

GALP ENERGIA

GALP ENERGIA gehört zur Branche Energie und dort zum Sektor Öl & Gas Produzenten.

Mit einer Marktkapitalisierung von 16,09 Milliarden US Dollar zählt sie zu den large-cap Gesellschaften.

Während der letzten 12 Monate lag der Kurs zwischen EUR 20,54 und EUR 11,98. Der aktuelle Preis von EUR 18,71 liegt 8,9% unter ihrem höchsten und 56,2% über ihrem tiefsten Wert in dieser Periode.

Ergebnis seit 1. August 2023: GALP ENERGIA: 56,2%, Energie: 5,9%, STOXX600: 6,6%

Gesamteindruck



Name	Markt	Kurs	Perf YtD	Börs.-Kap. (\$ Mia.)	Sterne	Sensitivität	LF P/E	LF Wachstum	Dividende	4W Rel. Perf.	Gesamteindruck
GALP ENERGIA	PT	18,71	40,3%	16,09	★★★★		13,4	8,1%	3,1%	-5,6%	
Energie (ENE@EP)	EP	57,00	0,4%	1.079,16	★★★★		7,9	6,9%	5,1%	-0,7%	
STOXX600	EP	498,00	3,9%	15.071,07	★★★★		11,3	10,9%	3,7%	-2,6%	

Schlüsselpunkte

- ✓

Die Gewinnprognosen wurden seit dem 23. Juli 2024 nach oben revidiert.
- ✓

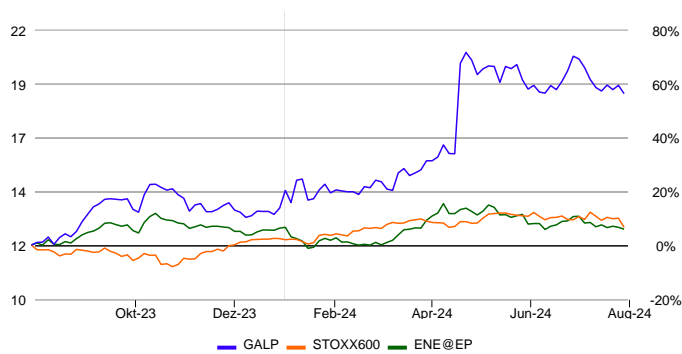
Die Aktie verhielt sich seit über einem Jahr bei Marktturbulenzen defensiv.
- ✓

Die Performance in diesem Jahr ist mit 40,3% deutlich besser als die 3,9% des STOXX600.
- ✗

Die erwartete Dividende von 3,1% liegt wesentlich unter dem Branchendurchschnitt von 5,1%.
- ✗

Das prognostizierte KGV von 13,4 ist relativ hoch, 69,0% über dem Branchendurchschnitt von 7,9.

Performance 1. August 2023 - 2. August 2024



Checkliste / Letzte Änderung / Ziel

Nyon, 03-Aug-2024 06:30 GMT+1

	GALP		Die letzte Analyse bestätigt die am 10. Mai 2024 aufgezeichneten Änderungen. Der Gesamteindruck bleibt bei "Eher Positiv".
Gesamteindruck			Verschlechterung von positiv auf eher positiv am 10-Mai-2024.
Sterne	★★★★	★★★★	Zwei Sterne seit dem 26-Jul-2024.
Gewinnrevisionen	★	★	Positive Analystenhaltung seit 23-Jul-2024. Die positiven Gewinnrevisionen begünstigen diese Aktie in einem durch die Analysten belasteten Umfeld.
Potenzial	★	★	Fairer Preis. Aufgrund der Analyse des fundamentalen Kurspotentials erscheint der Titel zur Zeit fair bewertet.
MF Tech. Trend	★	★	Negative Tendenz seit dem 16-Jul-2024. Die negative technische Tendenz ist Teil einer allgemeinen Schwäche der Branche, das heisst systemischer Natur.
4W Rel. Perf.	★	★	[!] Unter Druck (vs. STOXX600). Der Titel als auch sein Umfeld performten in den letzten vier Wochen schlechter als der Markt.
Sensitivität			Gesamthft wird die Sensitivität von GALP ENERGIA im Vergleich zu anderen Aktien als eher tief eingeschätzt und dies seit mehr als einem Jahr.
Zielpreis	21,22 EUR		Per 2. August 2024 lag der Schlusskurs der Aktie bei EUR 18,71 mit einem geschätzten Kursziel von EUR 21,22 (+13%).

