Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 10 y el viernes 14 de enero se negociaron 937.904.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 187.580.800 dólares por día.Al viernes 14 de enero:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.793.833 contratos.• El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9777 por dólar, un 0,098% 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 enero de 2011 hasta febrero de 2012.• La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,93%.• La volatilidad histórica anual de la posición enero fue del 0,79%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from January 10th to 14th reached US$ 937,904,000, which gave a daily average of U$S 187,580,800 for the same period. On January 14th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,793,833 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9777 $/U$S, that is 0.098% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.31%, if we consider positions from January 2011 to February 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.93%. • The annual historical volatility of January dollar future contract reached 0.79%.

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.