

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

[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](#)

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