

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

[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

[Oportunidades negadas: radiografía de la exclusión y el trabajo precario para la juventud en Cartagena](#)

Andrea Sofía Otero-Cortés, Karina Acosta, Jhorland Ayala-García, Oriana Álvarez Vos, Sara Rojas

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[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