

# Stock market volatility spillovers : evidence for Latin America

---

Borradores de Economía

**Número:**

943

**Publicado:**

Domingo, 1 Mayo 2016

**Clasificación JEL:**

G01, G15, C32

**Palabras clave:**

Volatility Spillovers, DCC-GARCH Model, 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](#)

We extend the framework of Diebold and Yilmaz [2009] and Diebold and Yilmaz [2012] and construct volatility spillover indexes using a DCC-GARCH framework to model the multivariate relationships of volatility among assets. We compute spillover indexes dire