

Estimating the COP Exchange Rate

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

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

[Riesgo de balance en los bancos centrales: el papel del capital y las estrategias para preservarlo](#)

Lina Fernanda Torres-Gutierrez, Gonzalo Ossa-Stipcianos, Edwin Mauricio Parra-Rodriguez, Egberto Alexander Riveros, Alvaro José Martínez-Monroy, Julián Andrés Gómez-Durán, Juan Sebastián Rojas-Moreno

[De la calamidad a la oportunidad: mejoras en la calidad habitacional en Colombia durante el Fenómeno de la Niña 2010 - 2011](#)

Andrés Mauricio Sánchez-Jabba

[Evolución de la distribución de los nuevos préstamos por categoría de riesgo a lo largo del ciclo de crédito de la postpandemia en Colombia](#)

Gómez-Molina Andrés Camilo, Carlos Quicazán-Moreno, Hernando Vargas-Herrera

[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