

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
  - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
  - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

## ABSTRAK

### REAKSI PASAR SAHAM SYARI'AH TERHADAP PERISTIWA BOM SURABAYA 2018 DI BURSA EFEK INDONESIA

OLEH:

**Hasannul Bolqiah**  
**11471105043**

*Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui reaksi pasar saham syari'ah terhadap peristiwa bom Surabaya 2018 dengan melihat rata-rata abnormal return dan perbedaan rata-rata abnormal return sebelum peristiwa, saat peristiwa dan sesudah peristiwa. Penelitian ini menggunakan 30 sampel perusahaan yang terdaftar dalam Jakarta Islamic Index (JII) periode Desember 2017 s/d Mei 2018. Teknik analisis data dengan pendekatan mean adjusted model digunakan untuk mencari abnormal return, selanjutnya hasil analisis data di uji dengan uji-t dan paired sample t-test.*

*Hasil pengujian paired sample t test hipotesis ke-1 (H1) memiliki nilai signifikan 0,985 dan hipotesis ke-2 (H2) memiliki nilai signifikan 0,052 > taraf signifikan 0,05 hasilnya H0 diterima yaitu tidak terdapat abnormal return dan Ha ditolak. Sedangkan hipotesis ke-3 memiliki nilai signifikan 0,001 < taraf signifikan 0,05 hasilnya H0 ditolak yaitu terdapat abnormal return dan Ha diterima.*

**Kata kunci:** *Event Study, Abnormal return, dan Average Abnormal Return*