

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros

Abril 2022

Highlights del mes

MatbaRofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en abril 27,5 millones de contratos (+33,3% MoM). En términos interanuales, este volumen fue un 241,5% superior al mismo mes de 2021.*
- ✓ *La operatoria de futuros y opciones de dólar alcanzó en el cuarto mes del año 12,3 millones de contratos, un 17% superior a marzo y un 56% por encima de abril de 2021.*
- ✓ *En términos nocionales, el volumen agregado del mes fue de 13.249 millones de dólares (+17,2% MoM y +55,8% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del mes para todos los productos se ubicó en 11,3 millones de contratos (+10,5% MoM y +314% YoY).*
- ✓ *En los primeros cuatro meses del año y teniendo en cuenta la operatoria de Letras del Tesoro, el volumen operado acumuló 69,2 millones de contratos (87,9% por encima del mismo período del año anterior) y el interés abierto promedio diario alcanzó 7,8 millones de contratos (+130,4% vs. los primeros cuatro meses del 2021).*

Visión General

Matba Rofex

Abril | 2022: Volumen en Contratos

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Letras del Tesoro	15,0M	51,5%	NA	7,9M	27,2%	NA
Monedas	12,3M	17,0%	56,0%	3,4M	-15,4%	24,9%
Acciones Individuales	52,5K	-23,5%	10,0%	8,2K	66,7%	41,3%
Índices Accionarios	33,8K	-19,0%	-50,9%	2,8K	8,5%	-22,3%
Energía	14,9K	-45,2%	224,2%	1,1K	-48,6%	-61,8%
Metales	3,4K	-3,0%	7,4%	1,3K	-4,9%	380,4%
Subtotal (sin LEDES)	12,5M	16,4%	54,9%	3,4M	-15,3%	24,8%
Total	27,5M	33,3%	241,5%	11,3M	10,5%	314,0%

Fuente: MtR

Visión General

Matba Rofex

Abril | 2022: Volumen Nocional

	Volumen Nocional en USD			IA Prom. Diario Nocional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	13.055,9M	17,4%	54,7%	3.614,8M	-14,1%	24,7%
Letras del Tesoro	123,0M	44,1%	NA	65,3M	22,9%	Inf%
Índices Accionarios	36,6M	-23,1%	-23,8%	3,0M	4,7%	23,6%
Energía	14,9M	-49,1%	420,5%	1,1M	-51,8%	-37,9%
Acciones Individuales	11,5M	-27,9%	46,9%	1,9M	49,9%	107,5%
Metales	6,6M	-3,7%	18,2%	2,5M	-5,8%	426,0%
Total	13.248,6M	17,2%	55,8%	3.688,7M	-13,6%	27,0%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2022: Volumen en Contratos

	Volumen acumulado*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2022	2021	Var%	2022	2021	Var%
Monedas	43,7M	36,3M	20,6%	4,2M	3,4M	26,6%
Letras del Tesoro	25,0M	0,0	NA	3,5M	0,0	NA
Acciones Individuales	257,3K	225,1K	14,3%	6,4K	5,5K	16,1%
Índices Accionarios	157,9K	311,4K	-49,3%	3,1K	7,4K	-58,5%
Energía	74,9K	31,2K	140,0%	2,3K	2,7K	-15,9%
Metales	18,5K	13,4K	38,2%	1,2K	982,0	22,6%
Subtotal (sin LEDES)	44,2M	36,8M	20,1%	4,3M	3,4M	26,3%
Total	69,2M	36,8M	87,9%	7,8M	3,4M	130,4%

