

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Agosto 2021

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en agosto 9,3 millones de contratos (+27,1% MoM y -25% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de todos los productos se ubicó en 2,5 millones de contratos, 1% superior al mes anterior.*
- ✓ *En los primeros 8 meses del 2021, el volumen operado ascendió a 68,6 millones de contratos, un 4,9% superior con respecto al mismo período del 2020*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del 2021 de todos los productos alcanzó 3 millones de contratos, un 13,2% por encima del mismo período del año anterior.*

Visión General

Agosto | 2021

MatbaRofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	8,9M	23,6%	-26,3%	2,5M	-0,6%	-48,2%
Letras del Tesoro	218,1K	0,0%	0,0%	57,7K	NA	NA
Índices Accionarios	103,1K	27,0%	-46,3%	8,1K	46,6%	-60,0%
Acciones Individuales	79,1K	111,3%	-37,8%	8,2K	67,5%	-24,0%
Energía	8,6K	73,9%	97,8%	1,9K	56,1%	-67,0%
Metales	4,3K	17,7%	-66,0%	1,2K	17,9%	-75,7%
Total	9,3M	27,1%	-25,0%	2,5M	1,0%	-47,5%

Fuente: MtR

Visión General

Acumulado | 2021

Matba Rofex

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2021	2020	Var%	2021	2020	Var%
Monedas	67,2M	62,9M	6,8%	2,9M	2,6M	13,4%
Letras del Tesoro	218,1K	0,0	NA	57,7K	0,0	NA
Índices Accionarios	689,1K	1,7M	-58,5%	6,4K	8,2K	-21,7%
Acciones Individuales	455,2K	410,9K	10,8%	5,6K	4,6K	23,3%
Energía	55,4K	331,5K	-83,3%	2,3K	4,8K	-52,7%
Metales	26,7K	111,5K	-76,1%	862,5	4,3K	-79,7%
Total	68,6M	65,4M	4,9%	3,0M	2,6M	13,2%

