

Lampiran 1

Kovarians Saham-Saham JII

	AALI	ADRO	AKRA	ASII	ASRI	BKSL	CPIN	EXCL	HRUM	ICBP	INCO	INDF	INTP	ITMG	JSMR	KLBF	LPKR	LSIP	PGAS	PTBA	SMGR	TLKM	UNTR	UNVR
AALI																								
ADRO	0,0012																							
AKRA	0,0010	0,0032																						
ASII	0,0007	0,0005	-0,0036																					
ASRI	-0,0013	-0,0008	-0,0092	0,001																				
BKSL	-0,0012	-0,00004	0,0001	0,0009	0,0043																			
CPIN	0,0002	0,0004	0,0006	0,002	0,0046	0,0028																		
EXCL	0,0006	0,0005	0,0011	0,0007	-0,0002	-0,0003	0,001																	
HRUM	0,0001	0,0022	0,0025	0,001	-0,0011	-9,731	-0,0008	0,0013																
ICBP	0,0013	-0,0004	0,0015	0,001	0,0018	0,0014	0,002	0,0017	-0,0002															
INCO	-0,0005	0,0023	0,0017	-0,0005	-0,0003	0,0001	-0,001	-0,0002	0,0030	-0,0008														
INDF	0,0017	0,0002	0,0006	0,0017	0,0021	0,0014	0,002	0,0008	5,8262	0,001	-0,0001													
INTP	0,0012	0,0004	-0,0011	0,001	0,0006	0,0004	0,001	0,0002	0,0006	0,001	-0,0005	0,001												
ITMG	0,0008	0,0030	-0,0033	0,0008	-0,0003	0,0003	-0,0002	0,0006	0,0018	0,001	0,001	0,0007	0,0007											
JSMR	0,0003	-8,6638	-0,0011	0,0003	0,0019	0,0011	0,001	0,0002	-0,0001	0,001	2,607	0,0006	0,0002	0,0005										
KLBF	0,0018	0,0003	0,0008	0,001	0,0018	0,0012	0,002	0,0009	0,0001	0,001	-0,0009	0,002	0,001	0,0010	0,0007									
LPKR	0,0020	9,6366	-0,0056	0,002	0,0040	0,0024	0,002	0,0004	-8,2216	0,001	-0,0005	0,001	0,001	0,0008	0,001	0,0017								
LSIP	0,0028	0,0019	0,0003	0,0006	-0,0011	-0,0004	0,0002	0,0007	0,0022	0,0008	0,001	0,0005	0,0005	0,0015	-0,0002	0,0004	0,0007							
PGAS	0,0004	0,0031	0,0004	0,001	0,0007	0,0006	0,001	0,0007	0,0007	0,001	-0,0008	0,001	0,001	0,0009	0,0004	0,0017	0,0012	0,0002						

PTBA	0,0006	0,0006	-0,0094	0,0006	-0,0007	0,0003	-0,0003	0,0004	0,0028	0,0005	0,001	0,0007	0,0006	0,0028	0,0006	0,0008	5,8919	0,001	0,0010					
SMGR	0,0001	-0,0002	0,0116	0,001	0,0015	0,0010	0,001	0,0002	0,0002	0,001	-0,0003	0,001	0,001	0,0010	0,0006	0,0012	0,0016	-4,56	0,0011	0,0005				
TLKM	-0,0001	-0,0002	0,0008	0,001	0,0011	0,0002	0,001	0,0009	-0,0001	0,001	-0,001	0,001	0,0009	9,2010	0,0003	0,0014	0,0011	-0,0004	0,0015	-0,0002	0,0011			
UNTR	0,0007	0,0015	0,0004	0,001	-2,6571	0,0007	0,001	0,0007	0,0009	0,001	-0,0005	0,0009	0,0008	0,0012	0,0001	0,0011	0,0008	0,001	0,0009	0,0015	0,0007	0,0005		
UNVR	0,0007	0,0371	0,0002	0,0006	0,0009	0,0005	0,0009	0,0004	0,0006	0,001	0,0007	0,001	0,0009	0,0001	0,0002	0,0011	0,0013	0,0001	0,0011	0,0006	0,0004	0,0007	0,0002	

