

generiekparamDEZ.DE

November 9, 2022

Analyse van een aandeel, gebaseerd op gegevens uit Yahoo Finance.

Dit is de analyse van : DEZ.DE

De gebruikte einddatum = 2022-11-09

```
{'zip': '51149', 'sector': 'Industrials', 'fullTimeEmployees': 4805,
'longBusinessSummary': 'DEUTZ Aktiengesellschaft manufactures diesel and gas engines in Europe, the Middle East, Africa, the Asia Pacific, and the Americas. It operates through three segments: DEUTZ Compact Engines, DEUTZ Customized Solutions, and Other. The DEUTZ Compact Engines segment provides servicing of liquid-cooled engines with capacities of up to 8 liters. The DEUTZ Customized Solutions segment offers air-cooled drives and liquid-cooled engines with a capacity exceeding 8 liters; and reconditioned exchange engines and parts. The Other segment is involved in manufacturing electric and hybrid drive systems for marine applications under the Torqeedo brand; and development of battery management hardware and software products under the Futavis name, as well as focuses on the electrification of drive systems and electric-powered watercraft. The company also offers installation, maintenance, and repair services for engines. Its products are used in various applications, such as construction equipment, agricultural machinery, material handling equipment, ground support equipment, stationary equipment, commercial vehicles, rail vehicles, boats, and other applications. The company was founded in 1864 and is headquartered in Cologne, Germany.', 'city': 'Cologne', 'phone': '49 221 822 24 91', 'country': 'Germany', 'companyOfficers': [], 'website': 'https://www.deutz.com', 'maxAge': 1, 'address1': 'Ottostrasse 1', 'fax': '49 221 822 15 24 91', 'industry': 'Specialty Industrial Machinery', 'address2': 'Porz-Eil', 'ebitdaMargins': 0.053319998, 'profitMargins': 0.026659999, 'grossMargins': 0.18010001, 'operatingCashflow': 85900000, 'revenueGrowth': 0.304, 'operatingMargins': 0.0201, 'ebitda': 91800000, 'targetLowPrice': 5.5, 'recommendationKey': 'buy', 'grossProfits': 285600000, 'freeCashflow': 26529000, 'targetMedianPrice': 6.6, 'currentPrice': 4.248, 'earningsGrowth': None, 'currentRatio': 1.223, 'returnOnAssets': 0.01695, 'numberOfAnalystOpinions': 7, 'targetMeanPrice': 6.55, 'debtToEquity': 21.487, 'returnOnEquity': 0.08056, 'targetHighPrice': 7.3, 'totalCash': 42500000, 'totalDebt': 129200000, 'totalRevenue': 1721799936, 'totalCashPerShare': 0.375, 'financialCurrency': 'EUR', 'revenuePerShare': 13.59, 'quickRatio': 0.456, 'recommendationMean': 1.7, 'exchange': 'GER', 'shortName': 'DEUTZ AG O.N.', 'longName': 'DEUTZ Aktiengesellschaft',
```

```

'exchangeTimezoneName': 'Europe/Berlin', 'exchangeTimezoneShortName': 'CET',
'isEsgPopulated': False, 'gmtOffsetMilliseconds': '3600000', 'underlyingSymbol':
None, 'quoteType': 'EQUITY', 'symbol': 'DEZ.DE', 'underlyingExchangeSymbol':
None, 'headSymbol': None, 'messageBoardId': 'finmb_618582', 'uuid':
'6aa82241-629a-3bfd-ac7a-9967b4df0516', 'market': 'de_market',
'annualHoldingsTurnover': None, 'enterpriseToRevenue': 0.318, 'beta3Year': None,
'enterpriseToEbitda': 5.964, '52WeekChange': None, 'morningStarRiskRating':
None, 'forwardEps': 0.75, 'revenueQuarterlyGrowth': None, 'sharesOutstanding':
120862000, 'fundInceptionDate': None, 'annualReportExpenseRatio': None,
'totalAssets': None, 'bookValue': 4.427, 'sharesShort': None,
'sharesPercentSharesOut': None, 'fundFamily': None, 'lastFiscalYearEnd':
1640908800, 'heldPercentInstitutions': 0.50747, 'netIncomeToCommon': 45900000,
'trailingEps': -0.89, 'lastDividendValue': None, 'SandP52WeekChange': None,
'priceToBook': 0.9595663, 'heldPercentInsiders': 0, 'nextFiscalYearEnd':
1703980800, 'yield': None, 'mostRecentQuarter': 1648684800, 'shortRatio': None,
'sharesShortPreviousMonthDate': None, 'floatShares': 107666666, 'beta': 1.5793,
'enterpriseValue': 547513344, 'priceHint': 4, 'threeYearAverageReturn': None,
'lastSplitDate': None, 'lastSplitFactor': None, 'legalType': None,
'morningStarOverallRating': None, 'earningsQuarterlyGrowth': None,
'priceToSalesTrailing12Months': 0.29818898, 'dateShortInterest': None,
'pegRatio': None, 'ytdReturn': None, 'forwardPE': 5.664, 'lastCapGain': None,
'shortPercentOfFloat': None, 'sharesShortPriorMonth': None, 'category': None,
'fiveYearAverageReturn': None, 'previousClose': 4.202, 'regularMarketOpen':
4.242, 'twoHundredDayAverage': 4.233825, 'trailingAnnualDividendYield':
0.03569729, 'payoutRatio': 0, 'volume24Hr': None, 'regularMarketDayHigh': 4.336,
'navPrice': None, 'averageDailyVolume10Day': 376064,
'regularMarketPreviousClose': 4.202, 'fiftyDayAverage': 3.54152,
'trailingAnnualDividendRate': 0.15, 'open': 4.242, 'averageVolume10days':
376064, 'expireDate': None, 'algorithm': None, 'dividendRate': 0.15,
'exDividendDate': 1651190400, 'circulatingSupply': None, 'startDate': None,
'regularMarketDayLow': 4.2, 'currency': 'EUR', 'regularMarketVolume': 335803,
'lastMarket': None, 'maxSupply': None, 'openInterest': None, 'marketCap':
513421792, 'volumeAllCurrencies': None, 'strikePrice': None, 'averageVolume':
404681, 'dayLow': 4.2, 'ask': 4.248, 'askSize': 32500, 'volume': 335803,
'fiftyTwoWeekHigh': 7.95, 'fromCurrency': None, 'fiveYearAvgDividendYield':
None, 'fiftyTwoWeekLow': 2.99, 'bid': 4.242, 'tradeable': False,
'dividendYield': 0.0369, 'bidSize': 90100, 'dayHigh': 4.336,
'regularMarketPrice': 4.248, 'preMarketPrice': None, 'logo_url':
'https://logo.clearbit.com/deutz.com'}
[*****100%*****] 1 of 1 completed

