

Opgave 6.1

Hieronder staat een tabel met een overzicht van de jaarlijkse rendementen van een aandelenindex en van een aandeel gedurende een periode van 12 jaar.

Jaar	Markt rendement	Rendement Aandeel X
1	5	12
2	-4	-8
3	3	5
4	11	19
5	18	22
6	2	-4
7	5	1
8	7	13
9	11	18
10	-20	-32
11	2	5
12	4	7

- Wat is de standaarddeviatie van de aandelenindex en van de rendementen van aandeel X? Gebruik hiervoor werkblad 'Standaarddeviatie' uit hoofdstuk 2 of de functie STDEVA in Excel.
- Wat is de Beta van aandeel X? Gebruik hiervoor werkblad 'Beta'.
- Wat is de verband tussen het verschil in de standaarddeviaties en de Beta?