

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

[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](#)

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