Sumber: data diolah

Lampiran 2

Kovarians Saham-Saham FBMHI

	AEON (M)	AMWAY (M)	BKAWAN	HAP SENG	JTH	JCY	KNM	KRIS ASSETS	MMH	MBSB	MAS	MPI	MMC	NESTLE (M)	PETRO NA	PUN CAK	SAPU RA	SHELL	STAR HILL	SUN WAY	TA	TRADE WINDS	UNITED
AEON (M)																							
AMWAY (M)	0,0006																						
BKAWAN	0,0011	0,0005																					
HAP SENG	-0,0004	0,0002	0,0002																				
JTH	0,0004	0,0005	-0,0004	-0,0003																			
JCY	0,0007	0,00009	0,0001	-0,0039	0,0010																		
KNM	0,0007	0,00001	0,0002	0,0004	0,0006	0,0011																	
KRIS ASSETS	0,0009	0,0004	0,0001	0,0001	0,0007	0,0001	0,000																
MMH	4,7014	-4,3979	-0,0002	-3,8672	0,0001	0,0008	0,000	0,0001															
MBSB	0,0001	0,0004	0,0007	0,0001	0,0006	0,0004	0,000	0,0005	6,738														
MAS	-7,3078	0,0001	0,0002	0,0004	0,0002	0,0006	0,001	0,0002	9,596	3,6074													
MPI	0,0009	0,0012	-0,0006	-0,0003	0,0019	0,0016	0,001	0,0016	0,000	0,0006	0,00												
MMC	0,0003	0,0001	0,0003	0,0004	0,0002	0,0001	0,000	0,0001	0,000	0,0002	-8,05	0,000											
NESTLE (M)	0,0002	0,0003	0,0006	0,0001	0,0005	0,0002	0,000	0,0004	1,290	0,0004	-0,00	0,000	0,0001										
PETRO NA	0,0002	0,0003	0,0005	0,0001	-0,0001	0,0001	0,000	0,0001	2,165	0,0001	7,821	0,000	0,000	0,0003									
PUNCAK	0,0009	0,0027	0,0046	0,0004	0,0002	0,0008	0,001	0,0037	0,000	-0,0003	0,000	0,001	0,000	0,0003	0,0027								
SAPURA	0,0000	0,0000	0,0000	-0,0010	0,0003	0,0013	0,000	0,0000	0,000	0,0002	1,341	0,001	0,000	0,0001	0,0002	0,0001							

SHELL	-5,3231	-4,6793	-4,2643	-0,0001	2,1880	-3,0208	-8,64	-6,459	-2,64	-3,0143	0,000	-0,00	5,284	6,9490	-4,1259	-0,0001	1,208						
STAR HILL	0,0001	0,0004	0,0003	0,0003	0,00008	0,00001	0,000	0,0001	0,000	0,0001	0,000	0,000	0,000	0,0004	0,0004	0,0001	0,000	-3,5424					
SUNWAY	4,0979	8,6913	0,0004	0,0003	-7,2030	-0,0001	0,000	4,0080	-0,00	-8,8791	4,823	0,000	0,000	7,0575	1,7999	5,2824	-8,06	-5,5320	0,0001				
TA	0,0005	0,0012	0,0011	0,0011	0,0002	0,0001	0,000	0,0016	0,000	0,0001	0,000	0,000	0,000	0,0001	0,0016	0,0014	0,000	-0,0001	0,0004	0,000			
TRADE WINDS	0,0003	0,0001	0,0002	0,0002	0,0002	0,00004	0,0000	0,0002	6,942	0,00022	8,904	0,0006	0,000	0,0001	0,0001	-0,0001	0,000	-2,0838	0,0001	6,696	0,00		
UNITED	-0,0000	-0,0000	-0,0006	-0,0006	-0,00004	0,0007	-0,0000	0,0002	-7,40	-0,00003	-0,00	-0,000	0,000	-0,0000	0,0001	-0,0001	-0,000	-2,3902	-0,000	-1,37	-0,00	-0,00001	

