



Prensa

## Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 23 y el viernes 27 de agosto se negociaron 963.850.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 192.770.200 dólares por día. Al viernes 27 de agosto: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.906.514 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9438 por dólar, un 0,1422% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,44% anual teniendo en cuenta posiciones desde septiembre de 2010 hasta Diciembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,69%. • La volatilidad histórica anual de la posición agosto fue del 0,79%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from August 23th to 27th reached US\$ 963,850,000, which gave a daily average of U\$S 192,770,000 for the same period. On August 27th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,906,514 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9438 \$/U\$S, that is 0.1422% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.44%, if we consider positions from September 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.69%. • The annual historical volatility of August dollar future contract reached 0.79%.



BOLSA  
DE COMERCIO  
DE ROSARIO

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

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

 [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.com.ar

 WWW  
bcr.com.ar