

ABSTRAK

**PENGGUNAAN METODE *SIMPLE CRITERIA FOR OPTIMAL PORTFOLIO SELECTION* (SCOPS) DALAM PENGAMBILAN KEPUTUSAN INVESTASI
(Studi pada *Jakarta Islamic Index* Periode Juni 2010-November 2013)**

Oleh

LESTARIDA

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui *return* ekspektasi portofolio dan risiko portofolio dari saham yang terdaftar dalam *Jakarta Islamic Index* yang masuk dalam kombinasi portofolio optimal jika dihitung dengan menggunakan metode SCOPS untuk pengambilan keputusan investasi. Teknik pengambilan sampel dilakukan secara *purposive sampling* dengan kriteria merupakan saham yang bertahan selama periode penelitian. Dalam penelitian ini terpilih 15 saham sebagai sampel penelitian. Penggunaan metode SCOPS mengasumsikan model indeks tunggal dalam proses perhitungannya sehingga tidak perlu melakukan perhitungan dengan *mathematical programming*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa saham-saham yang masuk dalam kombinasi portofolio optimal yaitu saham UNVR dengan proporsi sebesar 41.25521706%, saham LPKR sebesar 23.87448372%, saham ASRI sebesar 34.71294343%, dan saham KLBF sebesar 0.15735579%. Kombinasi portofolio tersebut menjanjikan *return* ekspektasi portofolio sebesar 0.024469012 atau 2.4469012% yang merupakan *return* ekspektasi terbaik dibandingkan *return* ekspektasi saham individu dan risiko portofolio sebesar 0.005520273 atau 0.5520273% yang merupakan risiko terendah dibandingkan risiko saham individu.

Kata Kunci: Model indeks tunggal, *return* ekspektasi portofolio, risiko portofolio, SCOPS.