

Latin american exchange rate

dependencies : a regular vine copula approach

Borradores de Economía

Número:

729

Publicado:

Miércoles, 1 Agosto 2012

Clasificación JEL:

C32, C51, E42

Palabras clave:

Copula, Regular Vine, Exchange Rates, Tail Dependence Coefficients

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[Otras Publicaciones](#)

This study implements a regular vine copula methodology to evaluate the level of contagion among the exchange rates of six Latin American countries (Argentina, Brazil, Chile, Colombia, Mexico and Peru) from June 2005 to April 2012. We measure contagion in