

ABSTRAK

Penelitian ini berfokus kepada pengaruh peristiwa bom hotel JW Marriott dan Ritz Carlton Jakarta tanggal 17 Juli 2009 terhadap indeks saham sektor-sektor industri di Bursa Efek Indonesia. Pada Bursa Efek Indonesia terdapat 9 klasifikasi sektor industri yaitu pertanian, pertambangan, industri dasar, aneka industri, industri barang konsumsi, property dan real estate, infrastruktur, keuangan, serta perdagangan, jasa dan investasi. Penelitian ini menggunakan analisis *event study* untuk melihat dampak peristiwa terhadap abnormal return indeks tiap sektor industri dan menggunakan analisis Uji T sebagai alat statistik untuk menghitung data sampel. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak terdapat pendapatan rata-rata abnormal return yang signifikan di sekitar peristiwa bom. Apabila dilihat lebih jelas pada perbedaan pendapatan abnormal kumulatif tiap sektor sebelum dan sesudah peristiwa bom terdapat dua sektor yang signifikan yaitu sektor pertambangan dan keuangan. Secara keseluruhan peristiwa bom tidak memberikan kandungan informasi pada indeks sektoral. Diperlukan penelitian lebih lanjut untuk menganalisis perubahan harga saham pada perusahaan yang terdapat pada masing-masing sektor industri.

Kata kunci: Peristiwa bom, Event study, pendapatan abnormal, uji T