



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 6 y el viernes 10 de septiembre se negociaron 1.189.568.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 237.913.600 dólares por día. Al viernes 10 de septiembre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.638.034 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9460 por dólar, un 0,0456% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,96% 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 0,99%. • La volatilidad histórica anual de la posición septiembre fue del 0,71%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from September 6th to 10th reached US\$ 1,189,568,000, which gave a daily average of U\$S 237,913,600 for the same period. On September 10th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,638,034 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9460 \$/U\$S, that is 0.0456% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.96%, if we consider positions from September 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.99%. • The annual historical volatility of September dollar future contract reached 0.71%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcrprensa


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