

Extracting the sovereigns' CDS market hierarchy : a correlation-filtering approach - Portal de Investigaciones Económicas

# Extracting the sovereigns' CDS market hierarchy : a correlation-filtering approach

Borradores de Economía

**Número:**

766

**Publicado:**

Miércoles, 1 Mayo 2013

**Clasificación JEL:**

C32, G10, G11

**Palabras clave:**

correlation, minimal spanning tree, correlation-filtering, sovereign

[Descargar documento](#)

## Lo más reciente

[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

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Otras Publicaciones](#)

Since correlation may be interpreted as a measure of the influence across time-series, it may be conveniently mapped into a distance and into a weighted adjacency matrix. Based on such matrix, network theory has attempted to filter out the noise in correl