*En contratos, datos acumulados al 30/04 de cada año

Fuente: MtR

Visión General

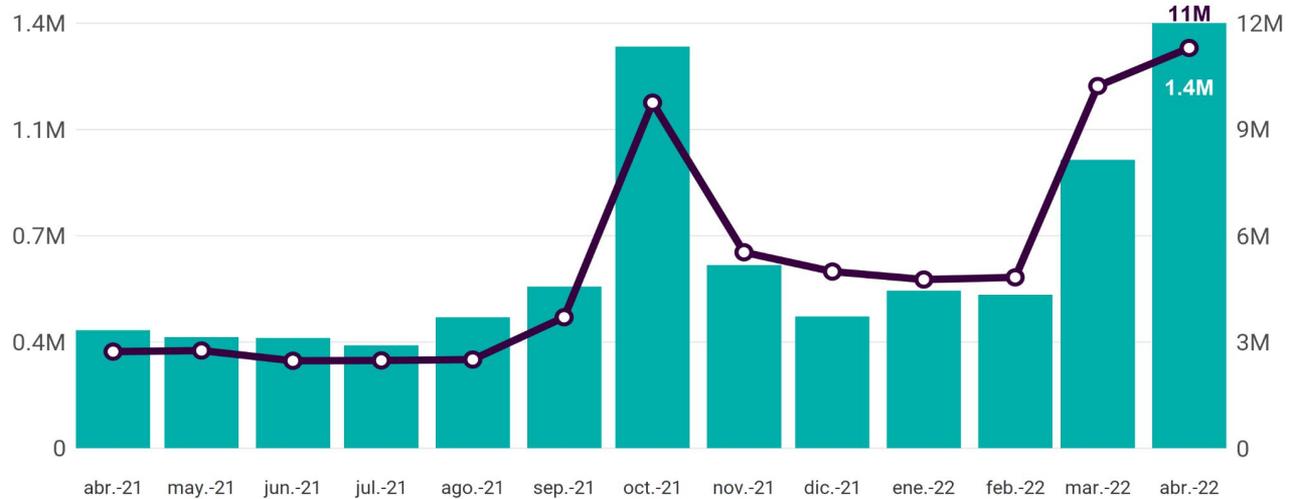
Volumen Histórico de FyO

Matba Rofex

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

Dólar: Operatoria

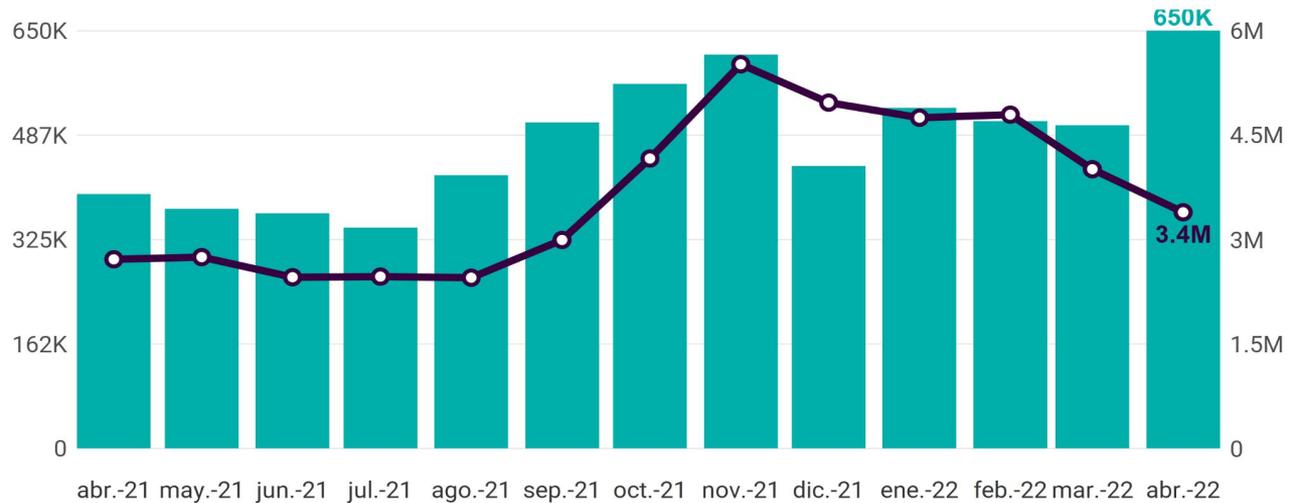
Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

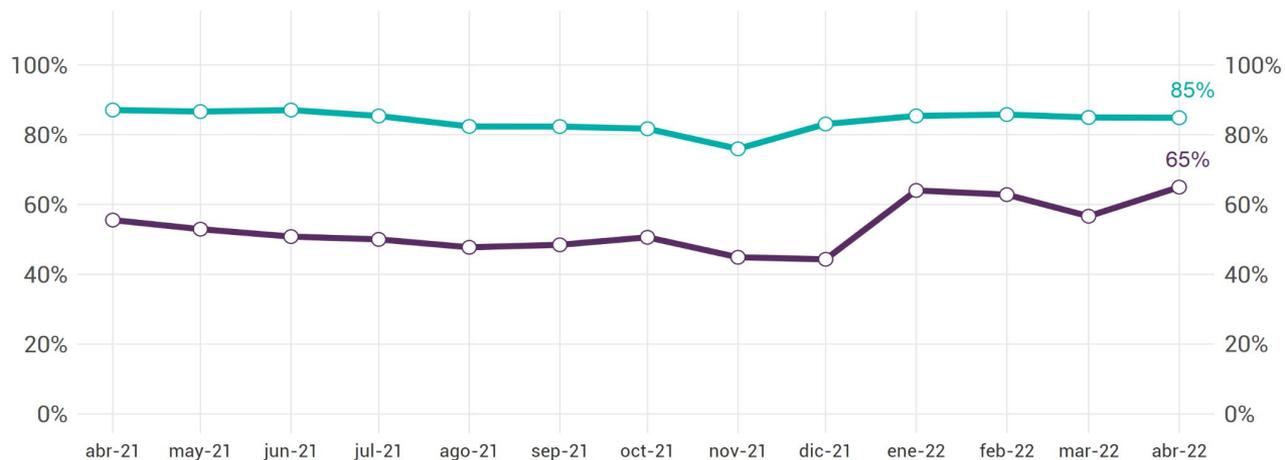
Dólar: Market Share

Mercado de Cambios

Matba Rofex

Mercado de Cambios Market Share MtR Mensual

○ En el Mercado de Cambios* ● En el Mercado a Término**



*Mercado de Cambio: Spot (FOREX MAE) + Término (FyO MtR y ByMA + OCT y CPC2 MAE)

