

## 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.

## Abstrak

This research examines the relation between stock price change at BEJ after Kuningan September 9, 2004 bomb event. The purpose of this research are : 1). Examine the abnormal return significant. 2). Examine the differences between abnormal return of mean at BEJ before and after event.

This research used LQ\_45 stocks and used analysis one sample t-test and paired sample t-test.

The result showed that there abnormal return significant in the first, second, third, and fourth day before event. And abnormal return significant the second and fourth day after event. On Monday after event the abnormal return significant.