

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

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

[Borradores de Economía - Impuesto al patrimonio y estructura de capital de las empresas: oferta de crédito y efectos reales](#)

Hernán Rincón-Castro

[Borradores de Economía - ¿Los desastres naturales y los anuncios de eventos ENSO tienen un impacto en las medidas de expectativas de inflación basadas en el mercado?](#)

Luis Fernando Melo-Velandia, Daniel Parra-Amado, Juan Pablo Bermúdez-Cespedes

[Riesgo de balance en los bancos centrales: el papel del capital y las estrategias para preservarlo](#)

Lina Fernanda Torres-Gutierrez, Gonzalo Ossa-Stipcianos, Edwin Mauricio Parra-Rodriguez, Egberto Alexander Riveros, Alvaro José Martínez-Monroy, Julián Andrés Gomez-Duran, Juan Sebastián Rojas-Moreno

[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