Prensa

# Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 2 y el viernes 6 de agosto se negociaron 2.021.087.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 404.217.000 dólares por día. Al viernes 6 de agosto:• El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.692.898 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a $3,9325 por dólar, un 0,1777% por debajo del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 11,42% anual teniendo en cuenta posiciones desde agosto de 2010 hasta Diciembre de 2011.• La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 0,97%.• La volatilidad histórica anual de la posición agosto fue del 1,17%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from August 2nd to 6th reached US$ 2,021,087,000, which gave a daily average of U$S 404,217,000 for the same period. On August 6th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,692,898 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3.9325 $/U$S, that is 0.1777% lower than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 11.42%, if we consider positions from August 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 0.97%. • The annual historical volatility of August dollar future contract reached 1.17%.



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.