



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el martes 23 y el viernes 26 de noviembre se negociaron 1.207.010.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 301.752.500 dólares por día. Al viernes 26 de noviembre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.803.028 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9768 por dólar, un 0,0831% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,03% 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 1,11%. • La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 1,19%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from November 23rd to 26th reached US\$ 1,207,010,000, which gave a daily average of U\$S 301,752,500 for the same period. On November 26th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,803,028 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9768 \$/U\$S, that is 0.0831% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.03%, if we consider positions from November 2010 to January 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 1.11%. • The annual historical volatility of November dollar future contract reached 1.19%.



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