**Mercado a Término: FyO MtR y ByMa + OCT y CPC2 MAE

Fuente: MtR

Dólar: Operatoria

Futuros

Matba Rofex

Posición	Precio de Ajuste al 30/04			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR042022	115,31	-0,04	-0,0% ▼	5.625.388	42% ▲	0	-100% ▼
DLR052022	120,73	0,36	0,3% ▲	4.814.690	305% ▲	2.465.967	425% ▲
DLR062022	127,05	1,85	1,5% ▲	826.454	138% ▲	361.946	102% ▲
DLR072022	133,70	3,70	2,8% ▲	547.517	181% ▲	243.283	71% ▲
DLR082022	141,30	5,90	4,4% ▲	135.386	25% ▲	63.043	36% ▲
DLR092022	147,55	7,31	5,2% ▲	164.724	16% ▲	62.675	20% ▲
DLR102022	154,50	9,50	6,6% ▲	70.508	257% ▲	31.883	37% ▲
DLR112022	160,10	10,25	6,8% ▲	23.331	-70% ▼	78.991	2% ▲
DLR122022	166,80	12,05	7,8% ▲	55.372	745% ▲	18.915	212% ▲
DLR012023	172,20	12,25	7,7% ▲	29.475	-26% ▼	10.613	-17% ▼
DLR022023	177,50	12,50	7,6% ▲	21.485	-44% ▼	8.886	59% ▲
DLR032023	182,95	12,95	7,6% ▲	31.698	Inf% ▲	7.313	Inf% ▲
PROMEDIO/TOTAL	N/C	7,38	4,8% ▲	12.346.028	17% ▲	3.353.515	14% ▲

Fuente: MtR

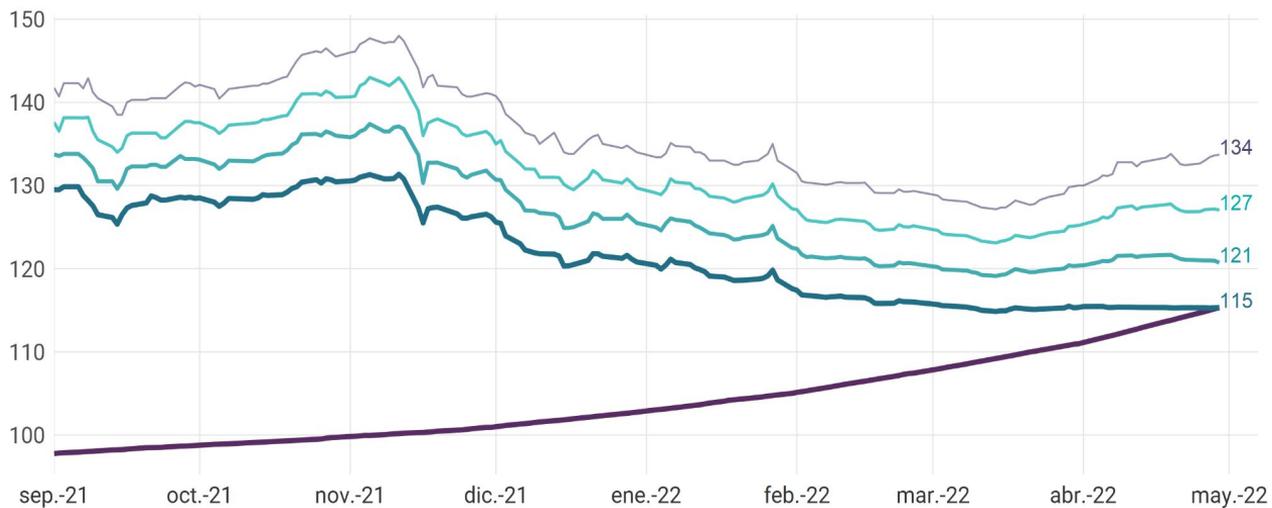
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