```

1 Een eerste onderdeel is de waarde-analyse.

Hier baseer ik me op de visie van **Anthony Deden**. Aandelen krijgen telkens een punt wanneer aan een criterium voldaan is.

Opmerking : Financiële aandelen kunnen nooit het maximum aantal punten halen, omdat het moeilijk is om risico te schatten. (cfr. Fortis)

Er wordt een opsomming gegeven waarop het geanalyseerde aandeel afwijkt van het ideaal.

DEUTZ Aktiengesellschaft scoort 8 waar de besten 11 scoren
het bedrijf zit in sector : Industrials

Voor welke parameters/ratio's is de score minder goed

de verhouding van assets versus liabilities is kleiner dan 1.3 1.19
de groeiratio tov 4jaar geleden is negatief: -0.08189509781875422
de beta is groter dan 1.2 : 1.631977

Overzicht van alle parameters/ratio's

('PE', 8.2)
('earnings/share', 0.44)
('Price/Book : ', 0.75639415)
('tangible value : ', 0.9324189017538134)
('Enterprise / EBITDA : ', 5.911)
('schuld ratio : ', 0.3891576183660161)
('assets / liabilities : ', 1.19)
('groei ratio sinds 4 jaar : ', -0.08189509781875422)
('beta : ', 1.631977)
('Price / Sales : ', 0.24532777)
('commentaar : ', '')

