| Модель Шарпа | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Дисперсия^ | Бета^2 | | Рыночный риск | Разница дисперсий | Нерыночный риск | Общий риск |
| 5,9 | 1,0 | 3,8 | 1,9 | 2,1 | 1,5 | 2,4 |
| 2,4 | 0,6 | 2,1 | 1,5 | 0,3 | 0,5 | 1,5 |
| 32,8 | 1,3 | 4,8 | 2,2 | 28,0 | 5,3 | 5,7 |
| 45,5 | 0,5 | 1,6 | 1,3 | 43,8 | 6,6 | 6,7 |
| 8,8 | 0,7 | 2,5 | 1,6 | 6,3 | 2,5 | 3,0 |
| 2,3 | -0,1 | -0,4 | 0,0 | 2,7 | 1,6 | 1,5 |
| 16,8 | 0,5 | 1,8 | 1,3 | 15,0 | 3,9 | 4,1 |
| 306,9 | 0,0 | -0,1 | 1,0 | 307,1 | 17,5 | 17,5 |
| 19,3 | 0,7 | 2,6 | 1,6 | 16,7 | 4,1 | 4,4 |
| 0,2 | 0,0 | 0,2 | 0,4 | 0,0 | 0,1 | 0,4 |
| 264,0 | 6,4 | 23,0 | 4,8 | 241,0 | 15,5 | 16,2 |
| 3,6 | 1,0 | 3,6 | 1,9 | 0,0 | 0,0 | 1,9 |