

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

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - 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

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[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