

Intisari

Penelitian ini bertujuan untuk menguji hubungan antara perubahan harga saham di BEJ setelah peristiwa peledakan Bom Kuningan 9 September 2005. Tujuan penelitian ini adalah : 1). Menguji signifikan *abnormal return*. 2). Menguji perbedaan *mean abnormal return* sebelum dan setelah peristiwa .

Penelitian ini menggunakan saham LQ_45 dan menggunakan analisis *one sample t-test* dan *paired sample t-test*.

Hasil penelitian ini memperlihatkan adanya *abnormal return* yang signifikan pada hari pertama, kedua, ketiga, dan keempat sebelum peristiwa. Dan *abnormal return* yang signifikan pada hari kedua dan keempat setelah peristiwa. 2) *Mean abnormal return* sebelum setelah peristiwa tidak berbeda.

Kata Kunci: *abnormal return*, *one sample t-test*, *paired sample t-test*