Uit Yahoo finance kunnen we ook kwartaalresultaten krijgen. Er zijn vier kwartalen beschikbaar.
heb uit gegevens enkel ebit weerhouden

2022-03-31 9800000.0
2021-12-31 -1900000.0
2021-09-30 12400000.0
2021-06-30 15100000.0
Name: Ebit, dtype: object
gemiddelde ebit : 8850000.0
verandering van laatst gerapporteerde kwartaal tov jaar geleden =
-35.099337748344375 percent !

schatting van verandering huidige PE = 8.2 bij gelijk blijvende prijs :
nieuwe geschatte P/E = 12.634693877551019

2 Een tweede onderdeel is de insider info

voorlopig moet dit nog manueel maar als er meer verkocht dan gekocht wordt stijgt RISC met 10

<https://www.insiderscreener.com/en/company/....>

voorlopig heb ik nog geen automatisch weging van kopers versus verkopers en ken default slechtse score toe

[8]: []

3 Een derde onderdeel : hoe is de huidige waardering ?

Het is erg moeilijk een prijs te kleven op een aandeel. Is iets duur of goedkoop?

In maart 2020 was er de covidcrash, alle aandelen werden toen koopwaardig geacht. Wat is het prijspeil ten opzichte van toen?

het neerwaarts potentieel

[*****100%*****] 1 of 1 completed
gemiddelde prijs over de maand maart 2020 = 3.5657999753952025

Het neerwaarts potentieel ? = 2.9642284779944146 percent

targetprijs van analisten in Yahoo = 6.55

Indien de schatting van de analisten aanwezig is kan ik het **opwaarts potentieel** berekenen :

Het geschat opwaarts potentieel op 1 jaar? = 78.24451956217592 percent



- als in de figuur “down” groen is, betekent dit dat de prijs nu onder die van maart 2020 zit
- als in de figuur “up” rood is, betekent dit dat de prijs nu hoger ligt dan de schatting van de analisten

4 Een vierde onderdeel : de technische analyse.

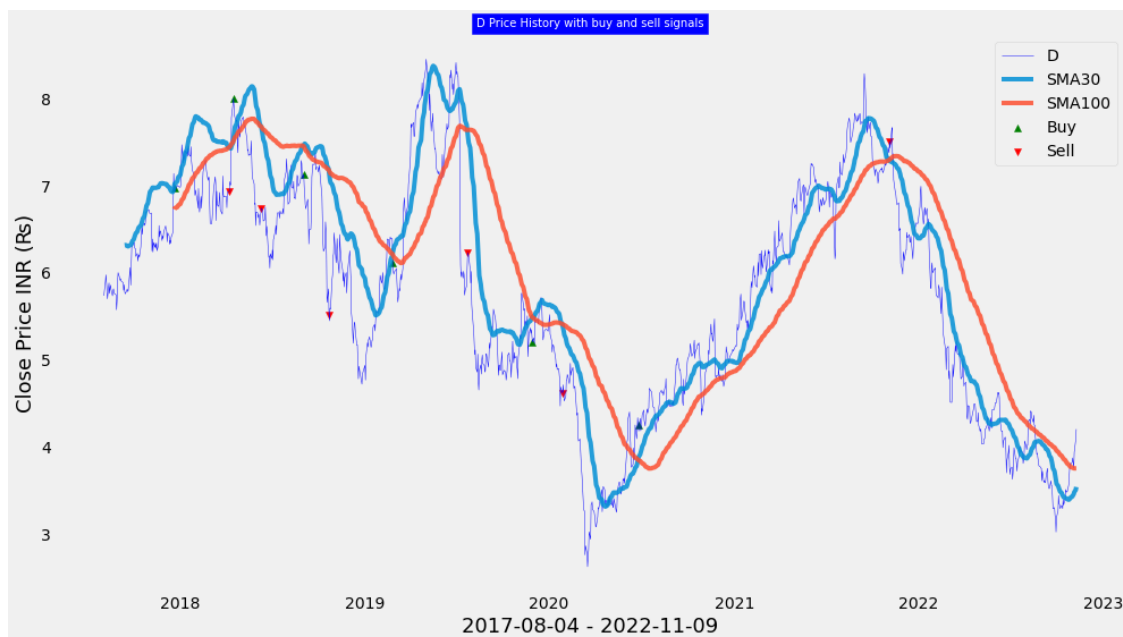
technische analyse eind-datum = 2022-11-09

[*****100%*****] 1 of 1 completed

Simple Moving Average

We have two SMA's, one for a short period; the other is for a long period. & We've written a simple function to Buy when the Short MA is more than the long one & Sell when the Long MA is more than the Short one.

