

## ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh Serangan Teroris di Negara ASEAN pada Pasar Saham Asia dan Peran Sentimen Investor periode 2000-2018. *Abnormal return* diukur dengan menggunakan selisih *actual return* dan *expected return*. Sentimen investor diukur dengan *individual stock*. Variabel independen yang digunakan dalam penelitian ini adalah peristiwa terorisme.

Sampel yang digunakan dalam penelitian ini dikumpulkan dari 25 perusahaan Asia yang terdaftar di *Dow Jones Asian Titans 50 (DJAT)* pada periode 2000-2018. Sampel diambil dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Teknik analisis dalam penelitian ini menggunakan uji *wilcoxonl*.

Hasil Uji *Wilcoxonl* menunjukkan bahwa *abnormal return* berpengaruh signifikan negatif pada saat terjadinya terorisme bali dan hat yai pada 25 perusahaan Asia dan sentiment investor tidak berpengaruh signifikan negatif pada saat terjadinya terorisme bali, super ferry dan hat yai.

Kata kunci: *Abnormal Return, Investor Sentiment*.