GALP ENERGIA - Branchenvergleich

Name	Symbol	Markt	Kurs	Perf YtD	Börs.-Kap. (\$ Mia.)	Sterne	Sensitivität	LF P/E	LF Wachstum	Dividende	% zum Ziel	Gesamteindruck
GALP ENERGIA	GALP	PT	18,71	40,3%	16,09	★★★★☆		13,4	8,1%	3,1%	13,4%	
SAUDI ARABIAN OIL	SAO	SA	27,50	-16,8%	1.773,92	★★★★☆		15,3	8,1%	5,7%	7,5%	
EXXON MOBIL	XOM	US	116,88	16,9%	524,63	★★★★☆		11,7	8,9%	3,4%	8,4%	
CHEVRON	CVX	US	148,55	-0,4%	281,27	★★★★☆		9,9	8,9%	4,5%	14,5%	
SHELL PLC	SHELL	GB	2.777,00	8,0%	225,69	★★★★☆		8,1	4,9%	4,0%	8,3%	
SHELL PLC	SHELL	NL	32,81	10,1%	225,69	★★★★☆		8,2	5,0%	4,0%	8,6%	
PETROCHINA CO LTD	601857	CN	8,86	25,5%	220,71	★★★★☆		8,6	6,7%	5,4%	23,8%	
PETROCHINA CO LTD	857	HK	6,81	32,0%	220,71	★★★★☆		6,1	5,5%	7,5%	23,4%	
TOTALENERGIES	TTE	FR	61,14	-0,8%	156,45	★★★★☆		7,3	4,0%	5,3%	12,2%	
CONOCOPHILLIPS	COP	US	105,77	-8,9%	126,20	★★★★☆		11,2	8,0%	3,0%	15,2%	

Fundamentale und Technische Analyse

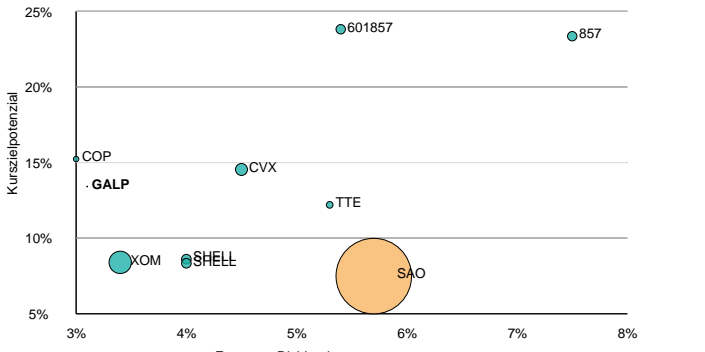
Analyse des Preises ★
Wir bewerten den Preis von GALP ENERGIA, indem wir diesen mit einem theoretisch fairen Wert vergleichen. Dazu kombinieren wir die PEG Methode, welche das prognostizierte Gewinnwachstum inklusive Dividende mit dem Kurs/Gewinnverhältnis vergleicht, mit unseren Erfahrungswerten. Auf dieser Basis stellen wir fest, dass:
- GALP ENERGIA fundamental betrachtet nahe bei seinem theoretisch fairen Kurs liegt.
- Die Bewertung weniger attraktiv ausfällt als beim Durchschnitt der europäischen Branche Energie.
Das fundamentale Kurspotenzial von GALP ENERGIA ist angemessen.

Gewinnprognosen ★
GALP ENERGIA erfreut sich grosser Aufmerksamkeit bei den Finanzanalysten, publizieren doch pro Quartal durchschnittlich deren 18 Gewinnprognosen für das Unternehmen bis ins Jahr 2026.
Zur Zeit revidieren diese Analysten ihre Gewinnprognosen nach oben um 2,5% über den Vergleichswerten vor sieben Wochen. Dieser Aufwärtstrend bei den Gewinnaussichten besteht seit dem 23. Juli 2024.

Technische Tendenz und Relative Stärke ☆☆☆
Die Aktie befindet sich in einem mittelfristigen Abwärtstrend, welcher am 16. Juli 2024 bei EUR 18,98 eingesetzt hat.
Die dividendenbereinigte relative Performance zum STOXX600 über vier Wochen beträgt -5,6%, wobei die ebenfalls negative technische Tendenz den schlechten Wert bestätigt. Die Investoren richten ihr Interesse auf andere Aktien.
Die Referenzbranche Energie registriert über die letzten 4 Wochen gesehen eine Unterperformance.

Dividende
Für die kommenden 12 Monate wird eine Dividendenrendite von 3,1% erwartet, für deren Ausschüttung GALP ENERGIA 40,8% des Gewinns verwenden muss (Dividendenlast). Die Dividende ist zwar gedeckt, der dafür benötigte Anteil vom Gewinn ist aber eher hoch. Die Kontinuität der Dividende erscheint wahrscheinlich.