We hebben twee SMA's, één voor een korte periode; de andere is voor een lange periode. We hebben een eenvoudige functie geschreven om te kopen wanneer de korte MA meer is dan de lange en te verkopen wanneer de lange MA meer is dan de korte.



de koop momenten :

Date

2017-12-21	6.970985
2018-04-17	8.003347
2018-09-03	7.131455
2019-02-26	6.111332
2019-11-29	5.203615
2020-06-25	4.252000

Name: Buy_Signal_price, dtype: float64

de verkoop momenten :

Date

2018-04-09	6.933160
2018-06-11	6.741270

2018-10-23	5.514302
2019-07-24	6.231903
2020-01-27	4.620121
2021-11-04	7.510000

Name: Sell_Signal_price, dtype: float64

er komt een koop moment aan

Relative Strength Index

One of the most widely used technical indicators in technical analysis is the Relative Strength Index.

RSI fluctuates between 0 and 100, RSI less than 30 indicates the stock is oversold, and above 70 suggests a stock is overbought.

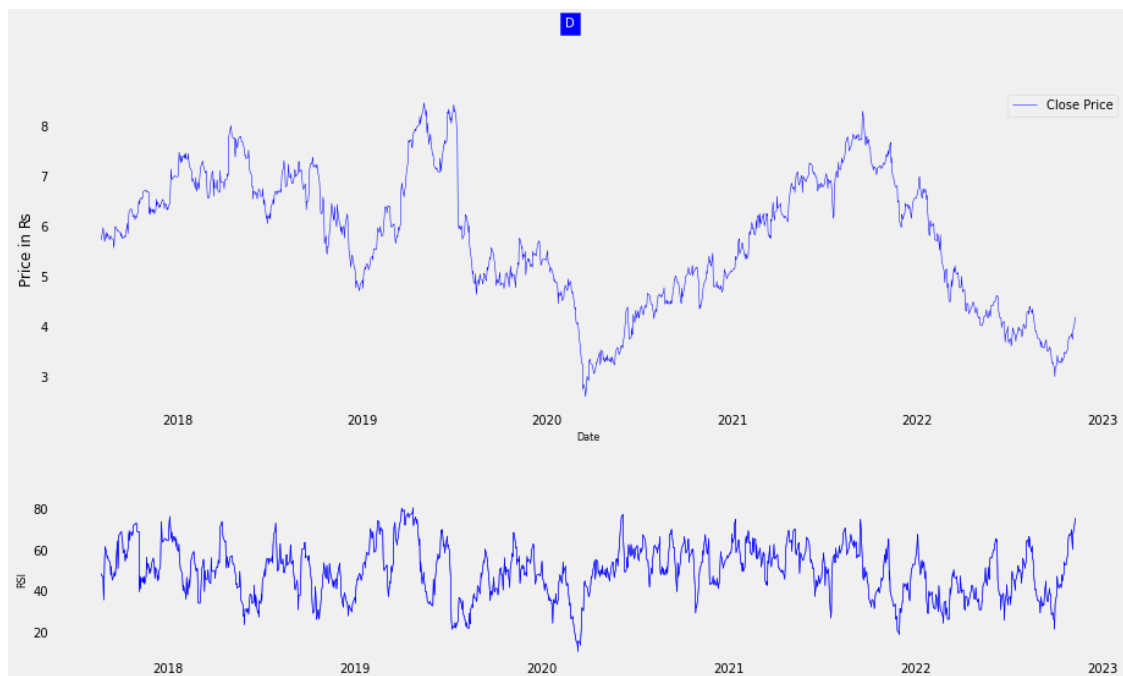
A Medium-term RSI Setting 14 (14 Periods of Price: Good for a Daily Chart)

