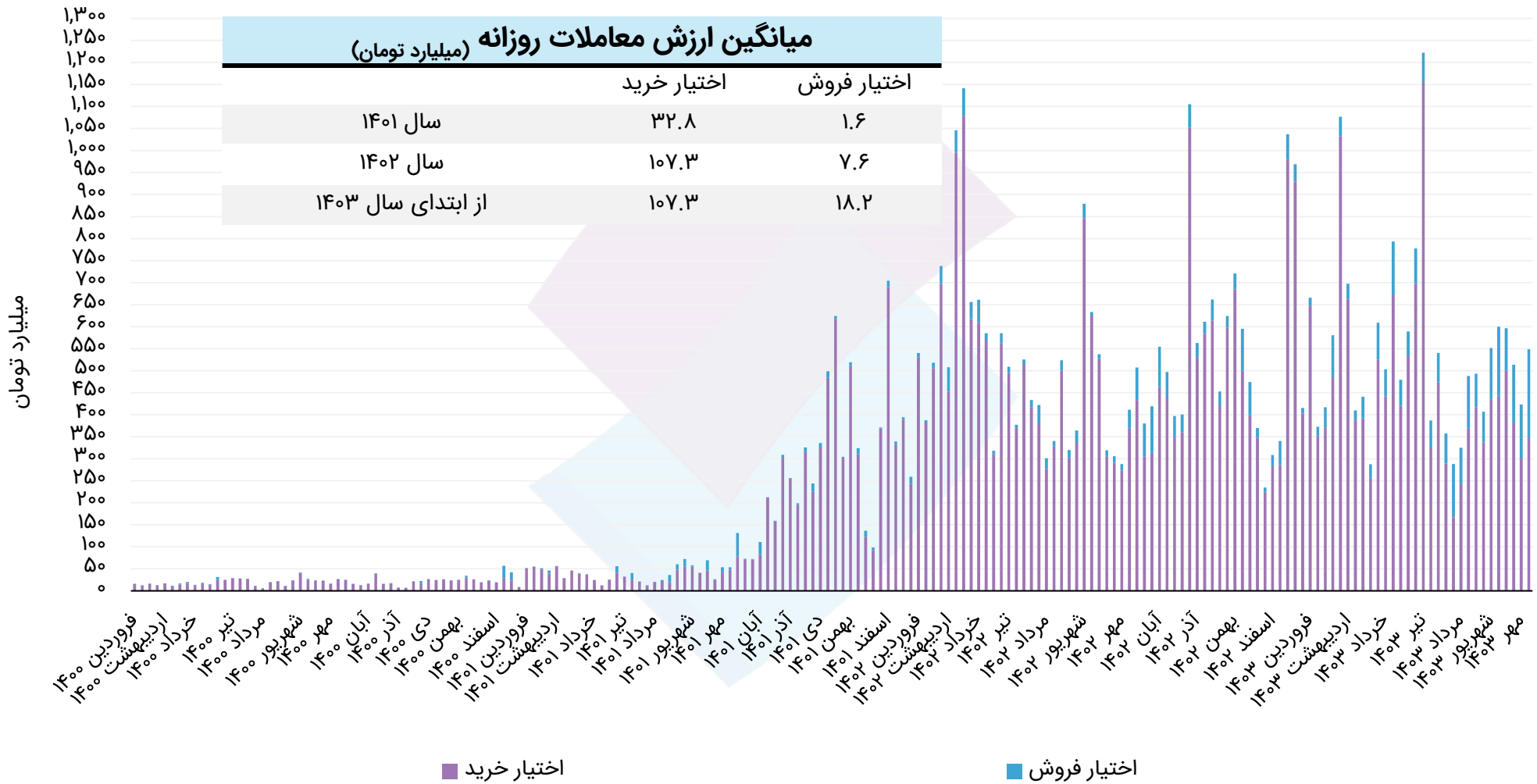


ارزش معاملات در تالارهای کشاورزی و خودرو لحاظ نشده است.