AR\$/US\$, últimos 9 meses del spot y primeras cuatro posiciones

Spot DLR042022 DLR052022 DLR062022 DLR072022

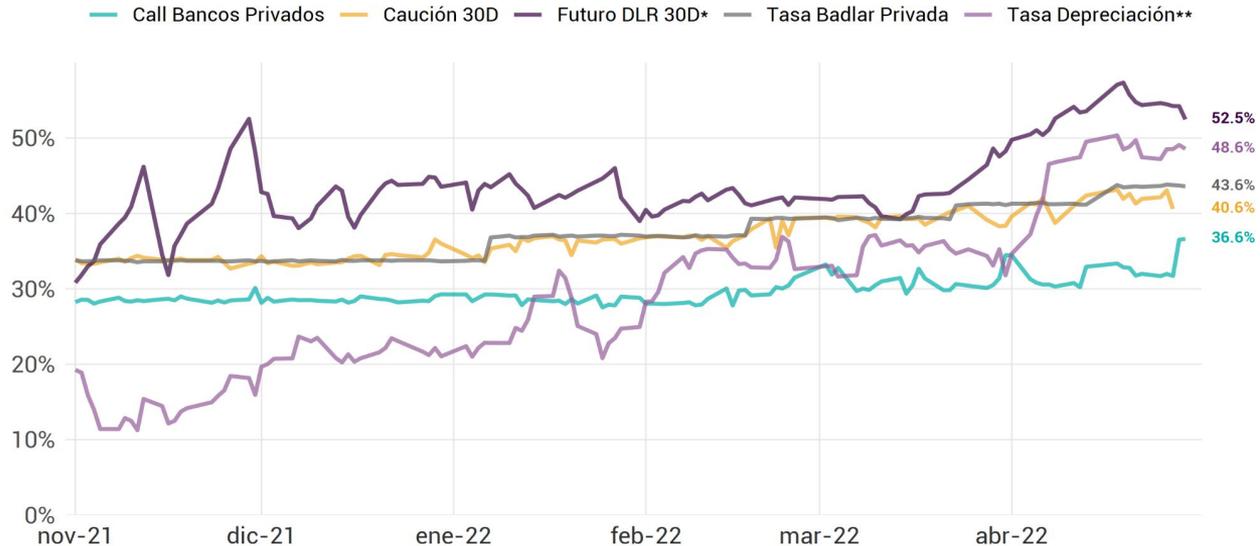


Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Evolución de Tasas Nominales Anuales (TNA) con composición continua



*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días

**Tasa de depreciación del tipo de cambio A3500 spot, media móvil de 5 períodos

Fuente: MtR y Reuters

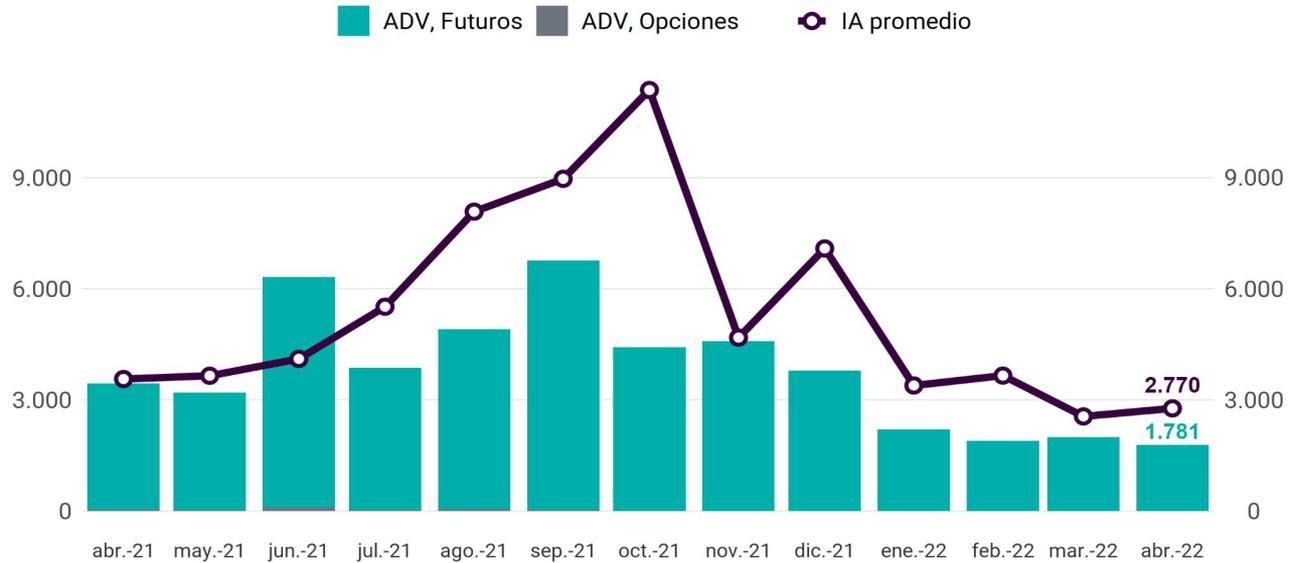
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

