

ABSTRAK

Dalam dunia pasar modal, perubahan harga saham dapat diukur menggunakan suatu indikator. Indeks saham merupakan indikator untuk melihat informasi seputar pergerakan harga saham. Adanya berbagai informasi baik dari dalam negeri maupun luar negeri menjadi salah satu faktor eksternal yang menyebabkan pergerakan harga saham berubah secara signifikan.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pergerakan harga saham-saham perusahaan yang termasuk pada Indeks LQ45 dari dampak adanya peristiwa besar yang sedang terjadi yakni pandemi *Covid-19*. Penelitian menggunakan metode *Survival Analysis* dengan pendekatan *The Kaplan Meier*, harga saham merupakan variabel yang digunakan dalam penelitian ini. Data pergerakan harga saham harian dari objek penelitian dikumpulkan melalui situs dari lembaga resmi yakni www.yahoofinance.com.

Hasil penelitian yang telah dilakukan menemukan bahwa faktor eksternal yakni informasi mengenai *Covid-19* yang menyebar di seluruh dunia memberikan dampak negatif terhadap pergerakan harga saham di Indeks LQ45 yakni 45 perusahaan LQ45 mengalami penurunan harga saham selama periode pengamatan berlangsung, 5 dari 45 perusahaan masih mengalami penurunan setelah periode pengamatan berlangsung, dilihat secara sektoral, 8 sektor yang termasuk dalam LQ45 mengalami penurunan harga saham pada waktu yang sama selama periode 02 Januari s.d 31 Maret 2020.

Kata Kunci: Harga Saham, Indeks LQ45, *Survival Analysis*, *The Kaplan Meier*