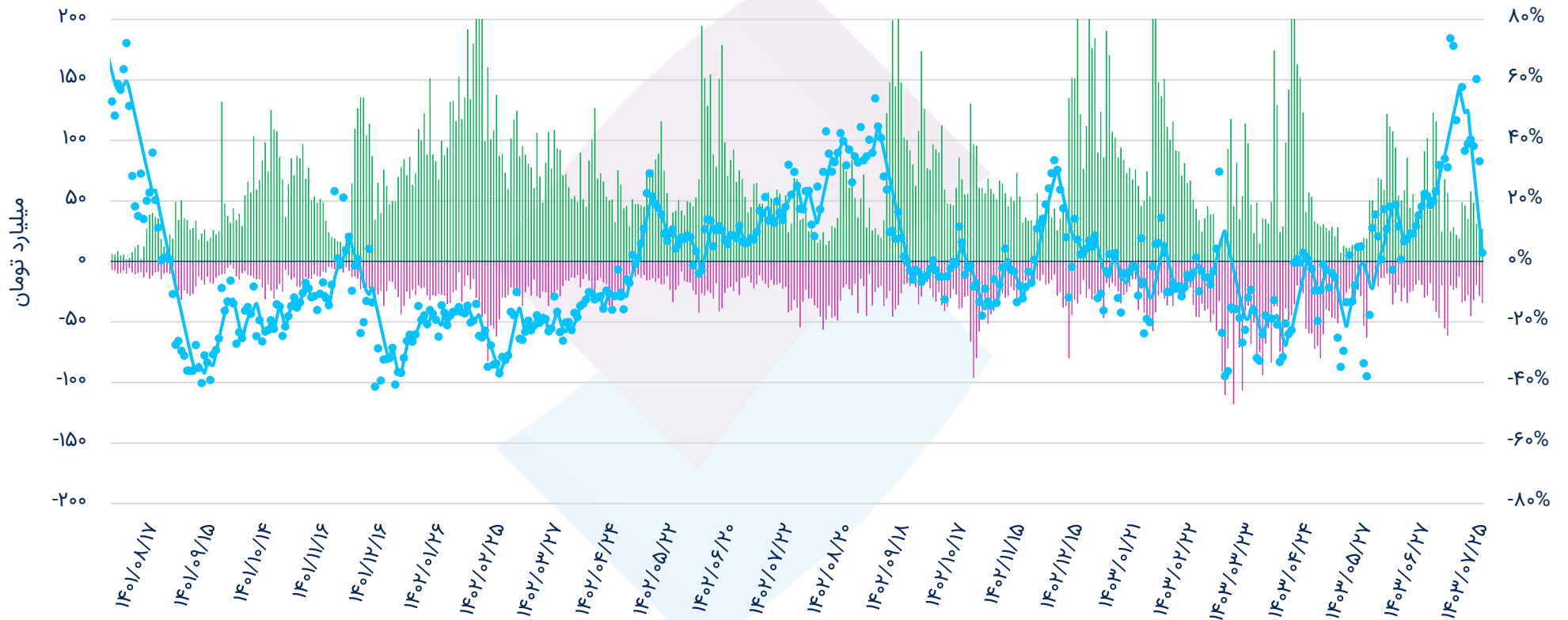
## کالاهای معامله شده در بورس کالا با بیشترین ارزش معاملات