Erwartete Dividende vs. % Kursziel



Die Grösse der Punkte ist proportional zur Marktkapitalisierung der Unternehmen und die Farbe abhängig vom Gesamteindruck bei theScreener.

Sensitivitätsanalyse vs STOXX600

Beta 0,69 reagiert der Kurs von GALP ENERGIA auf eine Indexschwankung von 1% durchschnittlich mit einem Ausschlag von 0,69%.
Korrelation 0,21 Dies bedeutet, dass 4% Bewegungen des Wertpapiers durch Veränderungen des Index erklärt werden können.
Volatilität 1 Monat: 15,0%, 12 Monate: 31,9%.

Anfälligkeit bei Sinkenden Märkten
Der Bear Market Factor misst das Verhalten einer Aktie bei nachgebenden Märkten. GALP ENERGIA hat dabei die Tendenz allgemeine Abwärtsbewegungen des STOXX600 abzuschwächen. Sie ist damit ein defensiver Wert bei Marktkorrekturen, da sie die Tendenz hat, Indexrückgänge um durchschnittlich -0,96% weniger stark nachzuvollziehen.

Anfälligkeit bei steigenden Märkten
Der Bad News Factor misst Rückschläge des Aktienkurses bei steigenden Märkten. GALP ENERGIA zeigt dabei eine niedrige Anfälligkeit auf unternehmensspezifischen Druck. Sinkt der Kurs bei steigenden Märkten, so waren die Kursabschläge meist unterdurchschnittlich. Sinkt die Aktie in einem steigendem Umfeld, beträgt ihre durchschnittliche Abweichung -2,09%.

Zusammenfassung der Sensitivitätsanalyse
Gesamthaft wird die Sensitivität von GALP ENERGIA im Vergleich zu anderen Aktien als eher tief eingeschätzt und dies seit mehr als einem Jahr.

Schlussfolgerung

Die Aktie erfüllt aktuell zwei unserer vier Sterne. Die Analysten waren optimistisch und korrigierten ihre Gewinnerwartungen nach oben und der Kurs lag am 2. August 2024 bei seinem fundamental fairen Wert. Aus technischer Sicht ist die Aktie hingegen unter Druck. Der Kurs konnte sich in letzter Zeit nicht vom STOXX600 Index abheben, auch absolut fand der Markt die Aktie wenig attraktiv. Das Branchenumfeld sieht mit aktuell einem Stern wenig freundlich aus. Der Kurs der Aktie hat in der Vergangenheit mit unterdurchschnittlichen Kursverlusten auf Stresssignale reagiert. Dieses defensive Kursverhalten werten wir als positiv. Es ist ein wichtiges, dem Sternerating ebenbürtiges, Bewertungskriterium. Unter dessen Berücksichtigung ergibt sich ein leicht positiver Gesamteindruck.

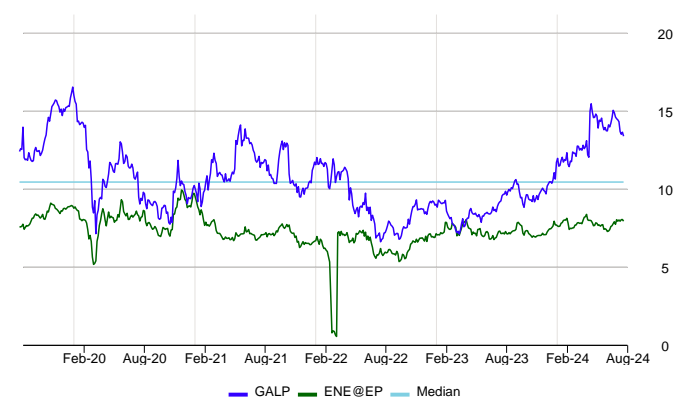
Nyon, 03-Aug-2024 06:30 GMT+1

Kennzahlen

Bewertung auf Basis der Gewinnprognosen für das laufende Jahr bis Ende	2026
Prognostiziertes Kurs-Gewinn-Verhältnis (LTPE) für 2026	13,4
Prognostiziertes Gewinnwachstum (LT Growth)	8,1%
Dividende (Ex Date : 29-Mai-2024)	EUR 0,27
Anzahl Analysten	18
Datum der ersten Analyse	23-Feb-2007
Finanzkennzahlen - 2023	

