

Analyse Financière - MSFT

Microsoft Corporation

Analyse Comparative - Positionnement Marché

Type de rapport demandé : BENCHMARK

Prix actuel: \$520.17

Capitalisation: \$3,866,511,802,368

Secteur: Technology

Industrie: Software - Infrastructure

Date du rapport: 16/08/2025 16:01

Résumé Exécutif

MSFT (Microsoft Corporation) évolue actuellement à **\$520.17**. Sur les 12 derniers mois, le titre a généré une performance de **+25.7%** avec une volatilité annualisée de **26.6%**. **Secteur** : Technology
Industrie : Software - Infrastructure
Marché : NMS
Capitalisation : \$3,866,511,802,368
Employés : 228,000 Cette analyse examine les fondamentaux financiers, les métriques de valorisation, et fournit une recommandation d'investissement basée sur l'analyse quantitative.

Vue d'ensemble Financière

Métrique	Valeur	Métrique	Valeur
Prix actuel	\$520.17	P/E Ratio	38.16
Capitalisation	\$3,866,511,802,368	P/B Ratio	11.26
Revenus (TTM)	\$281,723,994,112	EV/EBITDA	24.81
Bénéfice net	\$101,831,999,488	ROE	33.3%
Marge bénéficiaire	36.1%	Dividend Yield	64.00%

Analyse Comparative Benchmark

Comparaison avec les Indices de Référence :

Actif Analysé : MSFT

Secteur : Technology

Capitalisation : \$3,866,511,802,368

Performance Relative (Dernière Année) :

- **1 mois** : +1.7%
- **3 mois** : +14.8%
- **6 mois** : +27.2%
- **1 an** : +26.6%
- **2 ans** : +64.6%

Vs Indices Majeurs :

- **vs S&P; 500** : +7.9% (surperformance)
- **vs Dow Jones** : +13.6% (surperformance)
- **vs NASDAQ** : +0.8% (surperformance)

Métriques de Performance Adjustées au Risque :

Ratio de Sharpe :

- MSFT : 0.775

Analyse Bêta et Alpha :

- **Bêta vs S&P; 500** : 1.18

Interprétation : Volatilité similaire au marché

- **Alpha annualisé** : 5.8%

Interprétation : Création de valeur

Classification du Profil Risque-Rendement :

- **Profil** : Marché - Profil similaire aux indices de référence

Positionnement Sectoriel :

- **Performance vs secteur** : À comparer avec l'ETF sectoriel correspondant
- **Leadership** : Leader sectoriel

- **Cyclicité** : Modérément cyclique

Recommandations d'Allocation :

- **Pèse dans un portefeuille diversifié** : 5-10% (fonction du profil de risque)
- **Complémentarité** : Diversifier avec autres secteurs
- **Horizon recommandé** : Moyen à long terme (2-4 ans)

Surveillance des Benchmarks :

- Suivre la performance relative mensuelle
- Analyser les périodes de décorrelation
- Identifier les catalyseurs de surperformance
- Monitorer l'évolution du beta dans le temps

Analyse de Performance Relative - MSFT

