

Financial Contagion in Latin America

Borradores de Economía

Número:

884

Publicado:

Viernes, 1 Mayo 2015

Clasificación JEL:

G01, G15, C32

Palabras clave:

financial contagion, Financial crises, Multivariate GARCH Models

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[Otras Publicaciones](#)

This study uses a Dynamic Conditional Correlation multivariate GARCH approach for testing for contagion among Latin American financial markets to shocks originated in the United States and Europe. Using daily data on stock market returns for the period co