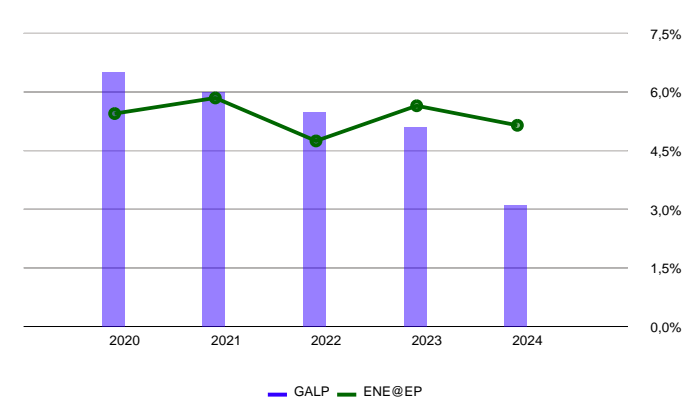
GALP ENERGIA - Entwicklung über 5 Jahre

KGV Entwicklung 2. August 2019 - 2. August 2024



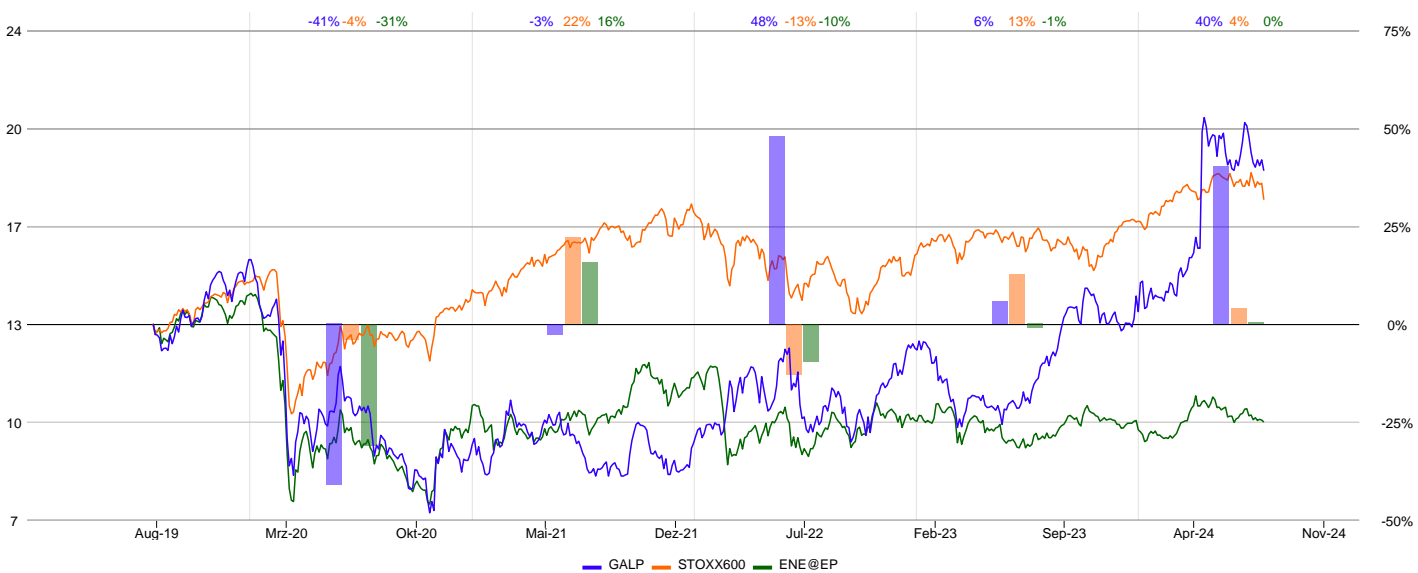
GALP ENERGIA ist mit einem vorausschauenden KGV von 13,36 deutlich höher bewertet als der Durchschnitt der Branche Energie mit 7,91. Der aktuelle Preis beinhaltet bereits optimistische Zukunftsaussichten für das Unternehmen. Auch historisch betrachtet erscheint das KGV eher hoch, liegt es doch über seinem fünfjährigen Median von 10,42.