شرح	قیمت (میلیون تومان بر تن)	حجم معاملات(تن)	عرضه کننده
ورق گرم	۳۰.۴	۲۴۰,۰۲۰	فولاد مبارکه اصفهان
آهن اسفنجی	۱۳.۷	۳۶۱,۵۵۰	توسعه آهن و فولاد گل گهر، صبا فولاد خلیج فارس، آهن و فولاد غدیر ایرانیان، سازمان توسعه و نوسازی معادن و صنایع معدنی ایران، پارس فولاد سبزوهار، احیاء استیل فولاد بافت
گندله سنگ آهن	۵.۵	۷۸۳,۰۰۰	معدنی و صنعتی گهر زمین (سنگ آهن گهر زمین)، صنعتی و معدنی اپال پارسین سنگان، معدنی و صنعتی گل گهر، ماد کوش، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، فولاد سیرجان ایرانیان
شمش بلوم	۲۲.۴	۱۶۷,۴۰۰	فولاد خوزستان، صنایع فولاد آلیاژی پاسارگاد (مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد)، شرکت معدنی و صنعتی چادرملو، آهن و فولاد ارفع، فولاد سیرجان ایرانیان، فولاد کاوه جنوب کیش، فولاد بوتیای ایرانیان، مجتمع فولاد خراسان
وکیوم باتوم	۱۶.۸	۱۳۷,۰۰۰	پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز، پالایش نفت شیراز
مس کاتد	۵۰۴.۴	۳,۵۰۰	ملی صنایع مس ایران
سیمان	۱.۴	۱,۲۷۲,۶۰۴	سیمان تهران، سیمان ساوه، سیمان آبیگ، سیمان صوفیان، سیمان مازندران، سیمان مدلل (صنایع سیمان سامان غرب)، سیمان ارومیه، سیمان هرمزگان، سیمان سپاهان، سیمان هگمتان، سیمان آرنا اردبیل، سیمان خوزستان
لوب کات	۲۱.۵	۵۳,۰۰۰	پالایش نفت اصفهان، پالایش نفت بندرعباس، پالایش نفت تهران (تندگویان)، پالایش نفت آبادان، پالایش نفت تبریز
مس مفتول	۵۳۴.۷	۱,۹۰۰	ملی صنایع مس ایران، صنایع تولیدی دنیای مس کاشان
تختال	۲۲.۰	۴۰,۰۰۰	فولاد خوزستان
شمش آلومینیوم	۱۶۹.۹	۵,۰۰۰	آلومینیوم ایران(ایرالکو)، مجتمع صنایع آلومینیوم جنوب، آلومینیوم المهدی، آلومینای ایران
پلی اتیلن ترفتالات	۵۱.۵	۱۲,۰۷۷	پتروشیمی تندگویان، پتروشیمی محب پلی استر خاوران
پلی پروپیلن نساجی	۴۹.۰	۱۲,۴۵۷	پتروشیمی مارون، دی آریا پلیمر، پلی پروپیلن جم (پتروشیمی جم پیلن)، پتروشیمی رجال، پتروشیمی شازند، پتروشیمی پلی نار، نوید زرشیمی
میلگرد	۲۷.۰	۲۲,۳۰۶	مجتمع فولاد خراسان، ذوب آهن اصفهان، فولاد آلیاژی ایران، جهان فولاد سیرجان، صنایع آهن و فولاد سرد ابرکوه، فولاد کاوه اروند، فولاد آذربایجان، آذر فولاد امین
پلی اتیلن سبک خطی	۵۱.۶	۱۰,۶۰۹	پتروشیمی امیرکبیر، پتروشیمی مهاباد، پتروشیمی شازند، پتروشیمی تبریز

