



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 20 y el jueves 23 de diciembre se negociaron 703.432.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 175.858.600 dólares por día. Al jueves 23 de diciembre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.721.382 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9753 por dólar, un 0,0050% por debajo del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,86% anual, teniendo en cuenta posiciones desde diciembre de 2010 hasta febrero de 2012. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,48%. • La volatilidad histórica anual de la posición diciembre fue del 1,49%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from December 20th to 23rd reached US\$ 703,432,000, which gave a daily average of U\$S 175,858,000 for the same period. On December 23rd: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,721,382 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9753 \$/U\$S, that is 0.0050% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.86%, if we consider positions from December 2010 to February 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.48%. • The annual historical volatility of December dollar future contract reached 1.49%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcrprensa


 es.linkedin.com/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