Erwartete Dividendenrendite 2020 - 2024



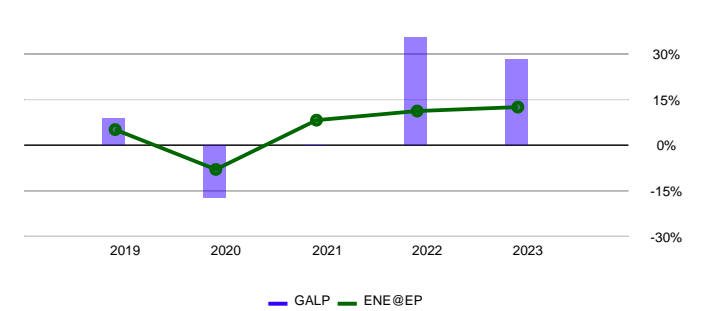
Die geschätzte Dividendenrendite für die nächsten 12 Monate beträgt 3,1%, während der Durchschnittswert der Branche von GALP ENERGIA mit 5,1% höher liegt. Wie erwähnt, entspricht diese Dividende 40,8% des erwarteten Gewinns. Die Dividende erscheint damit ausreichend gedeckt. Die aktuelle Schätzung der erwarteten Dividende liegt unter dem historischen Durchschnitt von 5,2%.

Performance 2. August 2019 - 2. August 2024



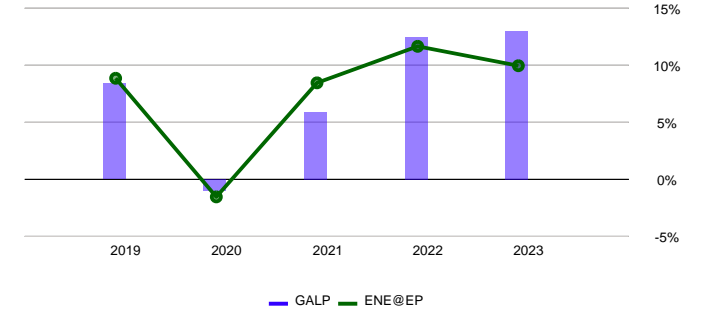
Galp Energia, SGPS, S.A. ist als integriertes Energieunternehmen in Portugal und international tätig. Das Unternehmen ist in vier Segmenten tätig: Upstream, Industrial & Midstream, Commercial sowie Renewables and New Business. Das Upstream-Segment befasst sich mit der Exploration, Erschließung und Förderung von Kohlenwasserstoffen hauptsächlich in Brasilien, Mosambik, Namibia und Angola. Das Segment Industrial & Midstream besitzt Raffinerien in Portugal und ist an Aktivitäten im Zusammenhang mit dem Energiemanagement von Ölprodukten, Gas und Strom beteiligt. Dieses Segment stellt Infrastrukturen für die Lagerung und den Transport von Öl- und Gasprodukten zur Verfügung und ist in Portugal und Spanien am Verkauf von Strom in das Netz beteiligt. Das Segment Commercial ist in den Bereichen Einzelhandel an Endkunden (Business-to-Business) und Business-to-Consumer von Öl, Gas und Strom tätig. Das Segment Erneuerbare Energien und neue Geschäftsfelder befasst sich mit der Entwicklung von Solar- und Windenergieprojekten in Portugal und Spanien. Darüber hinaus produziert das Unternehmen Lithium-Ionen-Batterien, Wasserstoff und Biokraftstoffe und betreibt Tankstellen. Darüber hinaus ist das Unternehmen im Rückversicherungsgeschäft tätig. Das Unternehmen war früher als Galp "Petróleos e Gás de Portugal, SGPS, S.A. bekannt und änderte im September 2000 seinen Namen in Galp Energia, SGPS, S.A.. Galp Energia, SGPS, S.A. wurde 1999 gegründet und hat seinen Hauptsitz in Lissabon, Portugal.

Eigenkapitalrendite



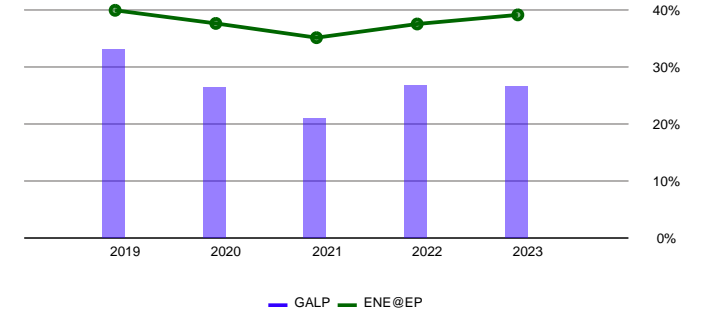
Die Eigenkapitalrendite (engl. ROE oder Return on Equity) zeigt das Verhältnis zwischen erwirtschaftetem Gewinn und vorhandenen Eigenmitteln. Bei GALP ENERGIA lag der mittlere ROE bei 11% und damit über dem Branchendurchschnitt von 5%, was auf eine effiziente Eigenmittelverwendung hinweist. Die letzte publizierte Eigenmittelrendite von 28% liegt über dem langjährigen Durchschnitt von 11%.