## روند ارزش معاملات در بازار اختیار معامله



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



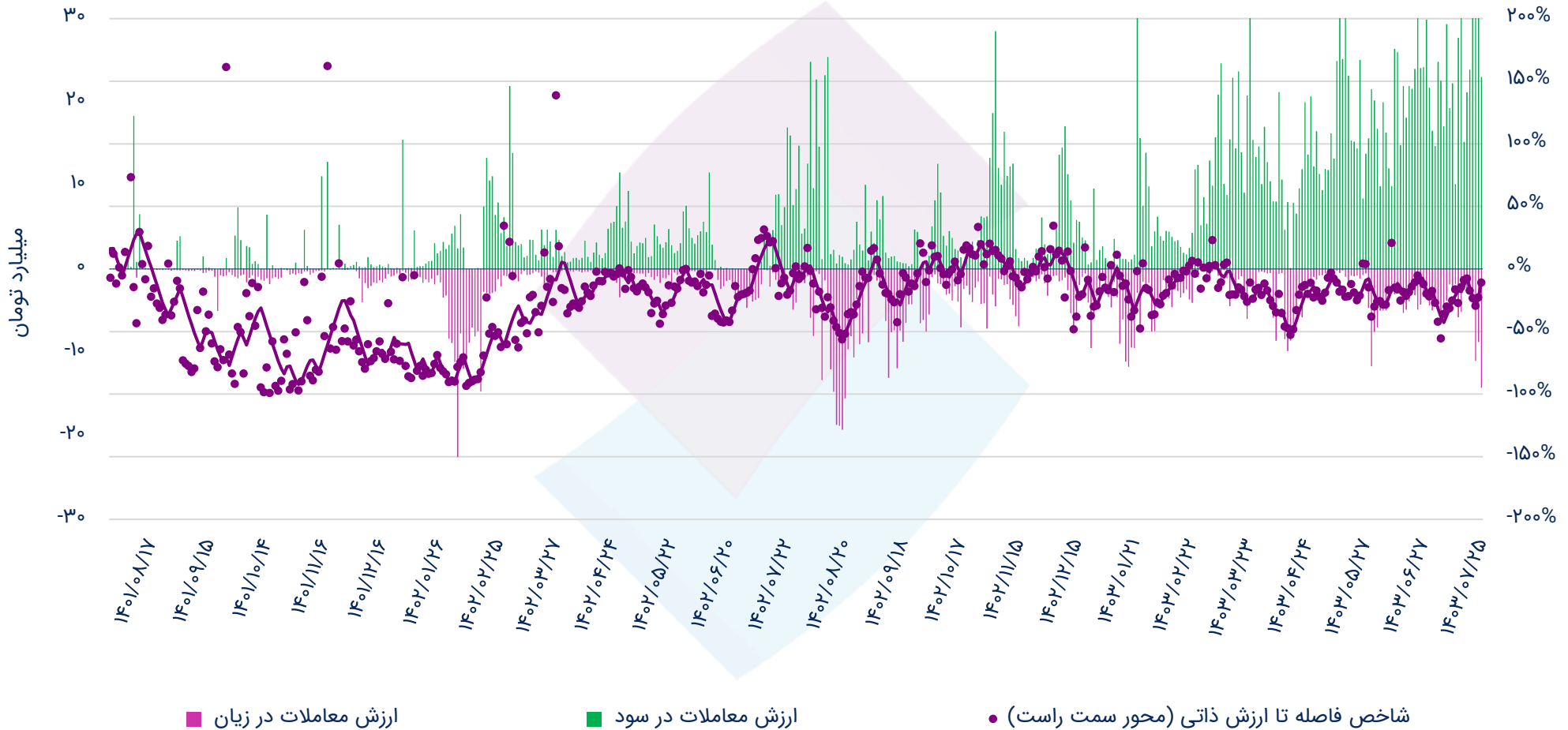
■ ارزش معاملات در سود     
 ● شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (محور سمت راست)     
 ■ ارزش معاملات در زیان