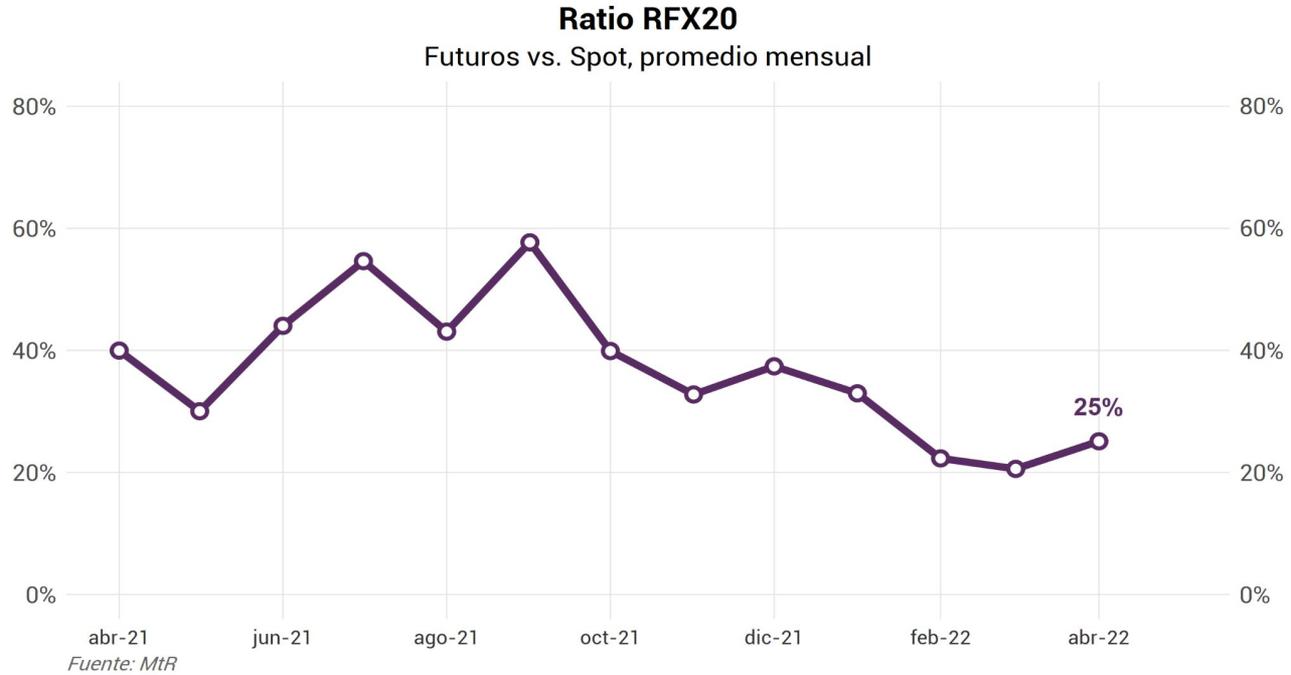


Fuente: Mtr

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex

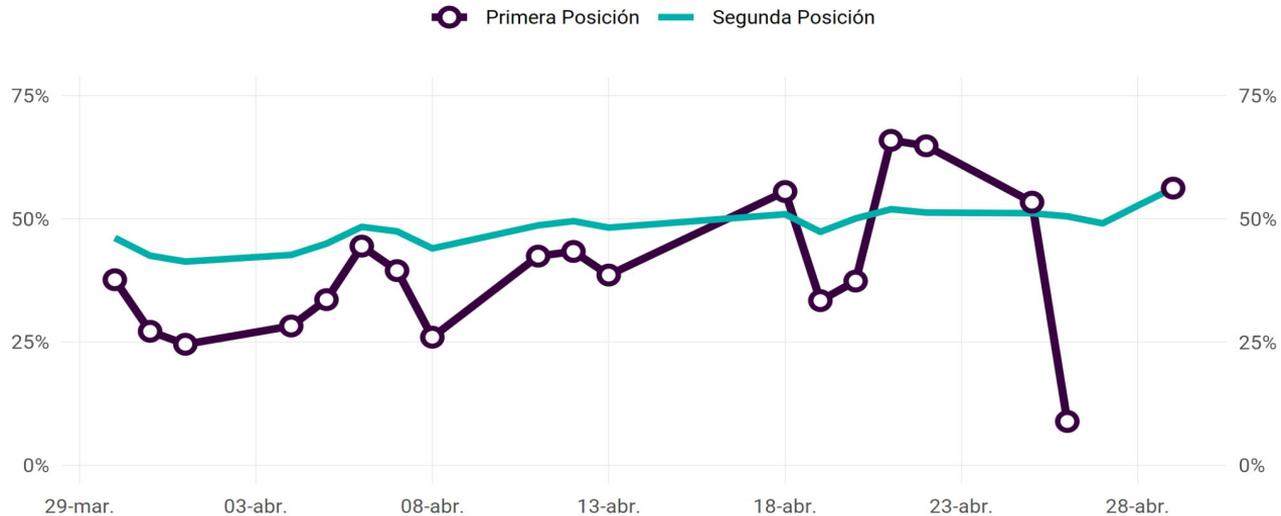


RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

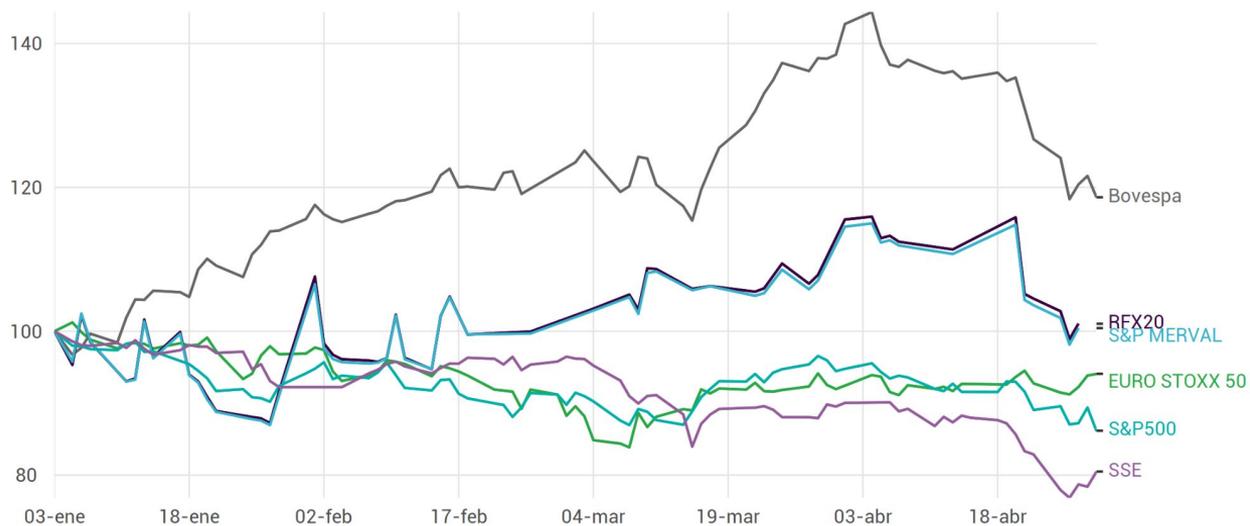
TNA en base a precios de ajuste de cada día y el cierre del spot del último mes