Gewinn vor Zinsen und Steuern (EBIT)



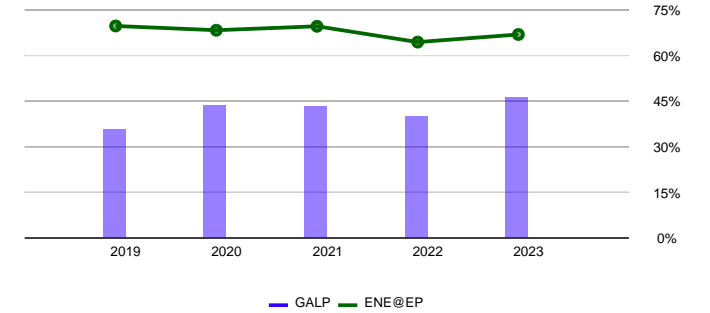
Die operative Gewinnmarge (EBIT) von GALP ENERGIA liegt im historischen Mittel bei 8%. Dies entspricht in etwa dem Branchendurchschnitt von 8%. Die zuletzt ausgewiesenen 13% liegen über dem historischen Mittel von 8%.

Eigenmittelanteil der Bilanz



Die Grafik stellt den Anteil der Eigenmittel an der Bilanzsumme dar. Je höher der Wert, desto konservativer ist das Unternehmen finanziert. GALP ENERGIA weist einen durchschnittlichen Eigenfinanzierungsgrad von 27% auf und liegt damit unter dem Branchendurchschnitt von 37%. Die aktuellen 27% liegen nahe beim historischen Mittel von 27%.

Book Value / Price



Hier wird der Buchwert des Unternehmens im Verhältnis zum Börsenwert dargestellt. Je grösser die Kennzahl, umso mehr Buchwert erhält man relativ zum Börsenkurs. Der Mittelwert von GALP ENERGIA liegt mit 42% unterhalb des Branchendurchschnittes von 68%. Mit 46% liegt der aktuelle Wert nahe beim historischen Durchschnitt von 42%.

Bilanz / Erfolgsrechnung

	2021	2022	2023	
	😊	😊	😊	
in Millionen	31-Dec EUR	31-Dec EUR	31-Dec EUR	
Flüssige Mittel + kurzfr. Guthaben	2.934	2.771	2.407	14%
Forderungen	2.267	2.409	2.173	13%
Inventar	1.007	1.361	1.447	9%
Kurzfristige Aktiven	6.208	7.041	6.718	40%
Sachanlagen	6.248	6.816	7.659	46%
Immaterielle Aktiven	730	742	703	4%
Total Aktiven	14.427	15.537	16.606	100%
Verbindlichkeiten	811	1.005	1.268	8%
Kurzfristiges Fremdkapital	1.469	982	842	5%
Total kurzfristige Passiven	4.539	4.314	4.376	26%
Lfr. Fremdkapitalquote	4.010	4.282	4.569	28%
Eigenkapital	3.022	4.145	4.409	27%
Total Passiven	14.427	15.537	16.606	100%

Kennzahlen

Book Value	3,68	5,10	6,17
Anzahl Aktien ('000)	829.251	815.112	715.003
Anzahl Mitarbeiter	6.152	6.715	7.054

Erfolgsrechnung

	2021	2022	2023	
	😊	😊	😊	
in Millionen	31-Dec EUR	31-Dec EUR	31-Dec EUR	
Umsatz	16.441	27.161	20.769	100%
Kosten	13.112	22.212	17.000	82%
Bruttogewinn	2.369	3.588	2.789	13%
Admin- & Gemeinkosten	-	-	335	2%
Forschung & Entwicklung	-	-	-	-
Betriebsertrag	1.965	3.022	2.207	11%
Abschreibungen	960	1.361	947	5%
Gewinn vor Extras	4	1.475	2.586	12%
Gewinn vor Steuern	954	3.362	2.697	13%
Dividenden	0	0	422	2%
Reingewinn	4	1.475	1.242	6%

Ratios

Current Ratio	1,4	1,6	1,5
Langfristiges Eigenkapital	27,8%	27,6%	27,5%
Umsatz zu Aktiven	114,0%	174,8%	125,1%
Cash flow zu Umsatz	5,9%	10,4%	10,5%

Legende - Aktien

Gesamteindruck

Das theScreener Rating basiert auf einer multifaktoriellen Analyse, welche technische, fundamentale, sensitivitäts- und umfeldbezogene Kriterien berücksichtigt. Das theScreener Rating-System umfasst 5 Stufen:

-  : **Positiv**, fast alle oder alle Faktoren sind positiv
-  : **Eher Positiv**, die Mehrheit der Faktoren ist positiv
-  : **Neutral**, Gleichgewicht zwischen positiven und negativen Faktoren
-  : **Eher Negativ**, die Mehrheit der Faktoren ist negativ
-  : **Negativ**, fast alle oder alle Faktoren sind negativ

Das theScreener Rating-System für die Indizes und die Branchen umfasst 3 Stufen: Positiv, Neutral und Negativ.

