

Estimating the COP Exchange Rate

Volatility Smile and the Market Effect of Central Bank Interventions: A CHARN Approach

Borradores de Economía

Número:

347

Publicado:

Lunes, 1 Agosto 2005

Clasificación JEL:

C14, C22, E58, F31, E44

Palabras clave:

Volatility Smile, Exchange Rate Risk, Nonparametric Estimation, Central bank intervention

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Leyes de márgenes mínimos y fijación de precios en comercios multiproducto](#)

Daniel Herrera-Araujo, Jorge Florez-Acosta

[Trabajo de cuidado no remunerado y brechas regionales de género en la participación laboral en Colombia](#)

Luis Armando Galvis-Aponte, Adriana Marcela Rivera-Zárate

[Evaluación de los efectos de las recientes normas de provisiones sobre la asignación del crédito de consumo en Colombia](#)

Diego Fernando Cuesta-Mora, Fredy Alejandro Gamboa-Estrada, Camilo Eduardo Sánchez-Quinto

[Otras Publicaciones](#)

In this paper we estimated a volatility model for COP/US under two different samples, one containing the information before the “discretionary interventions” started, and the other using the whole sample. We use a nonparametric approach to estimate the mea