

EXPERIAN

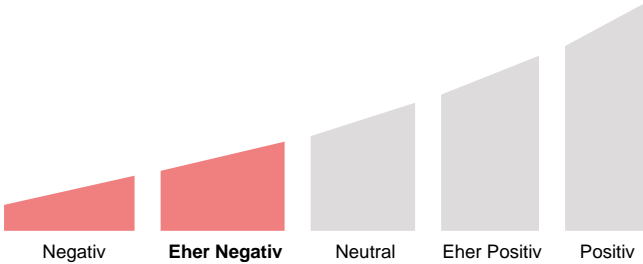
EXPERIAN gehört zur Branche Technologie und dort zum Sektor Informatik Dienstleister.

Mit einer Marktkapitalisierung von 41,67 Milliarden US Dollar zählt sie zu den large-cap Gesellschaften.

Während der letzten 12 Monate lag der Kurs zwischen GBp 3.724,00 und GBp 2.390,00. Der aktuelle Preis von GBp 3.492,00 liegt 6,2% unter ihrem höchsten und 46,1% über ihrem tiefsten Wert in dieser Periode.

Ergebnis seit 1. August 2023: EXPERIAN: 16,8%, Technologie: 7,1%, STOXX600: 6,6%

Gesamteindruck



Name	Markt	Kurs	Perf YtD	Börs.-Kap. (\$ Mia.)	Sterne	Sensitivität	LF P/E	LF Wachstum	Dividende	4W Rel. Perf.	Gesamteindruck
EXPERIAN	GB	3.492,00	9,1%	41,67	★★★★		23,0	16,9%	1,5%	-2,1%	
Technologie (TEC@EP)	EP	165,00	0,6%	1.618,31	★★★★		13,5	25,1%	1,6%	-8,1%	
STOXX600	EP	498,00	3,9%	15.071,07	★★★★		11,3	10,9%	3,7%	-2,6%	

Schlüsselpunkte

- ✓

Die durchschnittliche Gewinnmarge (EBIT) von 23,5% liegt deutlich über dem Branchendurchschnitt von 10,5%.
- ✓

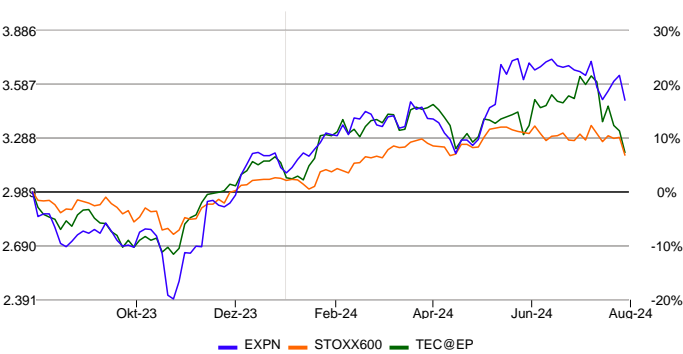
In diesem Jahr hat die Aktie mit 9,1% die 0,6% der Branche stark übertroffen.
- ✗

Die Gewinnprognosen wurden seit dem 30. Juli 2024 nach unten revidiert.
- ✗

Das prognostizierte KGV von 22,9 ist relativ hoch, 70,6% über dem Branchendurchschnitt von 13,5.
- ✗

Das erwartete jährliche Gewinnwachstum von 16,9% liegt unter dem Branchendurchschnitt von 25,1%.

Performance 1. August 2023 - 2. August 2024



Checkliste / Letzte Änderung / Ziel

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

	EXPN		Die letzte Analyse bestätigt die am 30. Juli 2024 aufgezeichneten Änderungen. Der Gesamteindruck bleibt bei "Eher Negativ".
Gesamteindruck			Verschlechterung von neutral auf eher negativ am 30-Jul-2024.
Sterne	★★★★	★★★★	Kein Stern seit dem 30-Jul-2024.
Gewinnrevisionen	★	★	Negative Analystenhaltung seit 30-Jul-2024. Das Problem der negativen Gewinnrevisionen ist firmenspezifisch.
Potenzial	★	★	Leicht überbewertet. Aufgrund der Analyse des fundamentalen Kurspotentials erscheint der Titel zur Zeit etwas zu hoch bewertet.
MF Tech. Trend	★	★	Negative Tendenz seit dem 19-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			Gesamthaft wird die Verlustanfälligkeit von EXPERIAN im Vergleich zu anderen Aktien als durchschnittlich eingeschätzt und dies seit mehr als einem Jahr.
Zielpreis	3.198,18 GBp		Per 2. August 2024 lag der Schlusskurs der Aktie bei GBp 3.492,00 mit einem geschätzten Kursziel von GBp 3.198,18 (-8%).