Sumber: data diolah

Lampiran 3

Koefisien Korelasi Antar Saham-Saham JII

	AALI	ADRO	AKRA	ASII	ASRI	BKSL	CPIN	EXCL	HRUM	ICBP	INCO	INDF	INTP	ITMG	JSMR	KLBF	LPKR	LSIP	PGAS	PTBA	SMGR	TLKM	UNTR	UNVR
AALI	1,0000																							
ADRO	0,3189	1,0000																						
AKRA	-0,2146	0,0369	1,0000																					
ASII	0,2768	0,1689	-0,0588	1,0000																				
ASRI	-0,2568	-0,1372	-0,0816	0,3701	1,0000																			
BKSL	-0,3039	-0,0013	-0,0256	0,2657	0,6693	1,0000																		
CPIN	0,0522	0,0704	-0,0946	0,4621	0,5842	0,4281	1,000																	
EXCL	0,2783	0,1717	0,0766	0,2783	-0,0511	-0,1005	0,300	1,0000																
HRUM	0,0407	0,3399	0,0206	0,0407	-0,1314	-0,0136	-0,09	0,2803	1,0000															
ICBP	0,3665	-0,0084	0,0512	0,3665	0,2683	0,2576	0,420	0,4585	-0,0279	1,00														
INCO	-0,1335	0,380	-0,0687	-0,1335	-0,0408	0,0220	-0,13	-0,0629	0,3508	-0,12	1,00													
INDF	0,7140	0,0628	-0,2183	0,7140	0,4695	0,3729	0,536	0,3358	0,0118	0,406	-0,02	1,000												
INTP	0,6187	0,1440	-0,0219	0,6187	0,1776	0,1431	0,293	0,1101	0,1658	0,428	-0,14	0,509	1,000											
ITMG	0,2518	0,6749	-0,0392	0,2518	-0,0583	0,0816	-0,03	0,2054	0,2932	0,263	0,267	0,209	0,281	1,0000										
JSMR	0,2194	-0,0341	-0,0249	0,2194	0,5935	0,4347	0,399	0,1370	-0,0350	0,392	0,007	0,373	0,158	0,2122	1,000									
KLBF	0,6709	0,0799	-0,1991	0,6709	0,3875	0,3167	0,458	0,3446	0,0350	0,466	-0,18	0,772	0,509	0,2858	0,366	1,0000								
LPKR	0,5129	0,0170	-0,0535	0,5129	0,5569	0,4009	0,379	0,1064	-0,0103	0,260	-0,06	0,432	0,349	0,1604	0,347	0,3867	1,0000							
LSIP	0,6913	0,3935	-0,0353	0,1963	-0,1906	-0,0854	0,036	0,2053	0,3250	-0,01	0,231	0,145	0,180	0,3331	-0,09	0,0026	0,1247	1,000						
PGAS	0,1643	0,1817	-0,0340	0,5262	0,1751	0,1707	0,385	0,3149	0,1605	0,281	-0,19	0,565	0,613	0,2866	0,227	0,6562	0,3146	0,011	1,0000					

PTBA	0,1753	0,6717	-0,1089	0,1913	-0,1276	0,0653	-0,06	0,1221	0,4378	0,100	0,298	0,221	0,226	0,6475	0,262	0,2276	0,0106	0,257	0,3110	1,0000				
SMGR	0,058	0,1685	0,1693	0,6779	0,3216	0,2560	0,347	0,0945	0,0442	0,446	-0,06	0,390	0,712	0,3038	0,306	0,4130	0,3798	-0,01	0,4346	0,1542	1,0000			
TLKM	-0,0565	-0,0689	0,0129	0,5428	0,2710	0,0833	0,445	0,3967	-0,0340	0,317	-0,29	0,439	0,462	0,0287	0,205	0,5329	0,2847	-0,13	0,6796	-0,0796	0,4392	1,0000		
UNTR	0,2716	0,4378	-0,1048	0,5820	-0,0059	0,2011	0,378	0,3115	0,1902	0,294	-0,11	0,375	0,382	0,3673	0,076	0,4125	0,2131	0,342	0,3980	0,4690	0,2950	0,2146	1,0000	
UNVR	0,2274	-0,0162	-0,1451	0,2576	0,2044	0,1417	0,194	0,1498	0,1199	0,284	0,014	0,411	0,418	0,0467	0,103	0,3852	0,3117	0,015	0,4244	0,1768	0,1592	0,2741	0,0786	1,0000

