Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 9 y el viernes 13 de agosto se negociaron 1.980.156.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 396.031.200 dólares por día. Al viernes 13 de agosto:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.756.698 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9325 por dólar, exactamente en la misma cotización del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,13% 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 0,82%.• La volatilidad histórica anual de la posición agosto fue del 1,07%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from August 9th to 13th reached US$ 1,980,156,000, which gave a daily average of U$S 396,031,200 for the same period. On August 13th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,756,698 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9325 $/U$S, that is the exactly same value reached on previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.13%, if we consider positions from August 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.82%. • The annual historical volatility of August dollar future contract reached 1.07%.

Este material se encuentra inscripto en el Registro de la Propiedad Intelectual bajo el N xxxxx, puede ser reproducido de manera total o parcial citando como fuente.