Fuente: Matba Rofex

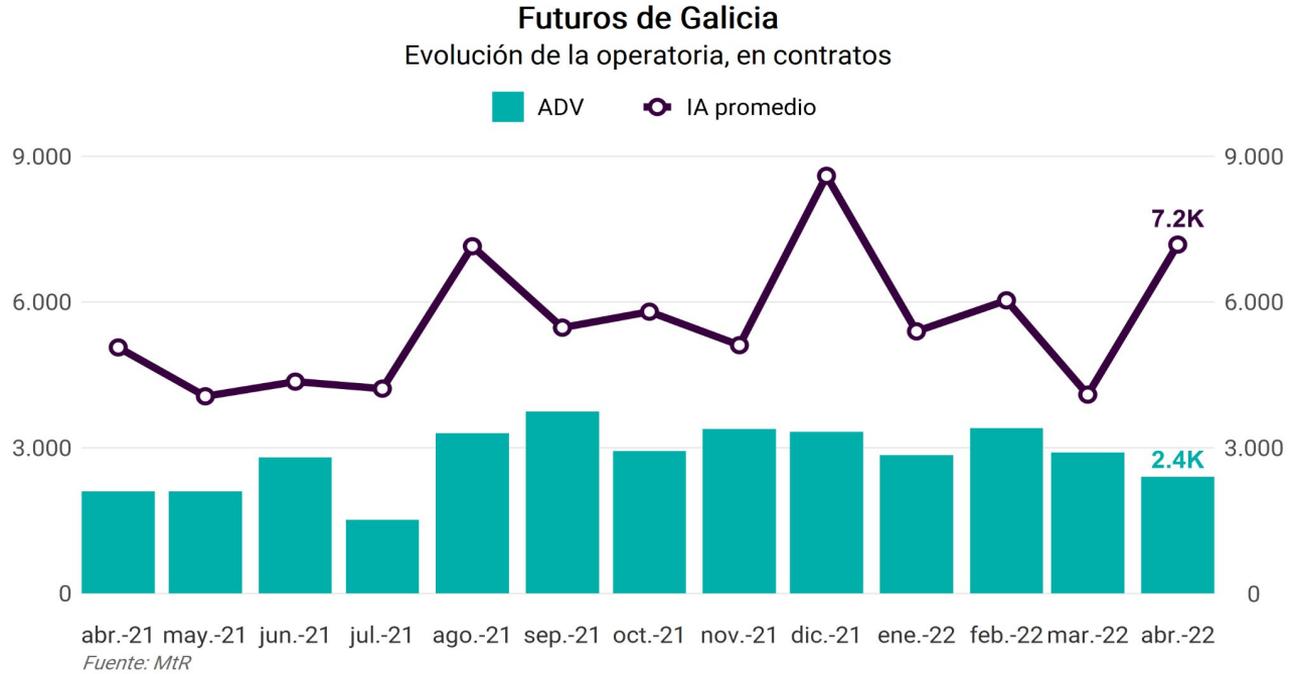
Evolución de Índices Accionarios Seleccionados

