

## 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

[Fragile wholesale deposits, liquidity risk, and banks' maturity transformation](#)

Carola Müller, Matias Ossandon Busch, Miguel Sarmiento, Freddy A. Pinzón-Puerto

[Un análisis de cohortes de la brecha de género en la participación laboral en Colombia](#)

Francisco Javier Lasso-Valderrama, Mario Andrés Ramos-Veloz

[Simulación dinámica de balances y predicción del incumplimiento crediticio: un modelo de prueba de estrés para firmas colombianas](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Gómez-Molina Andrés Camilo

[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