

تقرير اوبار كابيتال لمحفظه إفتراضية لسوق مسقط للأوراق المالية

المحتويات:

- تحليل أسهم مختارة باستخدام التحليل الفني من سوق مسقط للأوراق المالية.
- مستويات الدعم والمقاومة لأسعار الأسهم.
- وضع أهداف لأسعار الأسهم.
- تحديد وقف الخسائر لكل سهم.
- تحليل نسب العوائد والمخاطر.
- نتائج الأداء التاريخي.

اوبار كابيتال (U Capital)

ص.ب. 1137 ر.ب. 111 - البريد المركزي، سلطنة عُمان
هاتف: +96824949014
فاكس: +96824949099
الموقع الإلكتروني: www.u-capital.net



محفظة إفتراضية لاوبار كابيتال عن سوق مسقط للأوراق المالية مستويات الدعم والمقاومة – للأسهم التالية

اسم السهم	سوق مسقط	سعر الشراء	الهدف الأول T1	الحالة	الهدف الثاني T2	الحالة	العائد T1	العائد T2	معدل الدوران	وقف الخسارة	المخاطرة	تاريخ التوصية
بنك مسقط		0.446	0.460		0.462		3.14%	3.59%	0.05	0.440	-1.3%	2 فبراير 2020
عمان والامارات		0.063	0.065		0.066		3.17%	4.76%	0.04	0.066	5.1%	2 فبراير 2020
الشرقية للاستثمار		0.093	0.096		0.098		2.94%	5.38%	0.04	0.092	-1.1%	2 فبراير 2020
جلفار للهندسة		0.068	0.070		0.072		2.94%	5.88%	0.06	0.067	-1.5%	2 فبراير 2020
المتحدة للتأمين		0.340	0.350		0.352		2.94%	3.53%	0.03	0.338	-0.6%	2 فبراير 2020
اسمنت عمان		0.232	0.239		0.243		3.02%	4.74%	0.04	0.238	2.6%	2 فبراير 2020

توقعات أسعار الشركات التي تحققت خلال الاسبوع السابق

اسم السهم	سوق مسقط	السعر الحالي	السعر الشراء	الهدف الأول T1	الحالة	الهدف الثاني T2	الحالة	العائد T1	العائد T2	معدل الدوران	وقف الخسارة	المخاطرة	تاريخ التوصية
البنك الاهلي		0.140	0.135	0.139		0.141		2.96%	4.44%	0.06	0.134	-0.7%	26 يناير 2020
بنك العز الاسلامي		0.062	0.060	0.062		0.063		3.33%	5.00%	0.07	0.059	-1.7%	26 يناير 2020
الباطنة للطاقة		0.060	0.060	0.062		0.063		3.33%	5.00%	0.05	0.059	-1.7%	26 يناير 2020
مدينة مسقط		0.108	0.108	0.111		0.112		2.78%	3.70%	0.04	0.107	-0.9%	26 يناير 2020
عمانتل		0.624	0.624	0.642		0.648		2.88%	3.85%	0.03	0.622	-0.3%	26 يناير 2020
سيميكورب صلالة		0.140	0.140	0.144		0.145		2.86%	3.57%	0.05	0.139	-0.7%	26 يناير 2020

محقة قريبة من الهدف حد الخسارة

الأسبوع 05 - 2020 ربح / خسارة = +1.2%

الأداء الأسبوعي لآخر أربعة أسابيع

الأسبوع	رقم التقرير	نسبة الربح/الخسارة للمحفظه	مؤشر اوبار كابيتال عُمان 20	مؤشر سوق مسقط 30	مؤشر إم إس سي أي عمان
الأسبوع 05 - 2020	133	1.20%	0.82%	0.24%	-0.01%
الأسبوع 04 - 2020	132	2.90%	-0.85%	0.22%	-2.30%
الأسبوع 03 - 2020	131	3.10%	2.72%	2.10%	1.80%
الأسبوع 02 - 2020	130	0.20%	-0.46%	-0.70%	-1.00%

الأداء على أساس شهري

الشهر	رقم التقرير	نسبة الربح/الخسارة للمحفظه	مؤشر اوبار كابيتال عُمان 20	مؤشر سوق مسقط 30	مؤشر إم إس سي أي عمان
الشهر 01 - 2020	129-132	9.90%	3.36%	1.81%	0.70%
الشهر 02 - 2020	133-136	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 03 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 04 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 05 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 06 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 07 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 08 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 09 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 10 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 11 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الشهر 12 - 2020	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
الاداء منذ بداية العام		9.90%	3.36%	1.81%	0.70%

