

Volatility spillovers among global stock markets : measuring total and directional effects - Portal de Investigaciones Económicas

Volatility spillovers among global stock markets : measuring total and directional effects

Borradores de Economía

Número:

983

Publicado:

Domingo, 1 Enero 2017

Clasificación JEL:

G01, G15, C32

Palabras clave:

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

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[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

[Otras Publicaciones](#)

In this study we construct volatility spillover indexes for some of the major stock market indexes in the world. We use a DCC-GARCH framework for modelling the multivariate relationships of volatility among markets. Extending the framework of Diebold and