Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el martes 12 y el viernes 15 de octubre se negociaron 1.590.909.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 397.727.000 dólares por día.Al viernes 15 de octubre:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.724.491 contratos.• El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9503 por dólar, un 0,1769% por debajo del viernes anterior.• Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 14,9% anual teniendo en cuenta posiciones desde octubre de 2010 hasta diciembre de 2011.• La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,49%.• La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 1,03%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from October 12th to 15th reached US$ 1,590,909,000, which gave a daily average of U$S 397,727,000 for the same period. On October 15th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,724,491 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9503 $/U$S, that is 0.1769% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 14. 9%, if we consider positions from October 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.49%. • The annual historical volatility of October dollar future contract reached 1.03%.

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.