

Stock market volatility spillovers : evidence for Latin America

Número:

943

Publicado:

Domingo, 1 Mayo 2016

Clasificación JEL:

G01, G15, C32

Palabras clave:

Volatility Spillovers, DCC-GARCH Model, Stock Market Linkages, Financial Crisis

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Borradores de Economía - ¿Los desastres naturales y los anuncios de eventos ENSO tienen un impacto en las medidas de expectativas de inflación basadas en el mercado?](#)

Luis Fernando Melo-Velandia, Daniel Parra-Amado, Juan Pablo Bermúdez-Céspedes

[Riesgo de balance en los bancos centrales: el papel del capital y las estrategias para preservarlo](#)

Lina Fernanda Torres-Gutierrez, Gonzalo Ossa-Stipcianos, Edwin Mauricio Parra-Rodriguez, Egberto Alexander Riveros, Alvaro José Martinez-Monroy, Julián Andrés Gomez-Duran, Juan Sebastián Rojas-Moreno

[De la calamidad a la oportunidad: mejoras en la calidad habitacional en Colombia durante el Fenómeno de la Niña 2010 - 2011](#)

Andrés Mauricio Sánchez-Jabba

[Otras Publicaciones](#)

We extend the framework of Diebold and Yilmaz [2009] and Diebold and Yilmaz [2012] and construct volatility spillover indexes using a DCC-GARCH framework to model the multivariate relationships of volatility among assets. We compute spillover indexes dire