

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

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, 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