



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el martes 17 y el viernes 20 de agosto se negociaron 914.168.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 228.542.000 dólares por día. Al viernes 20 de agosto: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.823.287 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9382 por dólar, un 0,1449% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,94% 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 0,70%. • La volatilidad histórica anual de la posición agosto fue del 1,09%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from August 17th to 20th reached US\$ 914,168,000, which gave a daily average of U\$S 228,542,000 for the same period. On August 20th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,823,287 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9382 \$/U\$S, that is 0.1449% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.94%, if we consider positions from August 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.70%. • The annual historical volatility of August dollar future contract reached 1.09%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcrprensa

 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.comar

 WWW
bcr.comar