



Prensa

## Informe Dolar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 8 y el viernes 12 de noviembre se negociaron 688.439.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 137.687.800 dólares por día. Al viernes 12 de noviembre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.733.875 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9632 por dólar, un 0,1364% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,31% anual, teniendo en cuenta posiciones desde noviembre de 2010 hasta enero de 2012. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,41%. • La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 0,80%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from November 8st to 12th reached US\$ 688,439,000, which gave a daily average of U\$S 137,687,800 for the same period. On November 12th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,733,875 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9632 \$/U\$S, that is 0.1364% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.31%, if we consider positions from November 2010 to January 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.41%. • The annual historical volatility of November dollar future contract reached 0.80%.



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/company/BCR)

 [www.instagram.com/BCR](https://www.instagram.com/BCR)

 [www.youtube.com/BolsadeRosario](https://www.youtube.com/BolsadeRosario)

 BOLSA DE COMERCIO DE ROSARIO  
Córdoba 1402 - S2000AWW

 TELÉFONO  
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL  
[contacto@bcr.com.ar](mailto:contacto@bcr.com.ar)

 WWW  
[bcr.com.ar](http://bcr.com.ar)