

# Datenquellen fuer die Susan-Levermann-Strategie

Um die notwendige Datenbasis für die Susann-Levermann-Strategie bereitstellen zu können, wird ein Mindest-Umfang an Fundamentalen Unternehmensdaten und Historischen Kursdaten (EOD) benötigt. Dies wird nachfolgend aufgeschlüsselt mit einer Empfehlung zur optimalen Datenaktualisierung:

| Kennzahl  | Weitere Details  |
|---|--|
| <b>Kriterium: Qualität</b>                        |  |
| [1]Eigenkapitalrendite                            | Die Eigenkapitalrendite (engl. Return on Equity, kurz RoE) beschreibt das Verhältnis von Gewinn zu Eigenkapital.   |
| [2] Gewinnmarge (EBIT-Marge)                      | Das EBIT (engl. earnings before interest and taxes) ist der Gewinn vor Zinsen und Steuern, das auch als operatives Ergebnis bezeichnet wird. Die EBIT-Marge ist das Verhältnis von EBIT zu Umsatz.   |
| [3] Eigenkapitalquote                             | Die Eigenkapitalquote (engl. equity ratio) ist das Verhältnis von Eigenkapital zum Gesamtkapital (Bilanzsumme).  |
| <b>Kriterium: Bewertung</b>                       |  |
| [4] Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (-5y)            | Das Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (engl. Price-Earnings-Ratio, kurz PER) beschreibt das Verhältnis vom Aktienkurs zu dem für den Vergleichszeitraum gegebenen bzw. erwarteten Gewinn je Aktie. Für das durchschnittliche KGV über 5 Jahre werden die Zahlen aus den vergangenen 3 Jahren sowie die erwarteten Zahlen für das aktuelle und das nächste Jahr verwendet. |
| [5] Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (aktuelles Jahr) | Das Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (engl. Price-Earnings-Ratio, kurz PER) beschreibt das Verhältnis vom Aktienkurs zu dem für den Vergleichszeitraum gegebenen bzw. erwarteten Gewinn je Aktie. Massgebend hier ist das von den Analysten geschätzte KGV für das aktuelle Jahr.  |
| <b>Kriterium: Stimmung</b>                        |  |

| Kennzahl                                    | Weitere Details   |
|---|---|
| [6] Analystenmeinungen                      | <p>Aktien werden von den Analysten in einer 3-stufigen Skala eingestuft: Kaufen=1, Halten=2, Verkaufen=3. Wir berechnen und bewerten den Durchschnittswert aller Meinungen.</p> <p>Die Analystenmehrheitsmeinung wird bei Small Caps mit max. 5 Analysen nach Levermann als glaubwürdig eingestuft. D.h. es gibt einen Pluspunkt, wenn die Mehrheit der Analysten "Kaufen" sagt und einen Minuspunkt, wenn die Mehrheit der Analysten "Verkaufen" sagt.</p> |
| [7] Reaktion auf die letzten Quartalszahlen | Es wird berechnet wie sich der Kurs der Aktie am Tag der Veröffentlichung der letzten Quartalszahlen in Relation zum CDAX verändert hat.  |
| <b>Kriterium: Momentum</b>                  |   |
| [8] Gewinnrevisionen                        | Es wird berechnet wie sich die Erwartungen der Analysten für den Gewinn pro Aktie (EPS) in den letzten 4 Wochen für das aktuelle und das kommende Geschäftsjahr verändert haben. Dazu wird der heutige Wert für den Gewinn pro Aktie in Relation zum Wert von vor 4 Wochen gesetzt.   |
| [9] 6-Monats-Kursverlauf                    | Die Kennzahl definiert, um wieviel Prozent sich der Kurs in den letzten 6 Monaten verändert hat.  |
| [10] 1-Jahres-Kursverlauf                   | Die Kennzahl definiert, um wieviel Prozent sich der Kurs im letzten Jahr verändert hat.   |
| [11] Kursmomentum                           | Die Kennzahl definiert, ob es in den letzten 6 Monaten eine Trendumkehr gegenüber dem gesamten letzten Jahr gab.  |
| <b>Kriterium: Technik</b>                   |   |
| [12] Dreimonatsreversal                     | Die Kennzahl berechnet, wie sich eine Aktie 3 Monate hintereinander jeweils in Relation zum Vergleichsindex entwickelt hat.   |
| <b>Kriterium: Wachstum</b>                  |   |
| [13] Gewinnwachstum                         | Es wird der geschätzte Gewinn je Aktie (EPS) für das nächste Jahr mit dem geschätzten Gewinn je Aktie für dieses Jahr verglichen.   |

