REAKSI PASAR PADA PENGEBOMAN GEREJA KATEDRAL DI SULAWESI SELATAN
(Studi Pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ-45)

Oleh: WEGA WIRATAMA

NIM: 141170317

Mahasiswa Program Studi Manajemen

Fakultas Ekonomi dan Bisnis UPN “Veteran” Yogyakarta

Abstrak

Penelitian ini menggunakan objek pada Indeks LQ-45 yang terdiri dari 45 saham-saham yang paling aktif diperdagangkan atau dengan likuiditas tinggi. Selain likuiditas, kapitalisasi pasar salah satu yang menjadi pertimbangan dalam mendasari pemilihan saham perusahaan yang masuk di LQ-45 tersebut.Untuk mengetahui reaksi pasar sebelum, saat dan sesudah pengeboman Gereja Katedral di Sulawesi Selatan.Untuk mengetahui perbedaan yang signifikan terhadap abnormal return pada saham sebelum dan sesudah pengeboman Gereja Katedral di Sulawesi Selatan.Untuk mengetahui perbedaan yang signifikan terhadap *trading volume activity* pada saham sebelum dan sesudah pengeboman Gereja Katedral di Sulawesi Selatan. Penelitian ini menggunakan pendekatan studi peristiwa (*event studi*), yang merupakan studi yang mempelajari reaksi terhadap suatu peristiwa yang informasinya dipublikasikan sebagai suatu pengumuman. Tujuan dari penelitian ini untuk mengetahui dan menguji apakah terdapat reaksi pasar pada pengeboman Gereja Katedral di sulawesi Selatan yang di tunjukkan dengan adanya *abnormal return* disekitar peristiwa, serta perbedaan rata-rata *abnormal return* pada sebelum dan sesudah peristiwa. Penelitian ini juga menguji perubahan volume perdagangan saham (*trading volume activity*) sebelum dan sesudah peristiwa pengeboman Gereja Katedral di Sulawesi Selatan. Tidak terdapat perbedaan *abnormal return* saham sebelum dan sesudah peristiwa pengeboman Gereja Katerdal di Sulawesi Selatan. Tidak terdapat perbedaan *trading volume activity* saham sebelum dan sesudah peristiwa pengeboman Gereja Katerdal di Sulawesi Selatan.

Kata kunci: reaksi pasar, event studi, abnormal return