



Prensa

Informe Dólar Rofex

RESUMEN Entre el lunes 18 y el viernes 22 de octubre se negociaron 1.355.156.000 dólares en contratos de futuros y opciones de dólar en Rofex®, lo que equivale a un promedio de transacciones de 271.031.200 dólares por día. Al viernes 22 de octubre: • El interés abierto en el mercado de futuros y opciones de dólar fue de 1.927.005 contratos. • El Dólar de Referencia del Banco Central cerró a \$3,9579 por dólar, un 0,1873% por encima del viernes anterior. • Las Tasas de Interés Implícitas en los futuros Dólar ROFEX llegaron hasta el 14,07% anual, teniendo en cuenta posiciones desde octubre de 2010 hasta diciembre de 2011. • La volatilidad histórica anual del Índice de Referencia 3500 del Banco Central fue del 1,02%. • La volatilidad histórica anual de la posición octubre fue del 1,18%.

ABSTRACT The volume in Dollar futures and options contracts traded on the ROFEX® from October 18th to 22th reached US\$ 1,355,156,000, which gave a daily average of U\$S 271,031,200 for the same period. On October 22th: • The total open interest on dollar futures and options at the ROFEX amounted to 1,927,005 contracts. • The BCRA 3500 reference dollar closed at 3,9579 \$/U\$S, that is 0.1873% higher than previous Friday. • The implied annual rates for the Dollar BCRA 3500 future contract reached 14.07%, if we consider positions from October 2010 to December 2011. • The BCRA 3500 index annual historical volatility was 1.02%. • The annual historical volatility of October dollar future contract reached 1.18%.



BOLSA
DE COMERCIO
DE ROSARIO



www.facebook.com/BCROficial



twitter.com/bcrprensa



[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