



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 4 y el viernes 8 de octubre se negociaron 787.325.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 157.465.000 dólares por día. Al viernes 8 de octubre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.553.236 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3.957 por dólar, un 0,0985% por debajo del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 9,79% anual teniendo en cuenta posiciones desde noviembre de 2010 hasta diciembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 2,08%. • La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 2,06%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from October 4th to 8th reached US\$ 787,325,000, which gave a daily average of U\$S 157,465,000 for the same period. On October 8th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,553,236 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 39570 \$/U\$S, that is 0.0985% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 9.79%, if we consider positions from November 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 2.08%. • The annual historical volatility of October dollar future contract reached 2.06%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcypressa

 [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 - S2000AWV

 TELÉFONO
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL
contacto@bcr.com.ar

 WWW
bcr.com.ar