



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 27 de septiembre y el viernes 1 de octubre se negociaron 1.316.303.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 263.260.600 dólares por día. Al viernes 1 de octubre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.712.371 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9612 por dólar, un 0,1517% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 9,67% anual teniendo en cuenta posiciones desde octubre de 2010 hasta diciembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 2,03%. • La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 2,13%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from September 27th to October 1st reached US\$ 1,316,303,000, which gave a daily average of U\$S 263,260,600 for the same period. On October 1st: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,712,371 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9612 \$/U\$S, that is 0.1517% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 9.67%, if we consider positions from October 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 2.03%. • The annual historical volatility of October dollar future contract reached 2.13%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO


 www.facebook.com/BCROficial


 twitter.com/bcropa


 [es.linkedin.com/BCR](https://es.linkedin.com/company/BCR)

 www.instagram.com/BCR

 www.youtube.com/BolsadeRosario

 BOLSA DE COMERCIO DE ROSARIO
Córdoba 1402 - S2000AWW

 TELÉFONO
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL
contacto@bcr.com.ar

 WWW
bcr.com.ar