Anzahl Aktien

Anzahl analysierter Aktien

Börs.-Kap. (\$ Mia.)

Diese Grösse berechnet sich, indem der Aktienpreis eines Unternehmens mit der Anzahl ausstehender Aktien multipliziert wird.

Potenzial

Unsere Potenzialeinschätzung gibt an, ob ein Titel zu einem hohen oder günstigen Preis gehandelt wird relativ zu seinen Ertragsaussichten.

Zur Beurteilung des theoretischen Potenzials stützen wir uns auf folgende Größen:

- Aktienkurs
- Ertrag
- Ertragsprognosen
- Dividenden

Durch Kombination dieser Größen erstellen wir die Potenzialeinstufung.

Es gibt fünf Potenzialeinschätzungen, die von stark unterbewertet bis zu stark überbewertet reichen.

Sterne

Das theScreener Sterne-Rating System ist so angelegt, dass Sie schnell qualitativ einwandfreie Titel, Branchen oder Indizes erkennen können.

Pro erfülltem Kriterium verteilt das Rating System einen Stern wie folgt:

- Gewinnrevisionen
- Potenzial
- MF Tech. Trend
- Relative Performance über 4 Wochen

Eine Aktie wird mit maximal 4 Sternen bewertet.

Das schwächste Rating einer Aktie sind null Sterne.

Eine Aktie behält einmal erworbene Sterne bis ...

- Gewinnrevisionen negativ werden
- Potenzial negativ wird
- MF Tech. Trend negativ wird
- Relative Performance über 4 Wochen mehr als 1% negativ wird

Dividende

Der Wert zeigt in % die für die nächsten 12 Monate erwartete Dividendenrendite.

Die Farbe der Zahl der Dividendenrendite zeigt den Deckungsgrad der Dividende durch Gewinne an. Beispiel:

- 0%, keine Dividende
- 4%, die Dividende beträgt weniger als 40% der erwarteten Gewinne
- 4%, die Dividende beträgt zwischen 40% und 70% der erwarteten Gewinne
- 4%, für die Dividende müssen mehr als 70% der erwarteten Gewinne verwendet werden.

Gewinnrevisionen

Der Trend der Gewinnrevisionen stellt den Analystenkonsens dar und basiert auf deren Gewinnrevisionen pro Aktie der letzten sieben Wochen. Um zuverlässige Schätzungen zu gewährleisten, analysiert theScreener nur Titel, die von mindestens drei Analysten abgedeckt werden.

Revisionen, die $\pm 1\%$ überschreiten, werden als positive oder negative Gewinnrevisionstrends interpretiert.

Rating Finanzkennzahlen

Die Finanzkennzahlen werden auf einer dreistufigen Skala (positiv, neutral und negativ) bewertet. Das Gesamtrating basiert auf den Unterratings, die die mittel- und langfristige Entwicklung sowie den Branchendurchschnitt berücksichtigen.

Zielpreis

Der Zielpreis ist eine Schätzung, wie hoch der Kurs in 12 Monaten sein wird.

LF PE

Verhältnis des Preises zum langfristig erwarteten Gewinn.

LF Wachstum

Es handelt sich um die durchschnittliche geschätzte jährliche Steigerungsrate der zukünftigen Erträge des Unternehmens, in der Regel für die nächsten zwei bis drei Jahre.

MF Tech. Trend

Der mittelfristige (40 Tage) technische Trend zeigt den gegenwärtigen Trend, der positiv, neutral oder negativ sein kann.

Wenn der Kurs weniger als 1,75 % über oder unter dem technischen Trend liegt, wird der mittelfristige technische Trend als neutral betrachtet.

Ein positiver oder negativer technischer Trend liegt vor, wenn der Preis den technischen Trend um mindestens 1,75% über- oder unterschreitet.

4 Wochen (Relative) Performance

Dieser dividendenbereinigte Indikator zeigt die Performance eines Wertes relativ zum entsprechenden Index während der letzten vier Wochen an. Bei Indizes zeigt der Indikator die absolute Wertentwicklung über 4 Wochen an.