*En contratos, datos acumulados al 31/8 de cada año

Fuente: Mtr

Visión General

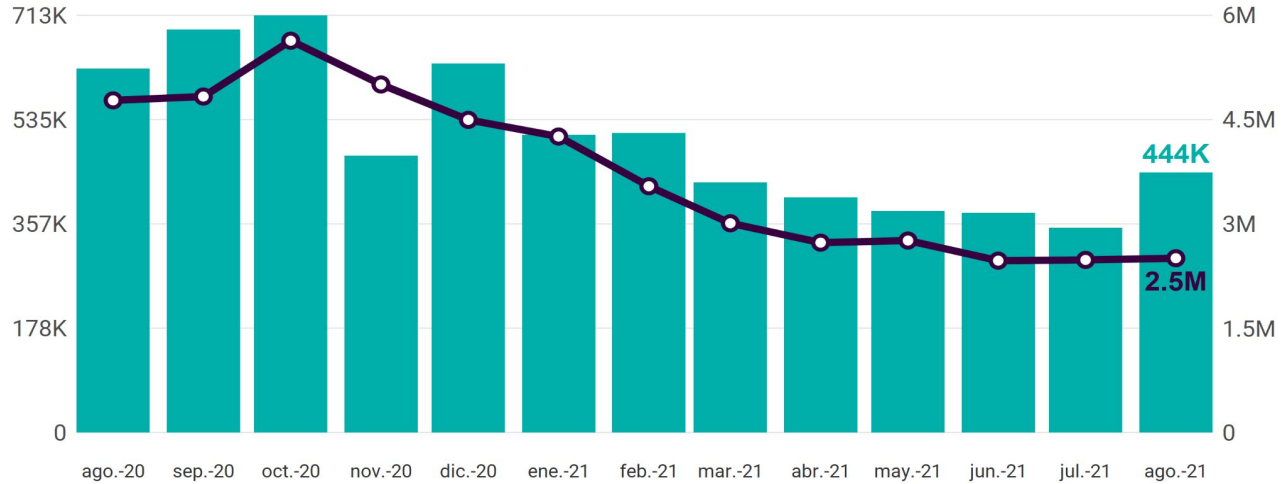
Volumen Histórico de FyO

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

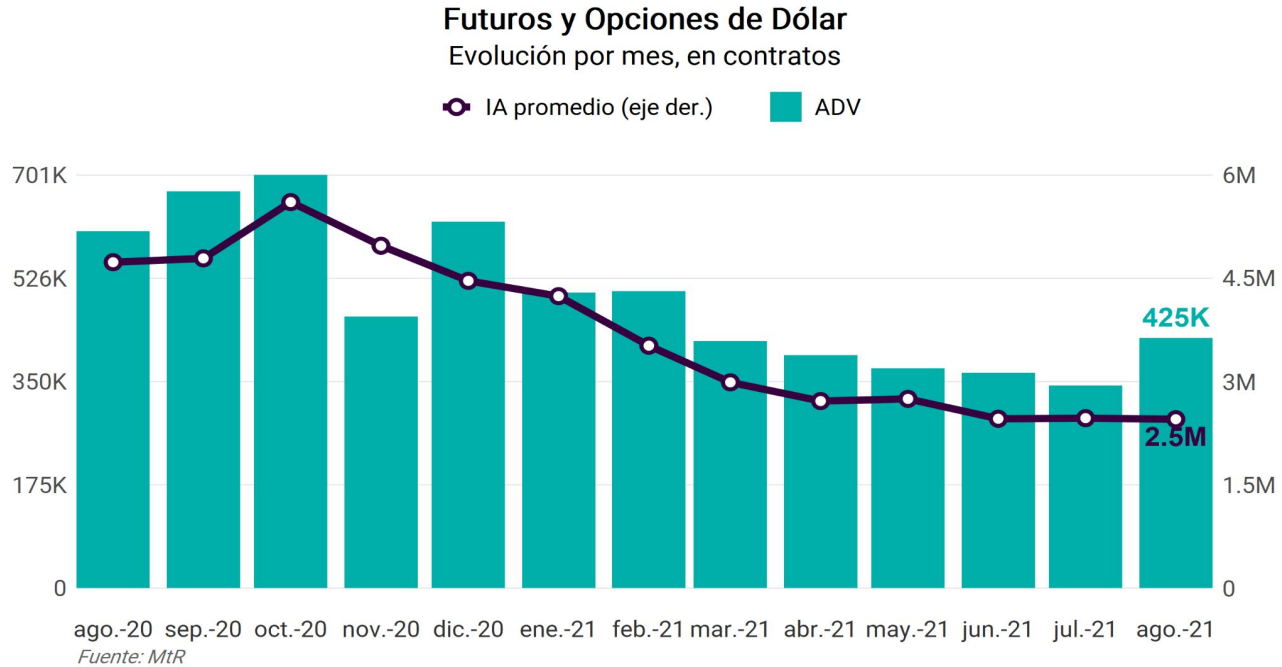
IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