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



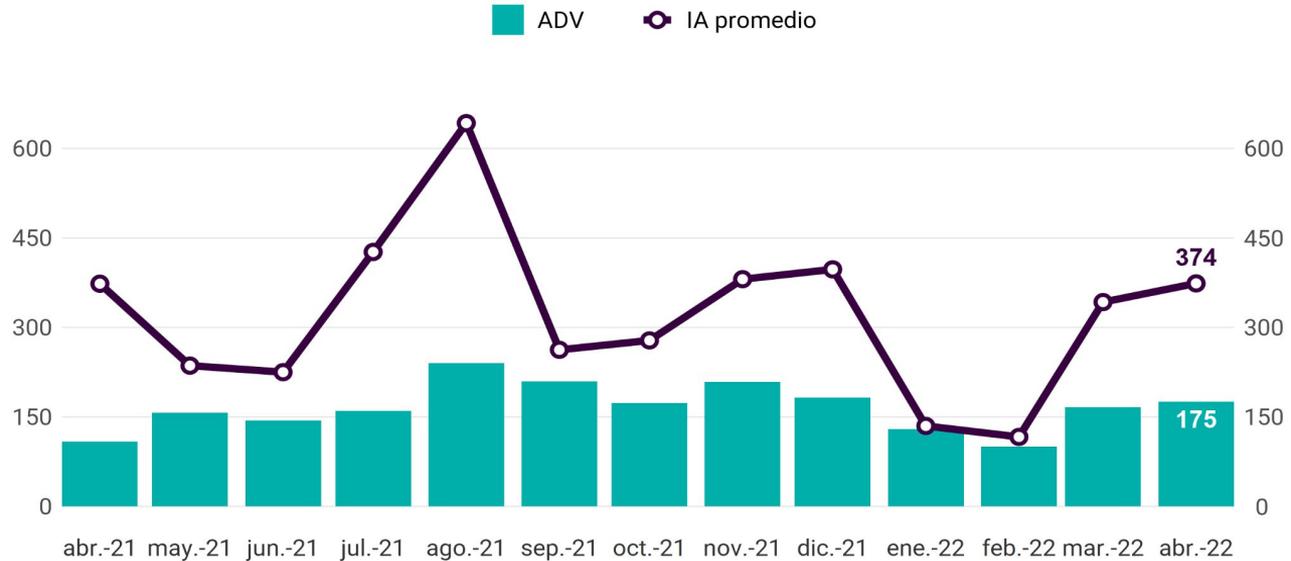
Fuente: Mtr y Reuters

*Para el RFX20 y S&P Merval se utilizó el dólar CCL.

