

## ABSTRAK

Pemilihan saham yang tepat menjadi sebuah hal krusial bagi investor yang ingin memaksimalkan keuntungan sembari mematuhi aturan syariah. Masalahnya, tidak semua investor memiliki pengetahuan dan keterampilan yang memadai untuk menilai saham berdasarkan kriteria yang kompleks dan dinamis. Metode *fuzzy Complex Proportional Assessment* (COPRAS) adalah metode yang memungkinkan penilaian berbasis kriteria yang tidak pasti dan beragam. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui faktor-faktor rasio keuangan apa saja yang mempengaruhi kinerja saham perbankan syariah serta efektivitas penggunaan metode *fuzzy COPRAS* dalam membantu investor memilih saham syariah terbaik dan apakah metode *fuzzy COPRAS* cukup representative untuk menganalisis kelayakan dalam menentukan saham bank syariah terbaik. Hasil dari penelitian ini menunjukkan terdapat faktor-faktor rasio keuangan yang berpengaruh terhadap harga saham di Bursa Efek Indonesia. Adapun faktor-faktor tersebut meliputi *price to book value*, *price to earnings ratio*, *debt to equity ratio*, *return on asset*, *return on equity* dan pertumbuhan pendapatan. Faktor-faktor tersebut mempengaruhi keputusan investor dalam membeli atau menjual saham yang secara langsung mempengaruhi pergerakan harga saham. penelitian ini juga menunjukkan hasil yang sesuai dengan harapan dimana diperoleh perankingan akhir prioritas untuk tiap saham bank syariah yang meliputi untuk ranking 1 yaitu Bank BTPN Syariah dengan utilitas 100 persen, untuk ranking 2 yaitu Bank Panin Dubai Syariah dengan utilitas 97,0,7 persen, untuk ranking 3 yaitu Bank Syariah Indonesia dengan utilitas 96,86 persen dan untuk ranking 4 yaitu Bank Aladin Syariah dengan utilitas 92,67 persen. Serta penggunaan metode *fuzzy COPRAS* menjadi salah satu alternatif yang cukup efektif dalam sistem pendukung keputusan yang dapat digunakan dalam menganalisis saham syariah terbaik pada sub sektor perbankan syariah.

*Kata kunci: Saham syariah, Bursa Efek Indonesia, Fuzzy (COPRAS)*