Prensa

# Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 29 y el viernes 3 de diciembre se negociaron 2.833.213.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 566.642.600 dólares por día.Al viernes 3 de diciembre:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.460.118 contratos.• El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9795 por dólar, un 0,0679% por encima del viernes anterior.• Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 9,24% anual, teniendo en cuenta posiciones desde diciembre de 2010 hasta enero de 2012.• La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 1,14%.• La volatilidad histórica anual de la posición diciembre fue del 0,80%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from November 29rd to December 3rd reached US$ 2,833,213,000, which gave a daily average of U$S 566,642,600 for the same period. On December 3rd: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,460,118 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9795 $/U$S, that is 0.0679% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 9.24%, if we consider positions from December 2010 to January 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 1.14%. • The annual historical volatility of December dollar future contract reached 0.80%.



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.