



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 28 de junio y el viernes 02 de julio se negociaron 1.375.382.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 275.076.000 dólares por día. Al viernes 02 de julio: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.889.774 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9342 por dólar, un 0,0483%% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,91% anual teniendo en cuenta posiciones desde Junio de 2010 hasta Noviembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,64%. • La volatilidad histórica anual de la posición julio fue del 0,86%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from June 28th to July 02nd reached US\$ 1,375,382,000, which gave a daily average of U\$S 275,076,000 for the same period. On July 02nd: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,889,774 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9342 \$/U\$S, that is 0.0483% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.91%, if we consider positions from June 2010 to November 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.64%. • The annual historical volatility of July dollar future contract reached 0.86%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcropa

 es.linkedin.com/BCR

 www.instagram.com/BCR

 www.youtube.com/BolsadeRosario

 BOLSA DE COMERCIO DE ROSARIO
Córdoba 1402 - S2000AWV

 TELÉFONO
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL
contacto@bcr.com.ar

 WWW
bcr.com.ar