EXPERIAN - Branchenvergleich

Name	Symbol	Markt	Kurs	Perf YtD	Börs.-Kap. (\$ Mia.)	Sterne	Sensitivität	LF P/E	LF Wachstum	Dividende	% zum Ziel	Gesamteindruck
EXPERIAN	EXPN	GB	3.492,00	9,1%	41,67	★★★★☆		23,0	16,9%	1,5%	-8,4%	
DARKTRACE	DARK	GB	593,80	61,9%	4,85	★★★★★		31,5	25,9%	0,0%	11,3%	
SOFTCAT	SCT	GB	1.553,00	14,2%	4,12	★★★★★		22,3	16,3%	2,8%	10,1%	
COMPUTACENTER	CCC	GB	2.604,00	-6,7%	3,82	★★★★★		12,8	9,5%	2,8%	12,3%	
KEYWORDS STUDIOS	KWS	GB	2.384,00	43,4%	2,42	★★★★★		20,1	13,9%	0,1%	-19,9%	
KAINOS GROUP PLC.	KNOS	GB	1.042,00	-6,9%	1,74	★★★★★		17,3	13,9%	2,9%	15,1%	
BYTES TECHNOLOGY GROUP	BYIT	GB	481,40	-21,3%	1,52	★★★★★		18,2	13,7%	3,2%	15,0%	
ACCENTURE PLC	ACN	US	323,15	-7,9%	205,50	★★★★★		23,9	15,8%	1,7%	-10,1%	
TATA CONSULTANCY SVS.	TCS	IN	4.283,00	12,9%	189,93	★★★★★		24,8	17,9%	2,8%	3,8%	
IBM	IBM	US	189,12	15,6%	174,70	★★★★★		16,4	11,0%	3,6%	3,8%	

Fundamentale und Technische Analyse

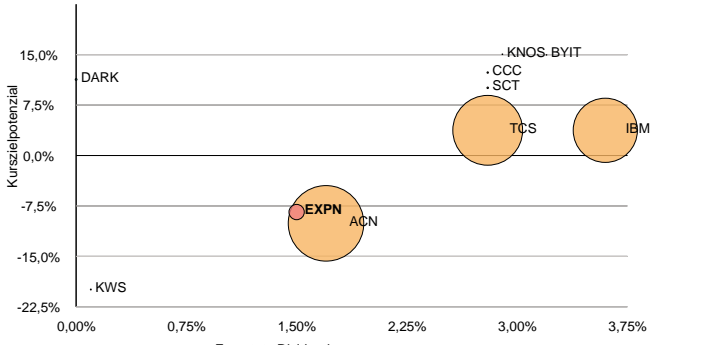
Analyse des Preises ★
Wir bewerten den Preis von EXPERIAN, indem wir diesen mit einem theoretisch fairen Wert vergleichen. Dazu kombinieren wir die PEG Methode, welche das prognostizierte Gewinnwachstum inklusive Dividende mit dem Kurs/Gewinnverhältnis vergleicht, mit unseren Erfahrungswerten. Auf dieser Basis stellen wir fest, dass:
- EXPERIAN fundamental betrachtet überbewertet ist.
- Die Bewertung weniger attraktiv ausfällt als beim Durchschnitt der europäischen Branche Technologie.
Das fundamentale Kurspotenzial von EXPERIAN ist unbefriedigend. Andere Werte der gleichen Branche verfügen über deutlich mehr Potenzial.

Gewinnprognosen ★
EXPERIAN erfreut sich grosser Aufmerksamkeit bei den Finanzanalysten, publizieren doch pro Quartal durchschnittlich deren 15 Gewinnprognosen für das Unternehmen bis ins Jahr 2027.
Zur Zeit revidieren diese Analysten ihre Gewinnprognosen nach unten um -2,7%, d.h. unter den Vergleichswerten vor sieben Wochen. Dieser Abwärtstrend bei den Gewinnaussichten besteht seit dem 30. Juli 2024.

