Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 15 y el viernes 19 de noviembre se negociaron 1.149.926.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 229.985.200 dólares por día.Al viernes 19 de noviembre:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.787.744 contratos.• El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9735 por dólar, un 0,2599% por encima del viernes anterior.• Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,87% 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 1,02%.• La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 1,01%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from November 15th to 19th reached US$ 1,149,926,000, which gave a daily average of U$S 229,985,200 for the same period. On November 19th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,787,744 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9735 $/U$S, that is 0.2599% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.87%, if we consider positions from November 2010 to January 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 1.02%. • The annual historical volatility of November dollar future contract reached 1.01%.

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.