



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%.



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)