

Equity markets' clustering and the global financial crisis

Borradores de Economía

Número:

937

Publicado:

Viernes, 1 Abril 2016

Clasificación JEL:

C38, L22, G15

Palabras clave:

Clustering, Unsupervised Learning, Stock Market, Connectedness

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Simulación dinámica de balances y predicción del incumplimiento crediticio: un modelo de prueba de estrés para firmas colombianas](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Gómez-Molina Andrés Camilo

[Modelo Fiscal Colombiano para la Evaluación Económica](#)

Andrés Nicolás Herrera-Rojas, David Camilo López-Valenzuela, Juan José Ospina-Tejeiro, Jesús Antonio Bejarano-Rojas

[Mitos y realidades del Catatumbo](#)

Jaime Alfredo Bonet-Moron, Yuri Carolina Reina-Aranza, Adriana Ortega, Ana Rosa Polanco

[Otras Publicaciones](#)

The effect of the Global Financial Crisis (GFC) has been substantial across markets and countries worldwide. We examine how the GFC has changed the way equity markets group together based on the similarity of stock indices' daily returns. Our examination