



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 13 y el viernes 17 de diciembre se negociaron 1.265.413.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 253.082.600 dólares por día. Al viernes 17 de diciembre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.785.781 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9755 por dólar, un 0,0176% por debajo del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 10,07% 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 0,52%. • La volatilidad histórica anual de la posición diciembre fue del 1,24%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from December 13th to 17th reached US\$ 1,265,413,000, which gave a daily average of U\$S 253,082,600 for the same period. On December 17th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,785,781 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9755 \$/U\$S, that is 0.0176% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 10.07%, if we consider positions from January 2011 to February 2012. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.52%. • The annual historical volatility of December dollar future contract reached 1.24%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO

 www.facebook.com/BCROficial

 twitter.com/bcnprensa

 [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