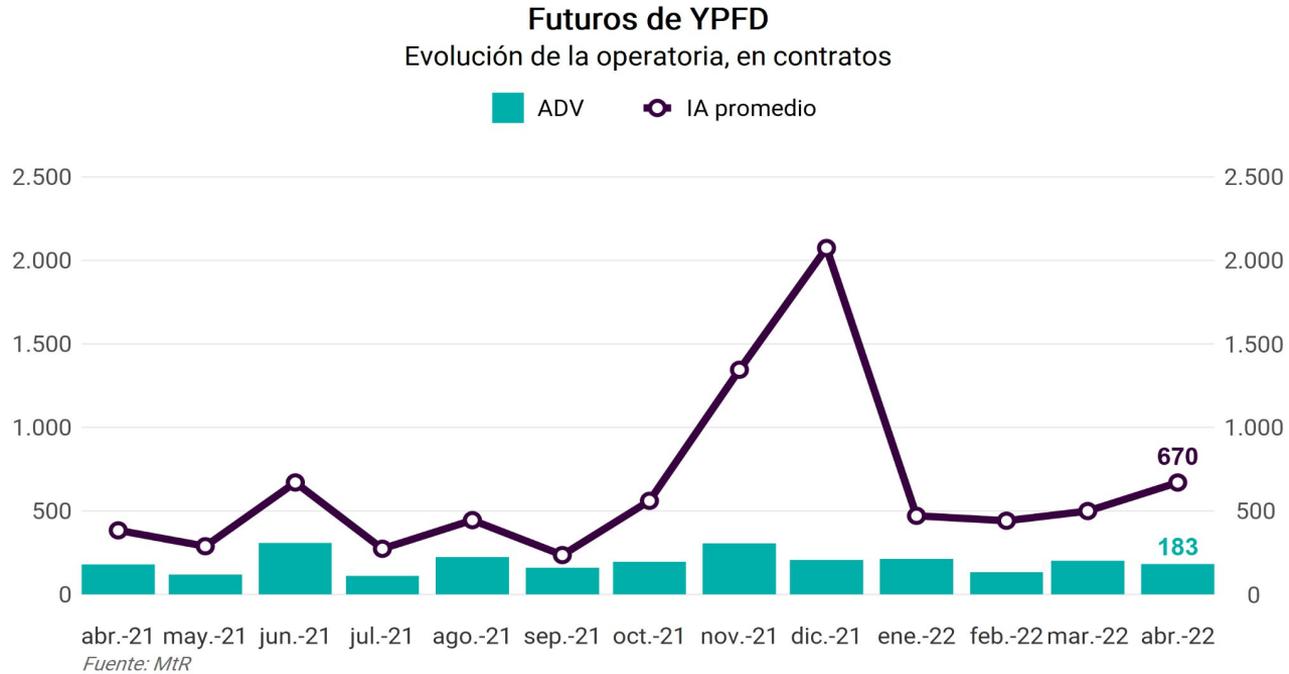


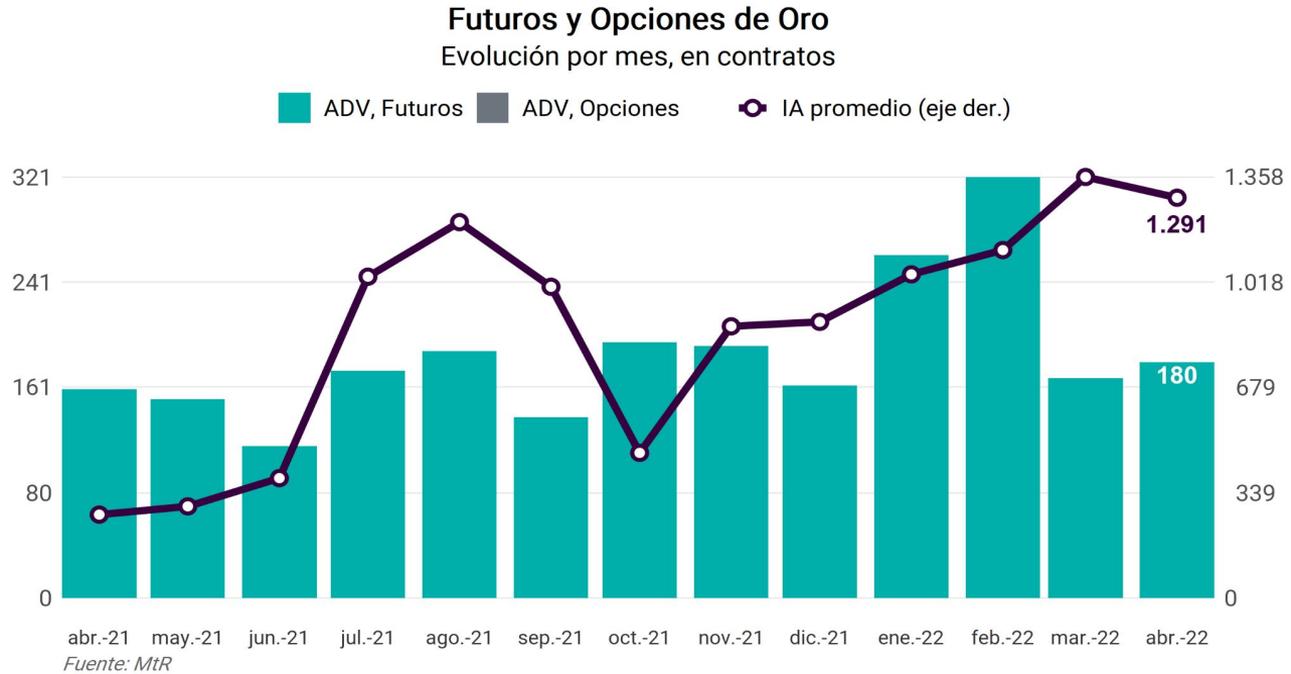
Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: MtR





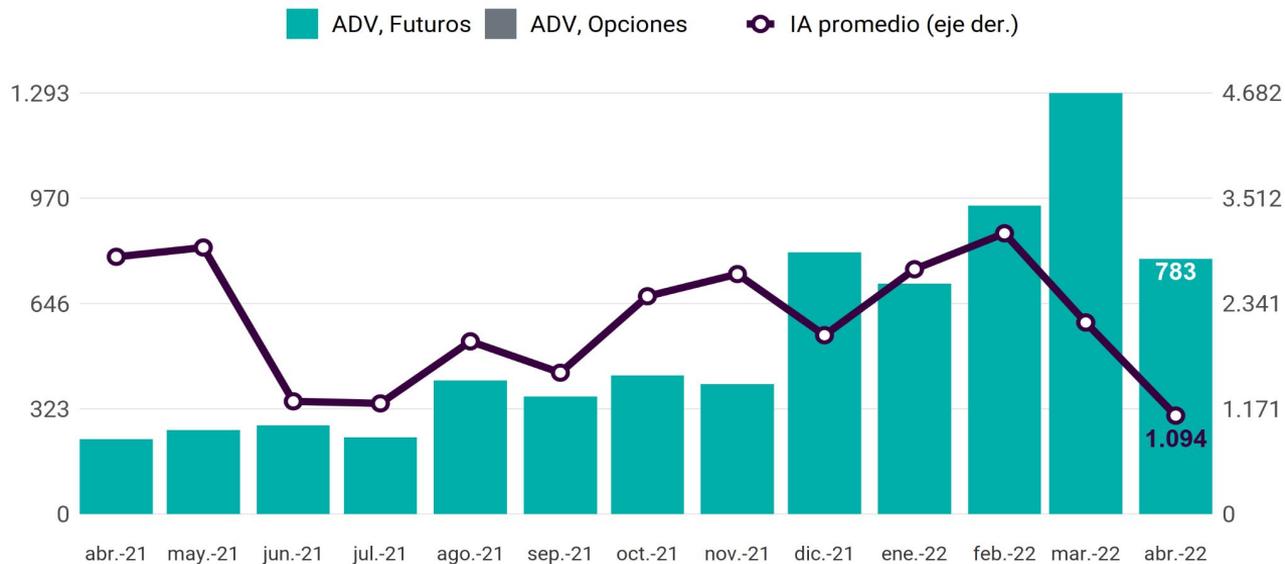
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Fuente: Mtr

Informe financiero mensual de Matba Rofex, elaborado por el área de Investigación y Desarrollo de Mercados.

investigacion@matbarofex.com.ar

Marcelo Comisso
Gerente

Camila Ajler
Analista

Jacqueline Najar
Analista

Francisco Scognamillo
Analista

Lucía Madoery
Analista