



Prensa

## Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 2 y el viernes 6 de agosto se negociaron 2.021.087.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 404.217.000 dólares por día. Al viernes 6 de agosto: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.692.898 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9325 por dólar, un 0,1777% por debajo del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,42% anual teniendo en cuenta posiciones desde agosto de 2010 hasta Diciembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,97%. • La volatilidad histórica anual de la posición agosto fue del 1,17%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from August 2nd to 6th reached US\$ 2,021,087,000, which gave a daily average of US\$ 404,217,000 for the same period. On August 6th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,692,898 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9325 \$/US\$, that is 0.1777% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.42%, if we consider positions from August 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.97%. • The annual historical volatility of August dollar future contract reached 1.17%.



BOLSA  
DE COMERCIO  
DE ROSARIO

 [www.facebook.com/BCROficial](http://www.facebook.com/BCROficial)

 [twitter.com/bcrprensa](https://twitter.com/bcrprensa)


 [es.linkedin.com/BCR](https://es.linkedin.com/BCR)

 [www.instagram.com/BCR](http://www.instagram.com/BCR)

 [www.youtube.com/BolsadeRosario](http://www.youtube.com/BolsadeRosario)

 BOLSA DE COMERCIO DE ROSARIO  
Córdoba 1402 - S2000AWW

 TELÉFONO  
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL  
contacto@bcr.comar

 WWW  
bcr.comar