# Fundamentaldaten

| <b>... auf GJ-Ebene</b>   | <b>Verbindung zur notwendigen Datenbasis für die Suann-Levermann-Strategie</b> | <b>Internet Ariva (Stand 21.07.21)</b>                                       | <b>Internet BO (Stand 21.07.21)</b> | <b>Internet Finanzen.NE T (Stand 21.07.21)</b> | <b>Tai-Pan (Stand 21.07.21)</b> | <b>Börse-Online-Premium-Statistiken (Stand 21.07.21)</b> |
|---|--|--|-------------------------------------|--|---------------------------------|--|
| Datenbank-Umfang  |  | Weltweit   | Weltweit                            | Weltweit                                       | Weltweit                        | Nur deutsche Titel (508x)                                |
| Kursdaten-Umfang (EOD in der Historie)                                | (9), (10), (11), (12)  | Internet-Kursaktualisierung sind je nach Anbieter wenige Wochen bis 20 Jahre |                                     |  | 16 Jahre                        | -  |
| Gewinn-Reihe (pro Aktie)  | (4), (5), (13)   | X<br>(16 Jahre)  | X<br>(5 Jahre)                      | X<br>(11 Jahre)                                | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(16 Jahre)  |
| Fundamentaldaten-Prognosen d.h. >Aktuelles GJ inkl. Gewinn/Dividenden | Praktisch in dieser Form nicht verwendet                                       | X<br>(1 Jahr)  | X<br>(1 Jahr)                       | X<br>(3 Jahre)                                 | X<br>(1 Jahr)                   | X<br>(1 Jahr)  |
| Dividenden-Reihe (pro Aktie)  | Praktisch in dieser Form nicht verwendet                                       | X<br>(16 Jahre)  | X<br>(5 Jahre)                      | X<br>(11 Jahre)                                | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(16 Jahre)  |
| Cashflow (pro Aktie)  | Praktisch in dieser Form nicht verwendet                                       | X<br>(16 Jahre)  | -                                   | X<br>(11 Jahre)                                | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |
| Buchwert (pro Aktie)  | Praktisch in dieser Form nicht verwendet                                       | X<br>(16 Jahre)  | -                                   | -  | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |
| EBIT  | (2)  | X<br>(16 Jahre)  | X<br>(5 Jahre)                      | X<br>(11 Jahre)                                | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |
| Umsatz  | (2)  | X<br>(16 Jahre)  | X<br>(5 Jahre)                      | X<br>(11 Jahre)                                | X<br>(26 Jahre)                 | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |
| Jahrsüberschuss   | Praktisch in dieser Form nicht verwendet                                       | X<br>(16 Jahre)  | X<br>(5 Jahre)                      | X<br>(11 Jahre)                                | -                               | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |
| Eigenkapital  | (1), (3)   | X<br>(16 Jahre)  | -                                   | X<br>(11 Jahre)                                | -                               | X<br>(Aktuelles GJ)                                      |

|  |  |                 |                |                 |   |                          |
|--|--|-----------------|----------------|-----------------|---|--------------------------|
| Bilanzsumme                                  | (3)  | X<br>(16 Jahre) | X<br>(5 Jahre) | X<br>(11 Jahre) | - | X<br>(Aktuelles GJ)      |
| Liquide Mittel                               | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | -              | X<br>(4 Jahre)  | - | X<br>(Aktuelles GJ)      |
| Cashflow                                     | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | -              | -               | - | X<br>(Aktuelles GJ)      |
| Mitarbeiter                                  | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | X<br>(16 Jahre) | -              | 7 Jahre<br>≤ GJ | - | X<br>(Aktuelles GJ)      |
| Land  <br>Branche  <br>Tätigkeitsbere<br>ich | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | X               | -              | -               | X | X (nur Land,<br>Branche) |
| Weblink                                      | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | X               | -              | X               | X | -                        |
| Hauptversam<br>mlungstermin                  | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | X               | X              | -               | X | -                        |
| Ende<br>Fiskaljahr                           | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | -              | -               | X | -                        |
| Letzter<br>Quartalsberich<br>t               | (7)  | -               | X              | X               | - | -                        |
| Kommender<br>Quartalsberich<br>t             | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | X              | X               | - | -                        |
| Bilanzierungs<br>methode                     | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | -              | -               | - | -                        |
| Logo   | Praktisch in<br>dieser Form<br>nicht<br>vewendet | -               | -              | -               | - | -                        |

|   |  |   |   |   |   |                            |
|---|--|---|---|---|---|----------------------------|
| Anzahl Aktien                                   | Praktisch in dieser Form nicht verwendet | X | - | - | X | X                          |
| Streubesitz in %                                | Praktisch in dieser Form nicht verwendet | - | - | X | - | X                          |
| Analysten-Empfehlungen für Kauf Verkauf, Halten | (6)                                      | - | - | X | - | -                          |
| Gewinnrevisionen (% vor 4W)                     | (8)                                      | - | - | - | - | -                          |
| Währung   | Praktisch in dieser Form nicht verwendet | X | X | X | X | -<br>(enthält nur €-Werte) |
| Notizen und Beschreibung                        | Praktisch in dieser Form nicht verwendet | X | X | X | - | -                          |

Was bedeutet dies nun für die Nutzung der verschiedenen Datenquellen. Praktisch bedeutet dies, dass Sie die SL-Strategie in allen Kriterien mit der Fundamentaldatenbank / Internet-Kursaktualisierungen nutzen können. Werden einige Fundamentaldaten aus den Internetaktualisierungen verwendet, lässt sich auch mit Tai-Pan bzw. der Börse-Online-Statistiken eine Aktualisierung erreichen, um die fehlende Datenbasis für die Kriterien (6) und (8), (7) aufzufüllen. Da für die Strategie alle Kriterien bewusst eine Rolle spielen, sollten Sie daher entweder konsequent auf (6), (7), (8) als Kriterium verzichten oder konsequent die Datenbasis hierfür z.B. über die Internet-Fundamentaldatenprofile herstellen.

Anders ausgedrückt: Nutzen Sie das Fundamentaldatenbank-AddON für eine vollständige Datenbasis und nutzen Sie optional TaiPan und BO-Premium-Statistiken zur Ergänzung.

Revision #1

Created 20 June 2022 12:27:53 by Jens Werschmoeller

Updated 20 June 2022 12:28:40 by Jens Werschmoeller