(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

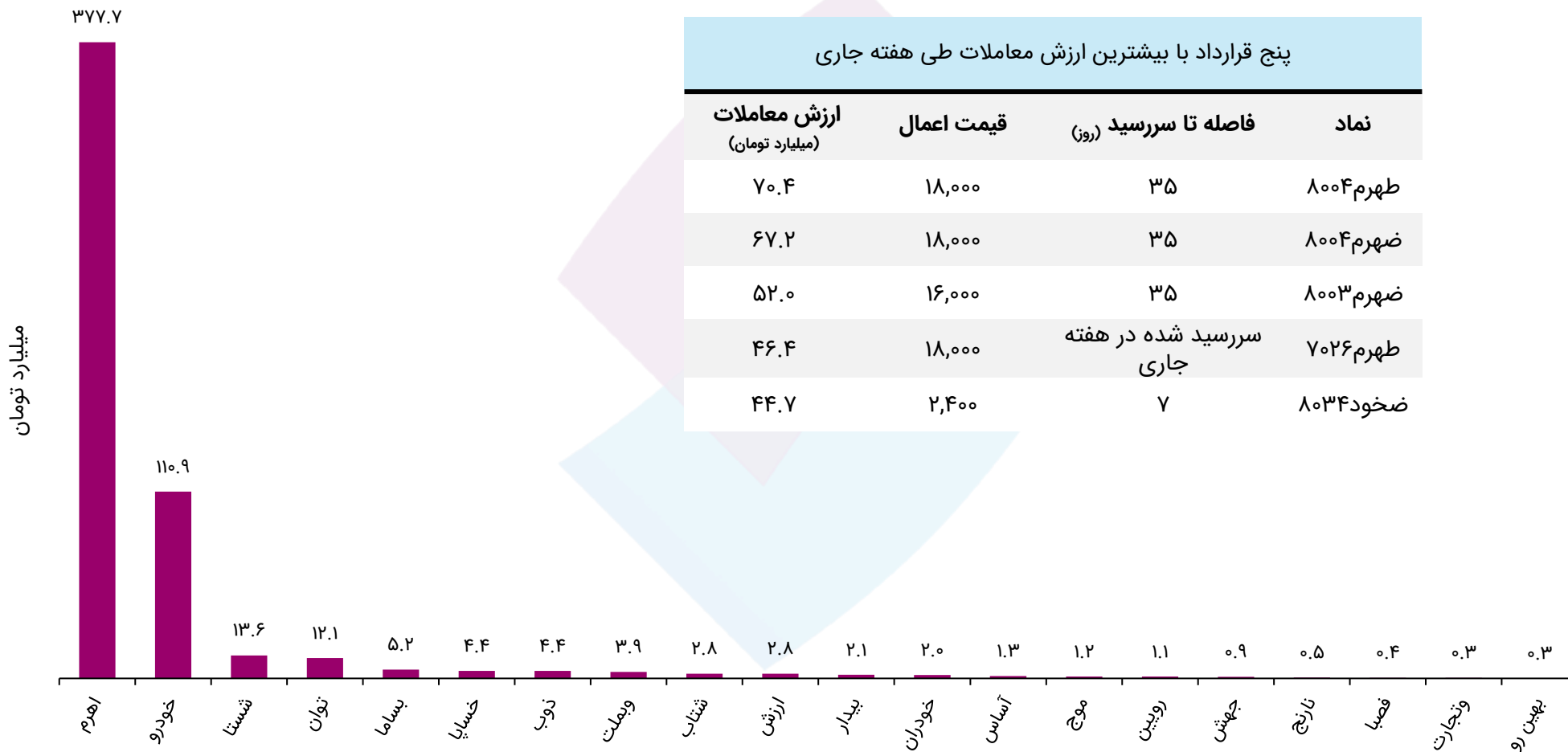


(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).  
 (۲) قرارداد در سود: قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه  
 (۳) قرارداد در زیان: قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه

# 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)
طهرم ۸۰۰۴	۳۵	۱۸,۰۰۰	۷۰.۴
ضهرم ۸۰۰۴	۳۵	۱۸,۰۰۰	۶۷.۲
ضهرم ۸۰۰۳	۳۵	۱۶,۰۰۰	۵۲.۰
طهرم ۷۰۲۶	سررسید شده در هفته جاری	۱۸,۰۰۰	۴۶.۴
ضخود ۸۰۳۴	۷	۲,۴۰۰	۴۴.۷



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

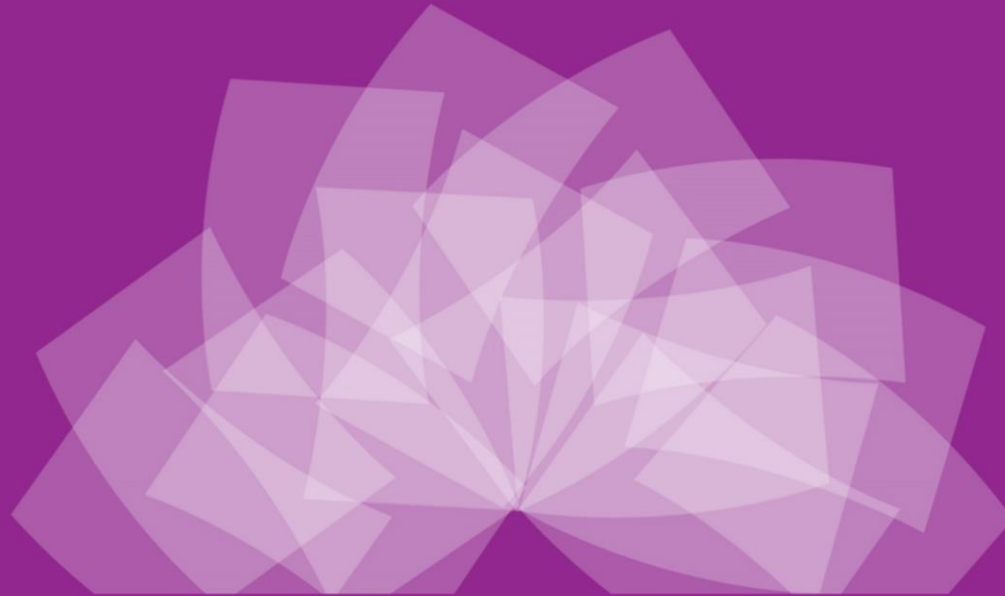




## سلب مسئولیت

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.nibbroker.com)