

# 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

[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](#)

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