

DEFINITIONER

Viktat index

Indexet är viktat utifrån bolagens börsvärde, vilket innebär att företag med högre börsvärde har en större vikt i indexet. En större vikt medför att bolagets avkastning har ett proportionellt större inflytande på indexets utveckling. Exempelvis utgör Alfa Laval cirka 70 % av det samlade börsvärdet för bolagen på Lundalistan, vilket gör att indexets rörelser i hög grad påverkas av Alfa Lavals kursutveckling.

Det viktade indexet viktas om varje kvartal.

Medianindex

Det oviktade indexet tar inte hänsyn till börsvärde, utan speglar i stället medianavkastningen för samtliga bolag inom Lundalistan. Valet av median i stället för genomsnittlig avkastning motiveras av att medianen reducerar effekten av extremvärden som annars kan ge en missvisande bild av den typiska avkastningen.

Betavärde

Beta-värdet illustrerar hur Lundalistan har rört sig i förhållande till OMX30, som fungerar som jämförelseindex. Ett beta-värde över 1 innebär att Lundalistan tenderar att röra sig mer än OMX30 i både upp- och nedgångar, vilket tyder på högre volatilitet. Ett betavärde på 1 innebär att Lundalistans rörelser i genomsnitt följer OMX30:s utveckling och ett betavärde under 1 indikerar att Lundalistan är mindre volatil än OMX30 och därmed rör sig mindre i förhållande till indexet.

Volatilitet

Volatiliteten över ett år illustrerar hur kraftigt Lundalistans avkastning har varierat under de senaste tolv månaderna. En högre 1-årig volatilitet indikerar större kursrörelser och därmed högre risk, medan en lägre volatilitet tyder på mer stabila prisförändringar. Volatiliteten används som ett mått på den historiska risken i Lundalistan och ger en bild av hur mycket avkastningen typiskt sett har fluktuerat över perioden.