

## TUGAS : TATA KELOLA KEUANGAN PUBLIK

Kerjakan tugas berikut di kelas dan kumpulkan hari ini.

Suatu investasi A dengan kondisi ekonomi sebagai berikut;

| Kondisi ekonomi | Probabilitas | Imbal hasil |
|-----------------|--------------|-------------|
| Naik            | 0,5          | 25%         |
| Normal          | 0,3          | 10%         |
| krisis          | 0,2          | -25%        |

Suatu investasi B dengan imbal hasil sebagai berikut;

| Kondisi ekonomi | Probabilitas | Imbal hasil |
|-----------------|--------------|-------------|
| Naik            | 0,5          | 1%          |
| Normal          | 0,3          | -5%         |
| krisis          | 0,2          | 35%         |

Carilah, berapa expected return A dan B, standar deviasi A dan B, berapa Cov dan koefisien korelasi, berapa Expected return portofolio dan standard deviasi portofolionya jika proporsi investasi masing masing 0,5.

(Rumus untuk  $Cov_{A,B} = \sum P_i [r_{Ai} - E(rA)][r_{Bi} - E(rB)]$ )