Date	RSI
2022-11-02	65.495473
2022-11-03	60.350102
2022-11-04	67.971295
2022-11-07	72.521652
2022-11-08	75.674810

Name: RSI, dtype: float64

75.67480957657456

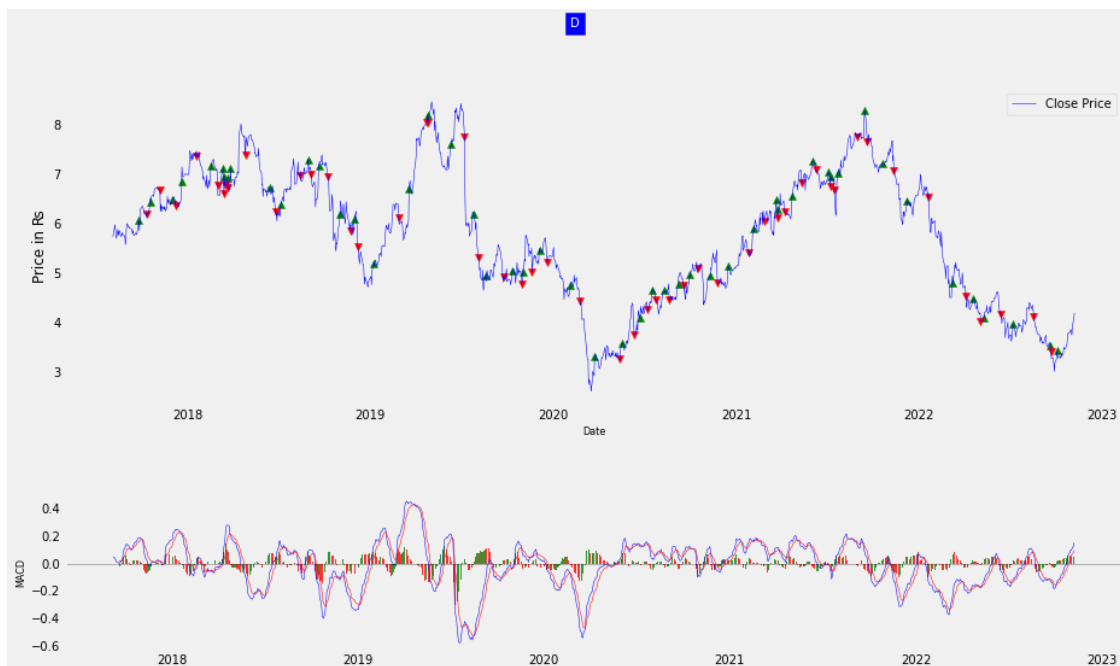
er komt een verkoopmoment aan



MACD: The Moving Average Convergence Divergence indicator (MACD)

MACD: The Moving Average Convergence Divergence indicator (MACD) is calculated using two exponential moving averages (EMA) - short term and long term. An exponential moving average of MACD is used as a signal line to indicate the upward or downward momentum. An exponential moving average is nothing but simply a moving average that gives **more weightage to the recent data**.

MACD: de indicator voor voortschrijdend gemiddelde convergentiedivergentie (MACD) wordt berekend met behulp van twee exponentiële voortschrijdende gemiddelden (EMA) - korte termijn en lange termijn. Een exponentieel voortschrijdend gemiddelde van MACD wordt gebruikt als een signaallijn om het opwaartse of neerwaartse momentum aan te geven. Een exponentieel voortschrijdend gemiddelde is niets anders dan een voortschrijdend gemiddelde dat **meer gewicht geeft aan de recente gegevens**.