الأداء على أساس سنوي

السنة	نسبة الربح/الخسارة للمحفظه	مؤشر اوبار كابيتال عُمان 20	مؤشر سوق مسقط 30	مؤشر إم إس سي أي عمان
2015 - 2016 - 2017 - 2018	(57%) - (54%) - (60%) - (63%)	(-9%) - (-16%) - (4%) - (-12%)	(-15%) - (-14%) - (8%) - (-17%)	(-12%) - (-11%) - (1%) - (-12%)
2019	58%	-9%	-10%	2%
0	0%	0%	0%	0%
0	0%	0%	0%	0%

مستويات الدعم والهدف (المقاومة): هي المستويات المتوقعة خلال الاسبوع

وقف الخسارة: إذا تم تجاوز هذا المستوى ينبغي على العميل إغلاق مركزه أو جزء منه

المخاطرة: الفرق بين السعر ومستوى الدعم الأول

العائد T1: الفرق بين سعر الشراء ومستوى الهدف الأول

العائد T2: الفرق بين سعر الشراء ومستوى الهدف الثاني

جميع الأسعار مسعرة بالريال العماني، العوائد المحققة باستثناء تكاليف الصفقات

سعر الشراء هو آخر سعر للإغلاق، إذا سهم الشركة لم يحقق الأهداف المعلنة فإن إغلاق السهم يكون بإغلاق يوم الخميس أو عند سعر وقف الخسارة أيهما أعلى.

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	بنك مسقط: يتحرك السهم ضمن قناة صاعدة حيث غير السهم من اتجاهه من أدنى مستوى للقناة الى أعلى القناة. حالياً قطع السهم متوسط المتحرك لفترة 10 أيام للأعلى، لذا فإننا نتوقع في الفترة القصيرة القادمة أن يتجه السهم نحو مستوى 0.462 ر.ع. حالياً مؤشر مارك يغلق فوق مستوى خط الصفر.
0.385 ر.ع.	0.470 ر.ع.	1380.0 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
7.85%	0.75	7.4	

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	عمان والإمارات: عكس السهم الأسبوع السابق من اتجاهه نحو الأعلى. نلاحظ حالياً وجود تجميع عند هذه المستويات من قبل المستثمرين بدأت مع بداية الأسبوع الماضي. هذا ونتوقع أن يكون مستوى سعر السهم في الفترة القادمة عند مستوى 0.066 ر.ع.
0.058 ر.ع.	0.100 ر.ع.	7.8 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
-%	0.39	-	

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	الشرقية للاستثمار: حالياً يحاول السهم أن يقطع لأعلى القناة الصاعدة، نرى بأن عند هذه المستويات تعتبر نقطة دخول، ونتوقع خلال الفترة القادمة أن يكون الهدف عند 0.098 ر.ع.
0.072 ر.ع.	0.100 ر.ع.	8.4 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
5.38%	0.70	18.11	

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	جلفار للهندسة: حالياً يحاول السهم أن يقطع للأعلى القناة الصاعدة، نرى بأن عند هذه المستويات هي نقطة دخول، ونتوقع خلال الفترة القادمة أن يكون الهدف عند 0.072 ر.ع.
0.066 ر.ع.	0.102 ر.ع.	69.1 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
-%	0.38	-	

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	المتحدة للتامين: حالياً يشير كلا من مؤشر القوة النسبية، مؤشر التذبذبات النقدية ومؤشر الماكد بأن سعر السهم جاذب للشراء، حالياً السهم قطع للأعلى منحني المتوسط المتحرك الآسي لفترة 14 يوم والمتوسط المتحرك الآسي لفترة 5 أيام. نتوقع هذا الأسبوع أن يقطع سعر السهم مستوى المقاومة عند 0.340 ر.ع. للأعلى. وعليه فإننا نتوقع بعد قطع هذا المستوى أن يكون الهدف الأول للسهم عند 0.352 ر.ع.
0.16 ر.ع.	0.34 ر.ع.	34.0 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
8.82%	1.24	11.56	

أقل سعر – 52 أسبوع	أعلى سعر – 52 أسبوع	القيمة السوقية - مليون	اسمنت عمان: يشير مؤشر القوة النسبية بأنه (أقل من مستوى 50 نقطة) عند 41.71 نقطة، ويعزز مؤشر الماكد بشكل إيجابي بدعم السهم، حالياً السعر عند مستويات جيدة للتجميع. لذا نتوقع بأن يكون الهدف القادم للفترة المتوسطة عند 0.243 ر.ع.
0.198 ر.ع.	0.295 ر.ع.	78.7 ر.ع.	
عائد التوزيعات %	مكرر القيمة الدفترية	مكرر الربحية	
12.61%	0.53	9.29	

المصدر: بلومبيرج

المؤشرات الفنية الرئيسية:

مؤشر الماكد MACD: هو أحد أبسط المؤشرات الفنية وأكثرها موثوقية واعتمادية، والماكد يعتمد في تكوينه على المتوسطات المتحركة بحيث يتم طرح المتوسط المتحرك الأسرع من المتوسط المتحرك الأبطأ وبذلك يتكون لدينا خط يتحرك فوق وتحت مستوى الصفر. ولا يوجد حد أعلى أو أدنى للماكد حيث أنه يعتمد على الفرق ما بين القيمتين السابقتين. أشهر صيغة لمؤشر الماكد MACD وهي الصيغة القياسية التي تستخدمها معظم الرسوم البيانية هي الفرق مابين المتوسط المتحرك الآسي لفترة 26 يوم والمتوسط المتحرك الآسي لفترة 12 يوم، كما ونستخدم أيضاً المتوسط المتحرك للماكد لفترة 9 أيام وهو المتوسط المتحرك للماكد وليس لسعر السهم.

مؤشر القوة النسبية RSI: هو مؤشر تقني يستخدم في تحليل الأسواق المالية. ويهدف إلى رسم القوة الحالية والتاريخية لحركة الاسهم على أساس أسعار الإغلاق لفترة التداول الأخيرة. ويصنف مؤشر القوة النسبية باعتباره مؤشر من مؤشرات الزخم، حيث يقيس سرعة وحجم اتجاه حركة الأسعار. يقسم المؤشر إلى أرقام تبدأ من 1 إلى 100 نقطة، حيث إن تشكل القمم والقيعان في الرسم البياني يفسر بوصول مؤشر القوة النسبية RSI فوق 70 أو تحت 30، وتعتبر قراءات مؤشر القوة النسبية الأعلى من مستوى 70 دليل على وجود منطفة "نزوة الشراء"، وتعتبر قراءات مؤشر القوة النسبية الأقل من مستوى 30 الدليل على وجود منطقة "نزوة البيع". وفي حال وجود المؤشر بين مستويي 30 و 70 فهذا دليل على الحيادية، في حين ان وصول المؤشر الى مستوى 50 فهو علامة على عدم وجود اي اتجاه.

مؤشر التدفقات النقدية (Money Flow Index): يعتبر مؤشر التدفقات النقدية من المؤشرات الفنية التي تقيس كثافة التدفقات النقدية من خلال رصد معدلات النمو خلال فترة زمنية معينة. ومن خلال هذا المؤشر يمكن تحديد أفضل سعر للبيع والذي يسمى بقمة البيع & أفضل سعر للشراء المسمى بقمة الشراء. يرصد المؤشر قمة البيع في حالة إنخفاضه دون 20، لتظهر إشارة الشراء بعد ذلك عندما يتخطى المؤشر قمة الشراء من الأسفل. ويرصد المؤشر قمة الشراء في حالة إرتفاعه عن 80، لتظهر بعد ذلك إشارة البيع عندما يتخطى المؤشر قمة البيع من الأعلى.

مؤشر البولينجر بالد: هو مؤشر رسم بياني ابتكره جون بولينجر، ويستخدم لقياس تقلبات السوق. في الأساس، تشير هذه الاداة اذا كان السوق هادئاً ام متذبذباً! عندما يكون السوق هادئاً فإن خطوط البولينجر تقترب من بعضها. وعندما تكون متذبذبة فإن خطوط البولينجر تبتعد عن بعضها.

مؤشر المتوسط المتحرك: المتوسط المتحرك في التحليل الفني هو مؤشر لقياس الاتجاه يتم رسم المتوسط المتحرك في صورة خط على الرسم البياني ويُستخدم في عرض متوسط قيمة أصل ما خلال مدة زمنية محددة. في هذا التقرير نستخدم 5،11، و21 و50 يوماً لحساب المتوسط المتحرك.

لمزيد من المعلومات والتوضيحات حول هذا التقرير التواصل مع الفاضل بشير الروسان على هاتف رقم +968 24949014

إخلاء المسؤولية

تم إعداد هذا التقرير بواسطة اوبار كابيتال (U Capital) لأغراض توفير المعلومات فقط. وتحت أي ظرف لا يجوز استخدام هذا التقرير كتوصية ولا يجوز اعتباره عرضاً لبيع أو شراء أي أوراق مالية. ومع حرصنا الشديد على أن تكون المعلومات الواردة في التقرير صحيحة أو غير مضللة في وقت النشر إلا أننا في نفس الوقت لا نؤكد دقتها أو اكتمالها. وبناءً عليه يجب ألا يعتمد عليها بشكل كامل. كما لا نتحمل بأية حال من الأحوال أي مسؤولية مباشرة أو غير مباشرة عن أي خسارة تنتج عن أي استخدام لهذا التقرير أو محتوياته. هذا ولا يجوز إعادة نسخ هذا التقرير أو توزيعها أو نشرها بواسطة أي متلقي لأي غرض من الأغراض.