

ABSTRAK

Portofolio merupakan gabungan aset yang disusun untuk mencapai tujuan investasi investor. Masalah dalam pemilihan portofolio optimal adalah investor tidak dapat memilih saham dari berbagai sektor dibandingkan menggunakan kriteria yang sama dan bobot kriteria tertentu dalam masing-masing saham. Oleh karena itu, dalam penelitian ini akan mengatasi masalah pemilihan portofolio optimal. model dua langkah akan mengatasi pemilihan portofolio optimal. model ini dibagi menjadi dua berbeda tetapi terkait pilar : pertama yaitu membentuk portofolio di dalam sektor sedangkan kedua membentuk saham-saham dimasing-masing sektor. Metode AHP dan metode PROMETHEE digunakan untuk pemilihan portofolio optimal. Metode ini diterapkan pada saham Bursa Efek Indonesia sebagai kasus nyata. Berdasarkan hasil kombinasi parameter evolusi algoritma genetika dengan 2x percobaan didapatkan bobot terbaik yaitu pada sektor keuangan 0.2137 dengan popuasi 50 *Probabilitas Crossover* (Pc) 0.7 dan *Probabilitas mutasi* (Pm) 0.3 dengan nilai *fitness* terbaik 0.190. sedangkan untuk hasil saham dimasing-masing sektor didapat bobot terbaik pada saham MLBI (Multi Bintang Indonesia Tbk) dengan nilai bobot 0.2466.

Kata kunci: *portofolio, model dua langkah, metode AHP, metode PROMETHEE*