MACD Buy momenten

Date

2022-04-20 4.492

2022-05-11 4.092

2022-07-08 3.988

2022-09-20 3.552

2022-10-04 3.438

Name: MACD_Buy_Signal_price, dtype: float64

MACD Sell momenten

Date

2022-04-05 4.532

2022-05-05 4.034

2022-06-13 4.180

2022-08-19 4.124

2022-09-22 3.414

Name: MACD_Sell_Signal_price, dtype: float64

er komt een verkoop-moment aan volgens SMA-techniek

BB: Bollinger bands

BB: Bollinger bands are one of the most used indicators in the world of trading, simply because it is so powerful and yet very simple.

They comprise of three lines,

Upper Bollinger band, Middle Bollinger band, Lower Bollinger band. The upper and lower Bollinger bands are plotted two standard deviations away from the mean average of the Close Price. The two bands comprise more than 80% of the price action, thus making any price above or below the bands highly significant.

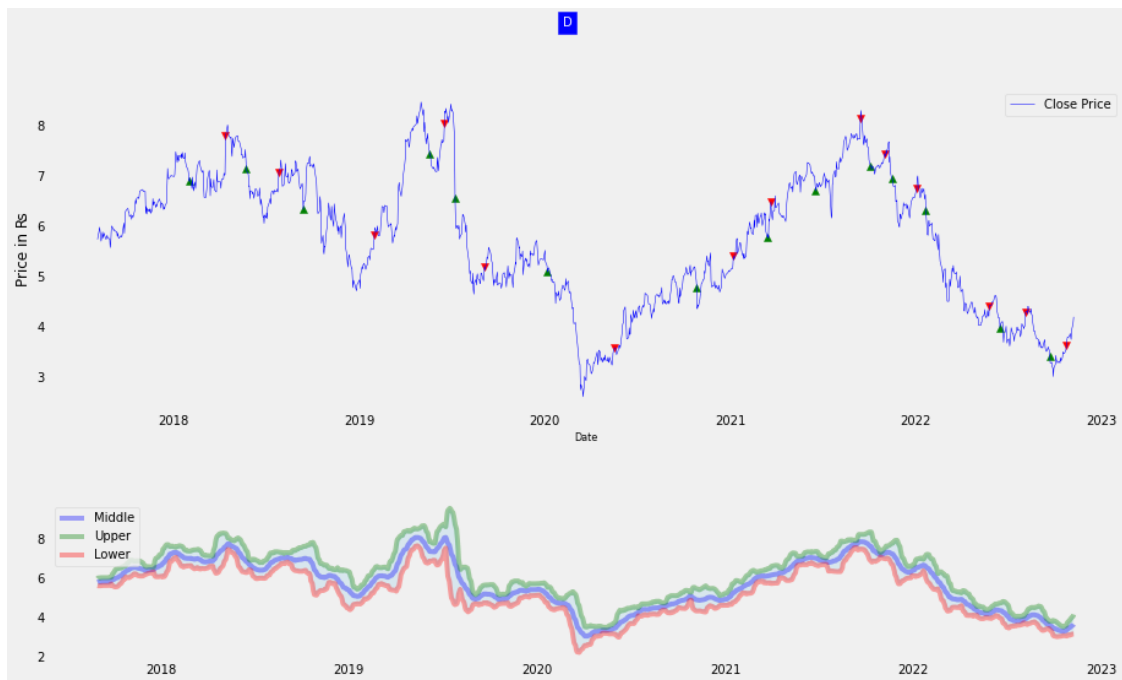
Our Strategy is based on the assumption that any time the closing price goes below or above the Bollinger bands, there are high chances for price reversion, and hence it can be used as a signal but **can't be entirely relied upon** as there might be an underlying event driving the stock.

BB: Bollinger-bands zijn een van de meest gebruikte indicatoren in de handelswereld, simpelweg omdat het zo krachtig en toch heel eenvoudig is.

Ze bestaan uit drie lijnen,

Bovenste Bollinger-band, Midden Bollinger-band, Lagere Bollinger-band. De bovenste en onderste Bollinger-band zijn twee standaarddeviaties verwijderd van het gemiddelde gemiddelde van de slotkoers. De twee banden omvatten meer dan 80% van de prijsactie, waardoor elke prijs boven of onder de banden zeer belangrijk is.

