

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

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[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