Dólar: Operatoria

Futuros y Opciones



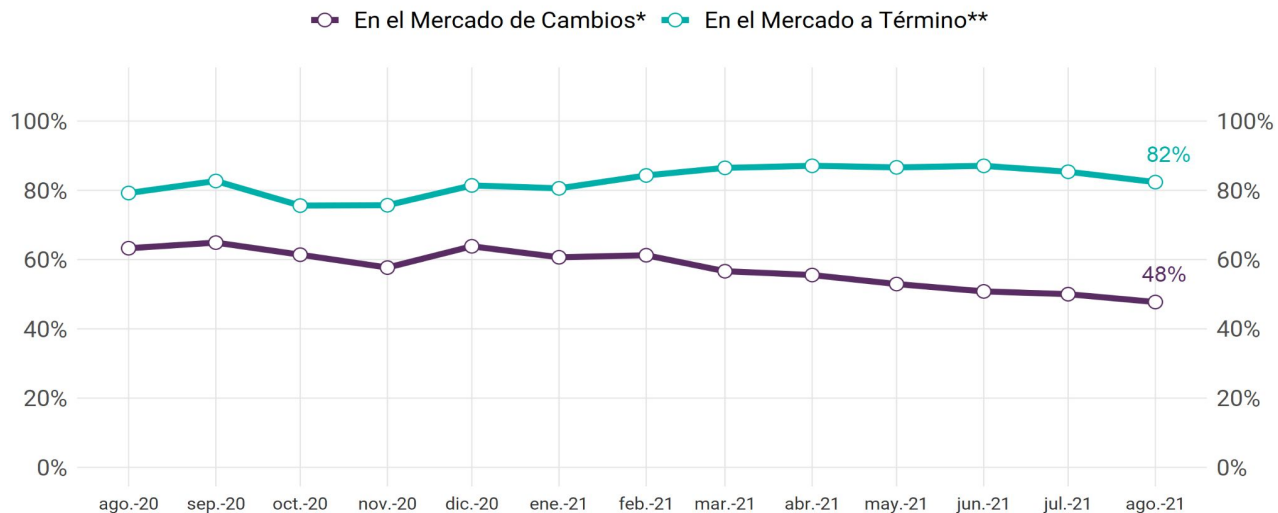
Dólar: Market Share

Mercado de Cambios

Matba Rofex

Mercado de Cambios

Market Share MtR Mensual



*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 31/08			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR082021	97,75	-1,39	-1,4% ▼	3.102.309	42% ▲	0	-100% ▼
DLR092021	99,39	-2,30	-2,3% ▼	2.254.453	200% ▲	776.510	111% ▲
DLR102021	101,56	-3,14	-3,0% ▼	1.117.416	89% ▲	483.875	29% ▲
DLR112021	104,75	-3,90	-3,6% ▼	838.558	111% ▲	459.006	14% ▲
DLR122021	109,97	-3,18	-2,8% ▼	743.262	254% ▲	268.255	52% ▲
DLR012022	116,00	-2,30	-1,9% ▼	384.303	220% ▲	99.586	36% ▲
DLR022022	120,40	-2,90	-2,4% ▼	256.314	449% ▲	87.873	92% ▲
DLR032022	125,45	-2,55	-2,0% ▼	70.756	445% ▲	29.744	217% ▲
DLR042022	129,75	-1,75	-1,3% ▼	26.920	107% ▲	21.627	233% ▲
DLR052022	134,00	-2,50	-1,8% ▼	33.411	206% ▲	6.760	22% ▲
DLR062022	137,85	-2,75	-2,0% ▼	83.578	269.506% ▲	7.779	24.994% ▲
DLR072022	142,00	-3,00	-2,1% ▼	8.745	Inf% ▲	2.633	Inf% ▲
DLR082022	145,00	N/C	N/C	0	N/C	0	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	-2,64	-2,2% ▼	8.920.025	24% ▲	2.243.648	-0% ▼