Onze strategie is gebaseerd op de veronderstelling dat elke keer dat de slotkoers onder of boven de Bollinger-bands komt, er grote kansen zijn op prijsomkering, en daarom kan het als een signaal worden gebruikt, maar **kan er niet volledig op worden vertrouwd** omdat er een onderliggende gebeurtenis kan zijn die het aandeel aandrijft.



bollinger band koopmomenten

Date

2021-10-04 7.195

2021-11-15 6.940

2022-01-21 6.300

2022-06-16 3.990

2022-09-22 3.414

Name: bb_Buy_Signal_price, dtype: float64

bollinger band verkoopmomenten

Date

2021-11-01 7.440

2022-01-03 6.760

2022-05-26 4.428

2022-08-05 4.294

2022-10-25 3.650

Name: bb_Sell_Signal_price, dtype: float64

er komt een koop moment aan

overzicht technische analyse

sma,rsi,macd,bb

buy

1 0 0 1

sell

0 1 1 0



keytrade : aandeel volgt zeer dalende tendens!

5 Een vijfde onderdeel : dynamiek management

- Is de onderneming internationaal actief ? JA
- Is de onderneming ook actief in EM ? JA
- Is de onderneming nog deels in familiale handen ? JA
- Maakt de onderneming deel uit van ETF, index, fonds ? (belangrijk voor money-inflow)
- Staan er toekomstplannen in de jaarrekening ?
- Wat zijn de vooruitzichten ?
- Wordt er gediversifieerd/geïnvesteerd/R&D ?

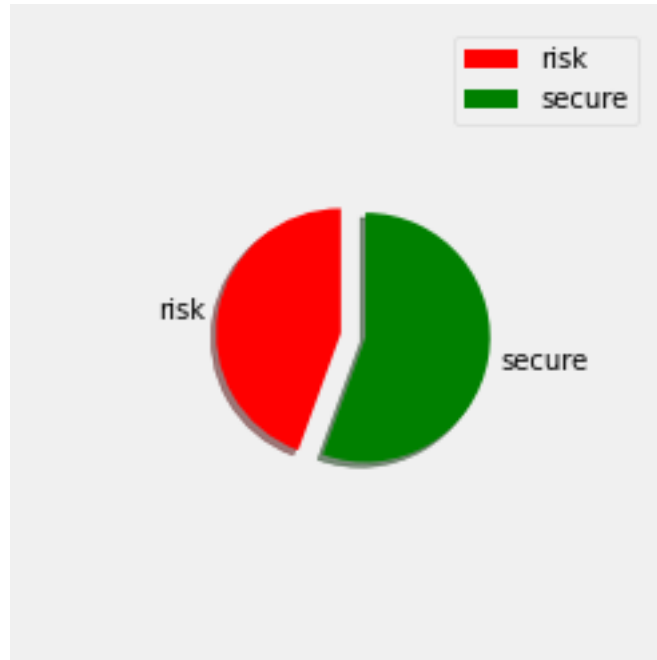
6 Een zesde onderdeel : risico!

Heb hier een factoren in aanmerking genomen : - Price/Earnings ligt hoger dan 15 - Price groter dan boek * 2 - tangible value kleiner dan .5 - schuld groter dan 50 percent - schuld groter dan 100 percent - de verhouding van assets versus liabilities groter dan 1.3 - opwaarts potentieel is negatief - meer insiders verkopers dan kopers - laatste kwartaalcijfers zijn slechter dan jaar geleden

Deze krijgen telkens 10 percent punten

Keytrade: risico is eerder gemiddeld

- Is de onderneming cyclisch en waar in de cyclus zitten we ?
- Wat doet de overkoepelende index ?
- Wat is de credit rating van creditrating agency ?