Technische Tendenz und Relative Stärke ★★
Die Aktie befindet sich in einem mittelfristigen Abwärtstrend, welcher am 19. Juli 2024 bei GBP 3.497,00 eingesetzt hat.
Die dividendenbereinigte relative Performance zum STOXX600 über vier Wochen beträgt -2,1%, wobei die ebenfalls negative technische Tendenz den schlechten Wert bestätigt. Die Investoren richten ihr Interesse auf andere Aktien.
Die Referenzbranche Technologie registriert über die letzten 4 Wochen gesehen eine Unterperformance.

Dividende
Für die kommenden 12 Monate wird eine Dividendenrendite von 1,5% erwartet, für deren Ausschüttung EXPERIAN 34,0% des Gewinns verwenden muss (Dividendenlast). Die Dividende ist damit, auch aus dem Blickwinkel der Dividendenkontinuität, hinreichend gedeckt.

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 1,06 reagiert der Kurs von EXPERIAN auf eine Indexschwankung von 1% durchschnittlich mit einem Ausschlag von 1,06%.
Korrelation 0,50 Dies bedeutet, dass 25% Bewegungen des Wertpapiers durch Veränderungen des Index erklärt werden können.
Volatilität 1 Monat: 24,8%, 12 Monate: 22,7%.

Anfälligkeit bei Sinkenden Märkten
Der Bear Market Factor misst das Verhalten einer Aktie bei nachgebenden Märkten. EXPERIAN hat dabei die Tendenz allgemeine Abwärtsbewegungen des STOXX600 in ähnlichem Umfang mitzumachen. Sie ist damit ein neutraler Wert bei Marktkorrekturen.

Anfälligkeit bei steigenden Märkten
Der Bad News Factor misst Rückschläge des Aktienkurses bei steigenden Märkten. EXPERIAN zeigt dabei eine niedrige Anfälligkeit auf unternehmensspezifischen Druck. Sinkt der Kurs bei steigenden Märkten, so waren die Kursabschlägen meist unterdurchschnittlich. Sinkt die Aktie in einem steigendem Umfeld, beträgt ihre durchschnittliche Abweichung -1,65%.

Zusammenfassung der Sensitivitätsanalyse
Gesamthaft wird die Verlustanfälligkeit von EXPERIAN im Vergleich zu anderen Aktien als durchschnittlich eingeschätzt und dies seit mehr als einem Jahr.

Schlussfolgerung
Die Aktie erfüllt aktuell keinen unserer vier Sterne.
Sie wurde während der letzten Wochen weder vom Markt noch von den Analysten getragen. Preislich ist die Aktie dennoch kein Schääppchen, liegt ihr Preis doch über ihrem fundamental fairen Wert.
Das Branchenumfeld sieht mit zwei Sternen nicht ganz so negativ aus. Ein Teil der negativen Situation ist also unternehmensspezifisch.
Der Kurs der Aktie hat in der Vergangenheit auf Stresssituationen mit marktüblichen Kursverlusten reagiert. Die Verlustanfälligkeit ist für uns ein wichtiges, dem Sternerating ebenbürtiges, Bewertungskriterium. Unter Berücksichtigung dieser durchschnittlichen Verlustanfälligkeit ergibt sich ein leicht negativer Gesamteindruck.

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

Kennzahlen

Bewertung auf Basis der Gewinnprognosen für das laufende Jahr bis Ende	2027
Prognostiziertes Kurs-Gewinn-Verhältnis (LTPE) für 2027	23,0
Prognostiziertes Gewinnwachstum (LT Growth)	16,9%
Dividende (Ex Date : 20-Jun-2024)	GBP 32,02
Anzahl Analysten	15
Datum der ersten Analyse	02-Jan-2002
Finanzkennzahlen - 2024	

