



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 27 y el jueves 30 de diciembre se negociaron 1.049.702.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 262.425.500 dólares por día. Al jueves 30 de diciembre:

- El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.527.885 contratos.
- El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9758 por dólar, un 0,0126% por encima del jueves anterior.
- Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 9,83% 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 1,59%.
- La volatilidad histórica anual de la posición diciembre fue del 1,38%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from December 27th to 30th reached US\$ 1,049,702,000, which gave a daily average of U\$S 262,425,500 for the same period. On December 30th:

- The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,527,885 contracts.
- The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9758 \$/U\$S, that is 0.0126% higher than previous Friday.
- The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 9.83%, if we consider positions from January 2011 to February 2012.
- The BCRA 3500 index annual historical volatility was 1.59%.
- The annual historical volatility of December dollar future contract reached 1.38%.



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 - S2000AWV

 TELÉFONO
(54 341) 5258300 / 4102600

 EMAIL
contacto@bcr.com.ar

 WWW
bcr.com.ar