7 Een zevende onderdeel : het dagboek

- Waarom u het koopt
- Wanneer u wil verkopen
- Wat de positieve triggers zijn voor het aandeel in de komende maanden
- Wat het aandeel fors lager kan brengen
- De datum van aankoop
- Stand van de index waarin het aandeel zit
- Korte samenvatting situatie op de beurs en hoe het evolueert
- Waardering van het aandeel
- Evaluatie, pas in te vullen bij verkoop om er later van te leren

8 Een achtste onderdeel : vergelijken

Yahoo ticker : DEZ.DE heeft waarde 100.0 groei 12.0 veiligheid 52.0 totaal 55.0

dit kan u vergelijken met onderstaand :

<https://obermatt.com/en/stocks/deutz-dez-ff/similar-stocks.html>

 vergelijkbare grote bedrijven

value = Themes growth = About risk = Top 10 Stocks total = Insights

1. Atlas Copco (XL, SE) value = 24 growth = 78 risk = 44 total = 98
2. Cargotec (XL, FI) value = 84 growth = 98 risk = 46 total = 94
3. Krones (XL, DE) value = 55 growth = 92 risk = 82 total = 92

4. Alfa Laval (XL, SE) value = 32 growth = 92 risk = 74 total = 84
5. Konecranes (XL, FI) value = 75 growth = 81 risk = 43 total = 79
6. Andritz (XL, AT) value = 75 growth = 93 risk = 15 total = 73
7. GEA (XL, DE) value = 49 growth = 53 risk = 74 total = 72
8. DMG Mori (XL, DE) value = 34 growth = 72 risk = 80 total = 70
9. SKF (XL, SE) value = 82 growth = 20 risk = 80 total = 67
10. Wartsila (XL, FI) value = 66 growth = 60 risk = 48 total = 62

grote bedrijven uit zelfde regio

1. Rheinmetall (XL, DE) value = 81 growth = 100 risk = 79 total = 99
2. Krones (XL, DE) value = 55 growth = 92 risk = 82 total = 92
3. Klöckner (XL, DE) value = 95 growth = 9 risk = 96 total = 82
4. Bilfinger (XL, DE) value = 79 growth = 33 risk = 81 total = 79
5. Hapag-Lloyd (XXL, DE) value = 57 growth = 27 risk = 94 total = 76
6. GEA (XL, DE) value = 49 growth = 53 risk = 74 total = 72
7. DMG Mori (XL, DE) value = 34 growth = 72 risk = 80 total = 70
8. BayWa (XXL, DE) value = 60 growth = 86 risk = 34 total = 66
9. Deutsche Lufthansa (XXL, DE) value = 47 growth = 97 risk = 10 total = 54
10. MTU Aero Engines (XL, DE) value = 9 growth = 83 risk = 60 total = 52

vergelijkbare mid-size bedrijven

1. KSB (L, DE) value = 100 growth = 72 risk = 90 total = 100
2. Gesco (M, DE) value = 94 growth = 72 risk = 76 total = 96
3. Mikron (M, CH) value = 90 growth = 68 risk = 90 total = 96
4. Muehlbauer (M, DE) value = 29 growth = 91 risk = 96 total = 94
5. Aumann (M, DE) value = 61 growth = 95 risk = 61 total = 93
6. Maschinenfabrik Berthold Hermle (M, DE) value = 57 growth = 55 risk = 100 total = 92
7. Bobst (L, CH) value = 70 growth = 90 risk = 49 total = 84
8. Rotork (L, GB) value = 22 growth = 82 risk = 92 total = 84
9. Conzzeta (L, CH) value = 60 growth = 42 risk = 74 total = 83
10. Feintool (M, CH) value = 94 growth = 52 risk = 56 total = 80

mid-size bedrijven uit zelfde regio

1. KSB (L, DE) value = 100 growth = 72 risk = 90 total = 100
2. Gesco (M, DE) value = 94 growth = 72 risk = 76 total = 96
3. Muehlbauer (M, DE) value = 29 growth = 91 risk = 96 total = 94
4. Aumann (M, DE) value = 61 growth = 95 risk = 61 total = 93
5. Vossloh (L, DE) value = 71 growth = 91 risk = 59 total = 93
6. Maschinenfabrik Berthold Hermle (M, DE) value = 57 growth = 55 risk = 100 total = 92
7. Wacker Neuson (L, DE) value = 97 growth = 5 risk = 78 total = 68
8. Koenig & Bauer (L, DE) value = 90 growth = 8 risk = 68 total = 62
9. Rational (L, DE) value = 8 growth = 82 risk = 76 total = 56