Scale-free tails in colombian financial indexes : a primer - Portal de Investigaciones

Scale-free tails in colombian financial indexes: a primer

Borradores de Economia

Número:

812

Publicado:

Sábado, 1 Marzo 2014

Clasificación JEL:

C46, C58, G32

Palabras clave:

Scale-free, Power-law, Zipf's law, Financial returns

<u>Descargar documento</u>

Lo más reciente

<u>La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados</u> Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez

Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen

Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew

<u>Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost</u>

Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola

Otras Publicaciones

A maximum likelihood method for estimating the power-law exponent verifies that the positive and negative tails of the Colombian stock market index (IGBC) and the Colombian peso exchange rate (TRM) approximate a scale-free distribution, whereas none of th