

Korelasi Antar saham dalam Portofolio

CORR	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	IHSG
A	1.00	-0.34	0.36	-0.45	-0.33	-0.40	-0.12	-0.38	-0.23	-0.03	0.34
B		1.00	0.53	-0.34	0.89	0.93	0.77	0.30	0.53	0.17	0.16
C			1.00	0.59	0.53	0.45	0.58	0.30	0.57	0.50	0.77
D				1.00	0.30	0.78	0.58	0.75	0.80	0.81	0.51
E					1.00	0.88	0.87	0.35	0.66	0.28	0.31
F						1.00	0.76	0.37	0.65	0.19	0.20
G							1.00	-0.01	0.53	0.01	0.26
H								1.00	0.65	0.90	0.61
I									1.00	0.85	0.83
J										1.00	0.83
IHSG											1.00

Kovarian Antar saham dalam Portofolio

COV	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	IHSG
A		-1862.20	200.21	-458.75	-560.31	-776.03	-187.47	-378.27	-210.16	-26.27	174.16
B	-1862.20		964.83	2496.00	5004.60	5930.80	4090.02	1031.85	1612.40	464.18	262.04
C	200.21	964.83		170.52	298.98	292.45	308.23	103.42	176.38	140.31	129.39
D	-458.75	2496.00	170.52		830.87	925.76	564.05	474.92	-450.61	316.82	159.86
E	-560.31	5004.60	298.98	830.87		1742.00	1418.50	374.12	614.93	243.24	160.89
F	-776.03	5930.80	292.45	925.76	1742.00		1413.25	442.87	702.11	182.92	117.64
G	-187.47	4090.02	308.23	564.05	1418.50	1413.25		-10.40	474.39	7.92	126.31
H	-378.27	1031.85	103.42	474.92	374.12	442.87	-10.40		373.71	474.13	194.06
I	-210.16	1612.40	176.38	450.61	614.93	702.11	474.39	373.71		303.86	177.85
J	-26.27	464.18	140.31	316.82	243.24	182.92	7.92	474.13	303.86		214.17
IHSG	174.16	262.04	129.39	159.86	160.89	117.64	126.31	194.06	177.85	214.17	