

**INTEGRASI PASAR MODAL MELALUI
CONTAGION EFFECT DAN *SPILLOVER
EFFECT* MENGGUNAKAN METODE *VECTOR
AUTOREGRESSION***

**(Studi Empiris pada Pasar Modal Indonesia dan Negara Mitra
Dagang Utama Tahun 2004-2024)**



SKRIPSI

Diajukan sebagai salah satu syarat
untuk menyelesaikan Program Sarjana (S1)
pada Program Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis
Universitas Diponegoro

Disusun oleh:

ADHITYA INDARWANSYAH PUTRA

NIM. 12010121130156

**FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS
UNIVERSITAS DIPONEGORO
SEMARANG**

2024