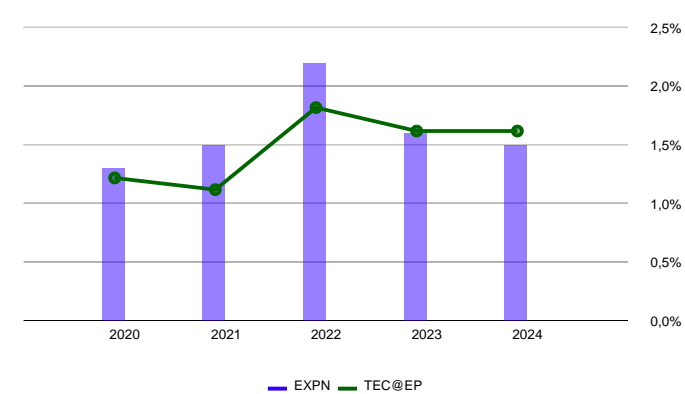
EXPERIAN - Entwicklung über 5 Jahre

KGV Entwicklung 2. August 2019 - 2. August 2024



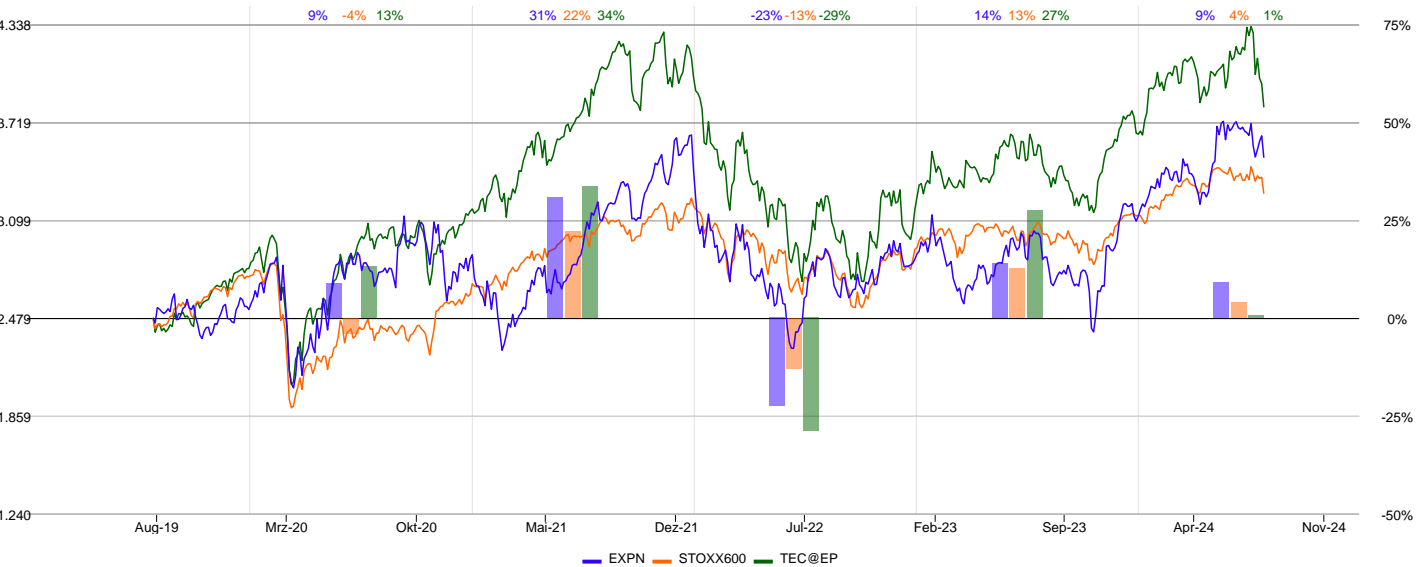
EXPERIAN ist mit einem vorausschauenden KGV von 22,95 deutlich höher bewertet als der Durchschnitt der Branche Technologie mit 13,45. Der aktuelle Preis beinhaltet bereits optimistische Zukunftsaussichten für das Unternehmen. Andererseits liegt das KGV der Aktie unter seinem historischen Median von 24,01.