Sumber: data diolah

Lampiran 4

Koefisien Korelasi Antar Saham-Saham FBMHI

	AEON (M)	AMWAY (M)	BKAWAN	HAP SENG	JTH	JCY	KNM	KRIS ASSETS	MMH	MBSB	MAS	MPI	MMC	NESTLE (M)	PETRONA	PUNCAK	SAPURA	SHELL	STAR HILL	SUNWAY	TA	TRADE WINDS	UNITED
AEON (M)	1,0000																						
AMWAY (M)	0,1338	1,0000																					
BKAWAN	-0,1533	0,0313	1,0000																				
HAP SENG	-0,1831	0,0459	0,9580	1,0000																			
JTH	0,3666	0,0947	-0,1895	-0,1692	1,0000																		
JCY	0,2434	0,0756	-0,6856	-0,6330	0,3627	1,0000																	
KNM	0,3866	0,0752	0,0674	0,1142	0,3819	0,2479	1,000																
KRIS ASSETS	0,0563	0,1091	0,1543	0,1561	-0,0138	0,1092	0,106	1,0000															
MMH	0,0308	-0,0774	-0,0807	-0,0129	0,0928	0,2435	0,072	0,1571	1,000														
MBSB	0,0884	-0,0255	-0,0363	-0,0177	-0,0613	0,1495	-0,04	0,1449	0,042	1,0000													
MAS	-0,0252	0,1732	0,0493	0,0852	0,1071	0,0938	0,357	0,2252	0,028	0,0119	1,000												
MPI	0,3318	-0,0752	-0,1226	-0,0584	0,0956	0,2304	0,292	-0,0538	0,226	0,2152	0,121	1,000											
MMC	-0,017	0,0788	0,1594	0,1943	0,0589	0,0533	0,275	0,2398	0,317	0,0498	-0,03	0,176	1,000										
NESTLE (M)	0,2764	0,0927	-0,0019	0,0057	0,3071	0,1243	0,153	0,1293	0,015	0,1120	-0,10	0,115	0,150	1,0000									
PETRONA	0,3323	0,2079	-0,0674	-0,0413	-0,2349	0,1082	0,185	0,3182	0,026	0,1611	0,004	0,272	0,204	-0,1159	1,0000								
PUNCAK	0,3372	0,0911	-0,0019	0,0783	0,0887	0,1283	0,231	-0,0749	0,213	-0,1137	0,143	0,176	0,223	0,1914	-0,0254	1,0000							
SAPURA	0,4771	-0,0126	-0,3869	-0,4110	0,3176	0,4254	0,246	0,0771	0,200	0,1998	0,004	0,350	0,224	0,1452	0,2936	0,0596	1,000						
SHELL	-0,0847	-0,2000	-0,0348	-0,1121	0,0396	-0,0201	-0,09	-0,0231	-0,03	-0,0459	0,156	-0,16	0,096	0,1976	-0,1206	-0,1022	0,018	1,0000					
STAR HILL	0,1813	-0,0023	0,2327	0,2367	-0,1517	-0,0078	0,212	0,3623	0,225	0,1750	0,207	0,295	0,270	0,1570	0,2408	0,1142	0,123	-0,1008	1,0000				
SUNWAY	0,0486	0,2771	0,2475	0,2274	-0,0972	-0,0971	0,103	0,1069	-0,11	-0,0100	0,026	0,130	0,165	0,0149	0,0392	0,0028	-0,09	-0,0139	0,2498	1,000			

TA	0,3421	0,1680	0,3694	0,3946	0,2050	0,0485	0,344	0,1868	0,165	0,0764	0,144	0,167	0,218	0,2098	-0,0183	0,4377	0,224	-0,1478	0,4700	0,279	1,000		
TRADE WINDS	-0,0037	0,0500	0,3440	0,3460	-0,0479	-0,0908	0,042	0,6153	0,165	0,2464	0,112	0,080	0,100	0,0155	0,2520	-0,1336	-0,00	-0,1208	0,5410	0,289	0,250	1,0000	
UNITED	0,0038	-0,0663	-0,4047	-0,3877	-0,0645	0,3436	0,078	0,0457	-0,07	0,0997	-0,08	0,007	0,252	-0,0386	0,3166	-0,0843	0,088	-0,0591	-0,1311	-0,02	-0,30	-0,2271	1,0000

Sumber: data diolah

