Exchange Rates Contagion in Latin America

Borradores de Economia
Número:
842
Publicado:
Martes, 9 Septiembre 2014
Clasificación JEL:
C32, C51
Palabras clave:
Exchange Rates, Contagion, Copula, Regular Vine
Descargar documento

Lo más reciente

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021
Diego Vásquez-Escobar
Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas
Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas
Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué los diferencia?
Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez
Otras Publicaciones

A regular vine copula approach is implemented for testing for contagion among the exchange rates of the six largest Latin American countries. Using daily data from June 2005 through April 2012, we find evidence of contagion among the Brazilian, Chilean, C