Bad News Factor

Dem «Bad News Factor» liegt die Analyse von Preisrückschlägen der Aktie bei allgemein steigenden Börsen während der letzten 12 Monate zugrunde. Erleidet eine Aktie einen absoluten Kursrückgang, während ihr Referenzindex steigt, so belastet etwas Unternehmensspezifisches den Aktienkurs, daher der Name.

Der Bad News Factor zeigt die Abweichung der betrachteten Aktien pro Bad News Ereignis im Vergleich zum Referenzindex. Der Faktor wird in Basis Punkten pro Halbwoche gemessen und stellt den Durchschnittswert der letzten 52 Wochen dar. Je höher der Faktor, umso empfindlicher waren die Reaktionen auf "Bad News". Ein niedriger Faktor zeigt, dass in der Vergangenheit wenig nervös auf Negatives zum Unternehmen reagiert wurde.

Bear Market Factor

Dem «Bear Market Factor» liegt die Analyse des Kursverhaltens bei sinkenden Märkten zugrunde. Der Faktor misst den Unterschied zwischen der Bewegung des Aktienkurses und der des Gesamtmarktes (Referenzindex) bei sinkenden Märkten.

Die Basis bildet eine Beobachtungsperiode über die letzten 52 Wochen mit halbwochentlichen Intervallen.

Ein grosser "Bear Market Factor" deutet darauf hin, dass die Aktie auf negative Bewegungen des Referenzindex stark fallend reagiert hat.

Ein sehr negativer "Bear Market Factor" deutet auf ein defensives Profil hin: Die Aktie war von Baissen unterdurchschnittlich betroffen.

Sensitivität

Die Kursentwicklung von Aktien ist grundsätzlich mit hohen Risiken behaftet und kann starken Schwankungen unterliegen – bis hin zu einem Totalverlust. Aufgrund des historischen Verhaltens werden die Aktien in verschiedene Sensitivitätsstufen eingeteilt. Diese Sensitivitätsstufen verstehen sich ausschliesslich als relativer historischer Vergleichswert zu anderen Aktien. Grundsätzlich muss aber selbst bei als «wenig sensitiv» eingestuften Werten berücksichtigt werden, dass es sich um Aktien und damit um riskante Wertpapiere handelt und dass aus der Vergangenheit keine schlüssigen Folgerungen für die Zukunft gezogen werden können.

Die Sensitivitätsstufe wird festgelegt, indem der Bear Market Factor und der Bad News Factor der Aktie mit einem langjährigen internationalen Durchschnitt (Referenzwert) verglichen werden.

Es gibt drei verschiedene Sensitivitätsstufen:

- Geringe Sensitivität: Beide Sensitivitätswerte liegen unterhalb des Referenzwertes.
- Mittlere Sensitivität: Mindestens ein Sensitivitätswert liegt oberhalb des Referenzwertes, aber keiner der beiden Werte übersteigt den Durchschnitt um mehr als eine Standardabweichung.
- Hohe Sensitivität: Mindestens ein Sensitivitätswert liegt um mehr als eine Standardabweichung über dem Referenzwert.

Volatilität

Die Volatilität misst die Stärke der Schwankungen einer Aktie oder eines Indexes während eines Zeitraumes. Die Volatilität über 12 Monate zeigt den Durchschnittswert während der letzten 12 Monate.

Beta

Beta wird oft als Mass für die Sensitivität verwendet. Ist es grösser als 100, so ist die Aktie volatiliter als ihr Referenzindex.

Korrelation

Die Korrelation misst den Grad der Übereinstimmung der Kursbewegungen einer Aktie mit der ihres Referenzindex.

Hinweis:

theScreener.com übernimmt keine Haftung für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Aktualität der Angaben. Dieses Dokument dient ausschliesslich informativen Zwecken und stellt weder eine Anlageberatung, noch eine Anlagevermittlung oder eine sonstige Finanzdienstleistung dar. Die Kursentwicklung von Wertpapieren ist mit Risiken behaftet und kann starken Kursschwankungen unterliegen. Aus der Vergangenheit und den gemachten Angaben können keine Schlüsse für zukünftige Kursentwicklungen gezogen werden. Historische Renditeangaben sind keine Garantie für laufende und zukünftige Ergebnisse.

Wenn die Anlagewährung von der Währung des Anlageinstrumentes abweicht, können Währungsschwankungen die Wertentwicklung des Anlageinstrumentes stark beeinflussen, so dass diese deutlich höher oder niedriger ausfallen kann.

Mehr Informationen : www.thescreener.com/de/home/method/

Preisdaten, Finanzkennzahlen und Gewinnsschätzungen von FACTSET. Indexdaten von EDI.