Erwartete Dividendenrendite 2020 - 2024



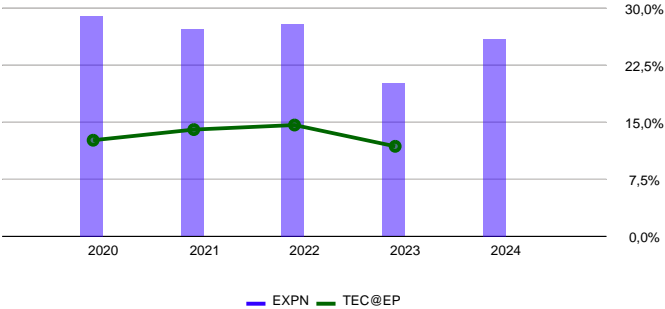
Die geschätzte Dividendenrendite für die nächsten 12 Monate beträgt 1,5%, vergleichbar mit dem Branchendurchschnitt von EXPERIAN. Wie erwähnt, entspricht diese Dividende 34,0% des erwarteten Gewinns. Die Dividende erscheint damit gut gedeckt. Die aktuelle Schätzung der erwarteten Dividende liegt nahe beim historischen Durchschnitt von 1,6%.

Performance 2. August 2019 - 2. August 2024



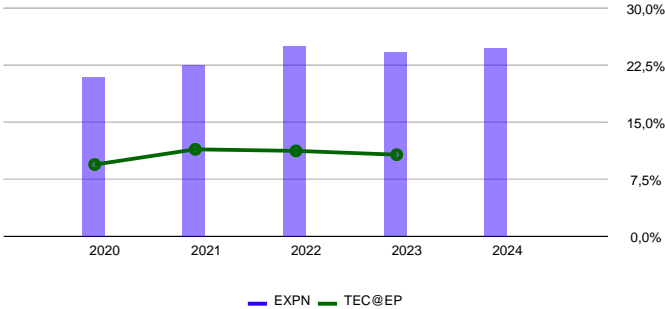
Experian plc ist zusammen mit seinen Tochtergesellschaften als Daten- und Technologieunternehmen in Nordamerika, Lateinamerika, dem Vereinigten Königreich, Irland, Europa, dem Nahen Osten, Afrika und im asiatisch-pazifischen Raum tätig. Es ist in zwei Segmenten tätig: Business-to-Business und Consumer Services. Das Unternehmen sammelt, sortiert, aggregiert und transformiert Daten aus verschiedenen Quellen, um eine Reihe von datengesteuerten Dienstleistungen anzubieten. Darüber hinaus besitzt, erstellt und entwickelt das Unternehmen Analysen, Prognosetools, hochentwickelte Software und Plattformen, Dienstleistungen in den Bereichen Kreditrisiko, Betrugsprävention, Identitätsmanagement, Kundenservice und -bindung, Kontobearbeitung und -verwaltung, Datenanalyse sowie Forschung und Entwicklung. Darüber hinaus bietet das Unternehmen Kredit Bildung, kostenlosen Zugang zu Experian Kredit-Berichte und Scores, und Online-Bildungs-Tools. Experian beliefert Kunden aus den Bereichen Finanzdienstleistungen, Direktvertrieb, Gesundheitswesen, Einzelhandel, Software und professionelle Dienstleistungen, Automobilindustrie, Versicherungen, Medien und Technologie, Telekommunikation und Versorgungsunternehmen sowie aus anderen Branchen und aus dem staatlichen und öffentlichen Sektor. Das Unternehmen war früher unter dem Namen Experian Group Limited bekannt und änderte im Juli 2008 seinen Namen in Experian plc. Experian plc wurde im Jahr 1826 gegründet und hat seinen Hauptsitz in Dublin, Irland.

Eigenkapitalrendite



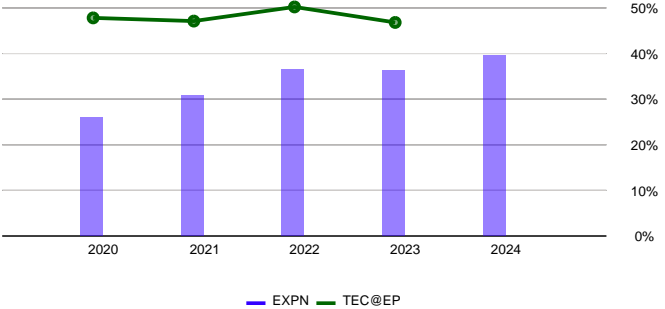
Die Eigenkapitalrendite (engl. ROE oder Return on Equity) zeigt das Verhältnis zwischen erwirtschaftetem Gewinn und vorhandenen Eigenmitteln. Bei EXPERIAN lag der mittlere ROE bei 26% und damit über dem Branchendurchschnitt von 13%, was auf eine effiziente Eigenmittelverwendung hinweist. Die letzte publizierte Eigenmittelrendite von 26% liegt nahe beim langjährigen Durchschnitt von 26%.

