

ABSTRAK

Dampak yang terjadi karena adanya Covid-19 membuat semua masyarakat harus mematuhi protokol kesehatan, sehingga membuat semua pelaku bisnis dan investor maupun masyarakat memiliki kebiasaan baru untuk tetap menjalankan aktivitas ekonomi dan sosial.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis hubungan return saham dengan berita yang juga terdapat pada RavenPack yang berisi Indeks yang mempengaruhi harga saham pada Indeks Saham LQ45. Penelitian ini menggunakan metode *Spearman Rank*, harga saham pada penelitian ini dijadikan variabel. Data pergerakan saham yang diakibatkan dari pemberitaan Covid-19 dikumpulkan melalui website *www.yahoofinance.com*.

Kesimpulan pada penelitian ini bahwa investor mengambil keputusan tidak tergantung kepada Indeks, karena ada sebagian perusahaan yang berlawanan arah yang artinya hal ini tidak berdampak pada return saham. Sehingga, kedepannya investor dapat mengambil keputusan yang tepat apabila mengamati pemberitaan

Kata Kunci : Return Saham , Indeks LQ45, Indeks Ravenpack, *Spearman Rank* , Covid-19.