ABSTRAK

Bom Bali terjadi lagi. Entah apa yang ada dipikiran orang-orang yang melakukan peledakan bom itu sehingga banyak yang menjadi korban. Dampak yang muncul setelahnya adalah keresahan, instabilitas dan kemunduran ekonomi, apalagi krisis kepercayaan dunia pada Bali pasca pengeboman 2002 lalu. Perekonomian baru mulai berjalan lagi, wisatawan mulai datang lagi, malah tercoreng lagi. Bali ibarat PR bagi Indonesia. Bali selama ini terlalu diagung-agungkan sebagai pulau pariwisata, dan ini merupakan kesadaran bisnis, sehingga membuat orang yang ingin menghancurkan Indonesia bisa dengan menghancurkan Pulau Dewata ini terlebih dahulu. Bahkan menurut pengamat ekonomi Aviliani, karena ekonomi Bali bergantung pada pariwisata maka akibat peristiwa Bom Bali 2005 ini akan menciptakan pengangguran bagi 50 persen penduduk Bali. Ia kembali menuturkan dari 20 triliun rupiah dana yang disiapkan untuk kompensasi BBM yang 13 triliun rupiah akan digunakan untuk membuka lapangan kerja baru dan meningkatkan produktivitas sektor ekonomi di Bali, sehingga kondisi ini akan mempengaruhi perekonomian Indonesia. Ledakan bom yang menewaskan 27 orang ini langsung menjatuhkan nilai tukar rupiah. Kecemasan perihal keamanan di Indonesia kembali menghantui para pelaku pasar. Pada awal perdagangan Senin (3/10/2005), rupiah langsung terperosok ke level 10.400 per dolar AS. Sementara pada Jumat (30/9/2005), rupiah ditutup melemah tipis 10 poin ke level 10.300 per dolar AS. Analis pasar memprediksi peledakan bom akan menimbulkan sentimen negatif di pasar, Sehingga perlu dianalisis apakah terdapat perbedaan *abnormal return* antar kelompok yang dianalisis pasca pengeboman kali ini. Skripsi ini meneliti saham LQ 45 dan saham-saham yang termasuk sektor perdagangan, jasa dan investasi dimana pada sektor tersebut terdapat perusahaan restoran, hotel dan pariwisata yang ditunjukkan oleh adanya *abnormal return* selama tujuh hari setelah pengeboman itu. Pengujian statistik penelitian ini menggunakan program SPSS 11.5 *Independent t-test.* Hasil yang didapat dari penelitian ini adalah bahwa ternyata tidak ada perbedaan rata-rata *abnormal return* antar kelompok perusahaan yang dibandingkan.