Gewinn vor Zinsen und Steuern (EBIT)



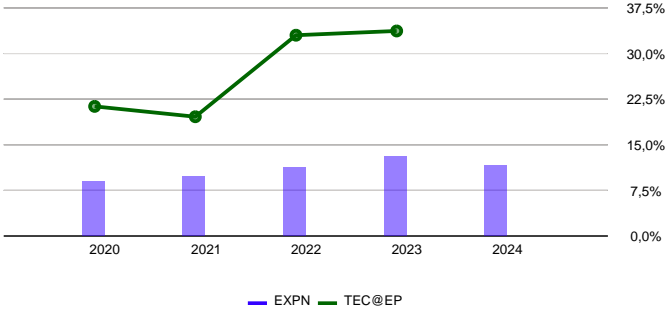
Die operative Gewinnmarge (EBIT) von EXPERIAN liegt im historischen Mittel bei 23%. Dies ist im Branchenvergleich überdurchschnittlich. Die Mitbewerber erzielten im Mittel nur eine EBIT Marge von 10%. Die zuletzt ausgewiesenen 25% liegen nahe beim historischen Mittel von 23%.

Eigenmittelanteil der Bilanz



Die Grafik stellt den Anteil der Eigenmittel an der Bilanzsumme dar. Je höher der Wert, desto konservativer ist das Unternehmen finanziert. EXPERIAN weist einen durchschnittlichen Eigenfinanzierungsgrad von 34% auf und liegt damit unter dem Branchendurchschnitt von 48%. Die aktuellen 40% liegen über dem historischen Mittel von 34%.

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 EXPERIAN liegt mit 11% unterhalb des Branchendurchschnitts von 27%. Mit 12% liegt der aktuelle Wert nahe beim historischen Durchschnitt von 11%.

Bilanz / Erfolgsrechnung

	2022	2023	2024	
	😊	😊	😊	
in Millionen	31-Mar USD	31-Mar GBP	31-Mar GBP	
Flüssige Mittel + kurzfr. Guthaben	142	169	254	3%
Forderungen	1.100	1.269	1.391	15%
Inventar	0	-	-	
Kurzfristige Aktiven	1.273	1.451	1.645	18%
Sachanlagen	316	309	300	3%
Immaterielle Aktiven	6.051	6.360	6.649	72%
Total Aktiven	8.255	8.786	9.271	100%
Verbindlichkeiten	114	1.581	1.612	17%
Kurzfristiges Fremdkapital	43	126	611	7%
Total kurzfristige Passiven	1.495	1.869	2.346	25%
Lfr. Fremdkapitalquote	3.074	3.189	2.766	30%
Eigenkapital	3.021	3.178	3.669	40%
Total Passiven	8.255	8.786	9.271	100%

Kennzahlen

Book Value	3,28	3,48	4,02
Anzahl Aktien ('000)	922.177	912.400	913.100
Anzahl Mitarbeiter	20.920	-	-

Erfolgsrechnung

	2022	2023	2024	
	😊	😊	😊	
in Millionen	31-Mar USD	31-Mar GBP	31-Mar GBP	
Umsatz	4.614	5.500	5.649	100%
Kosten	734	2.792	2.920	52%
Bruttogewinn	3.398	2.148	2.161	38%
Admin- & Gemeinkosten	2.058	805	779	14%
Forschung & Entwicklung	-	-	-	
Betriebsertrag	1.077	1.345	1.382	24%
Abschreibungen	483	560	568	10%
Gewinn vor Extras	843	976	1.235	22%
Gewinn vor Steuern	1.142	1.330	1.399	25%
Dividenden	348	401	406	7%
Reingewinn	843	640	954	17%

Ratios

Current Ratio	0,9	0,8	0,7
Langfristiges Eigenkapital	37,2%	36,3%	29,8%
Umsatz zu Aktiven	55,9%	62,6%	60,9%
Cash flow zu Umsatz	28,7%	21,8%	27,0%

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.