Fuente: Mtr

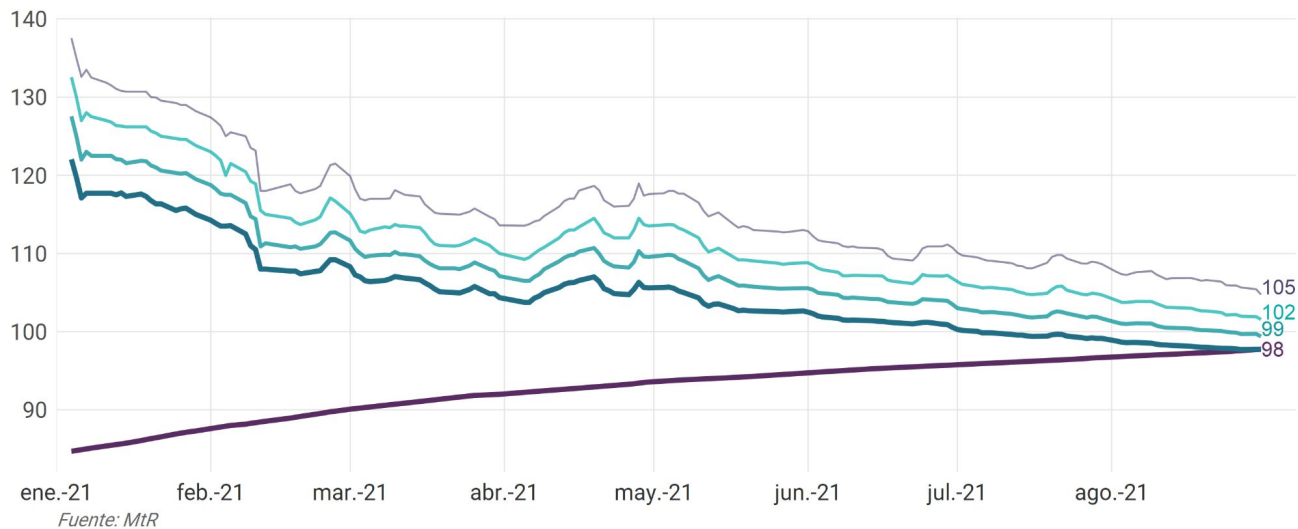
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

AR\$/US\$, últimos 6 meses del spot y primeras cuatro posiciones

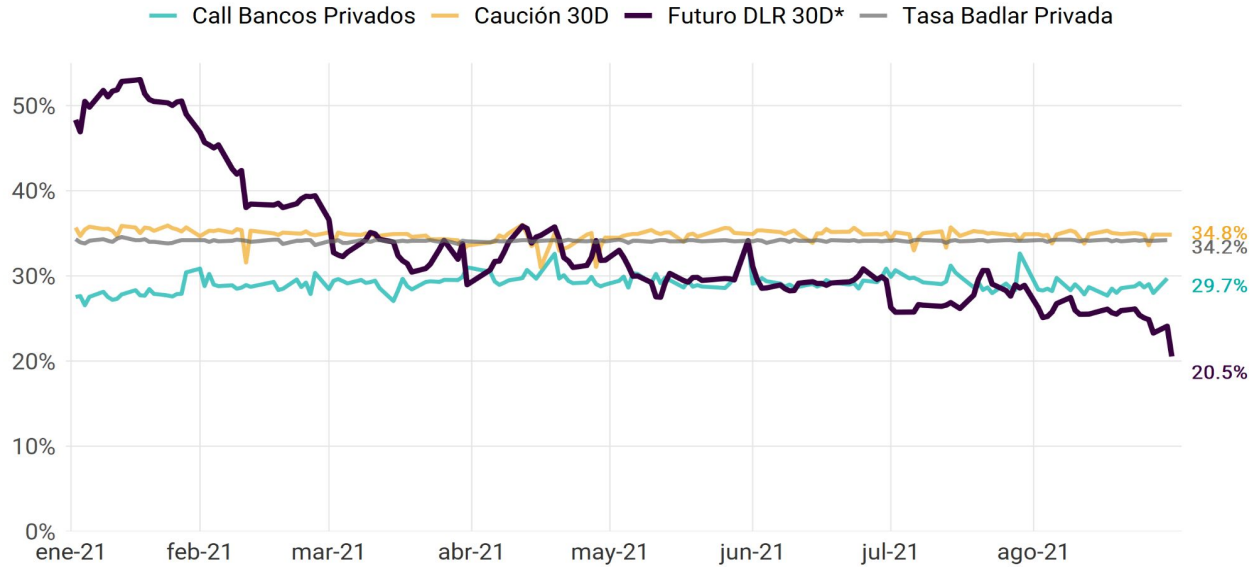
— Spot — DLR082021 — DLR092021 — DLR102021 — DLR112021



Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Evolución de Tasas Seleccionadas (TNA)



*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días
Fuente: MtR y Reuters

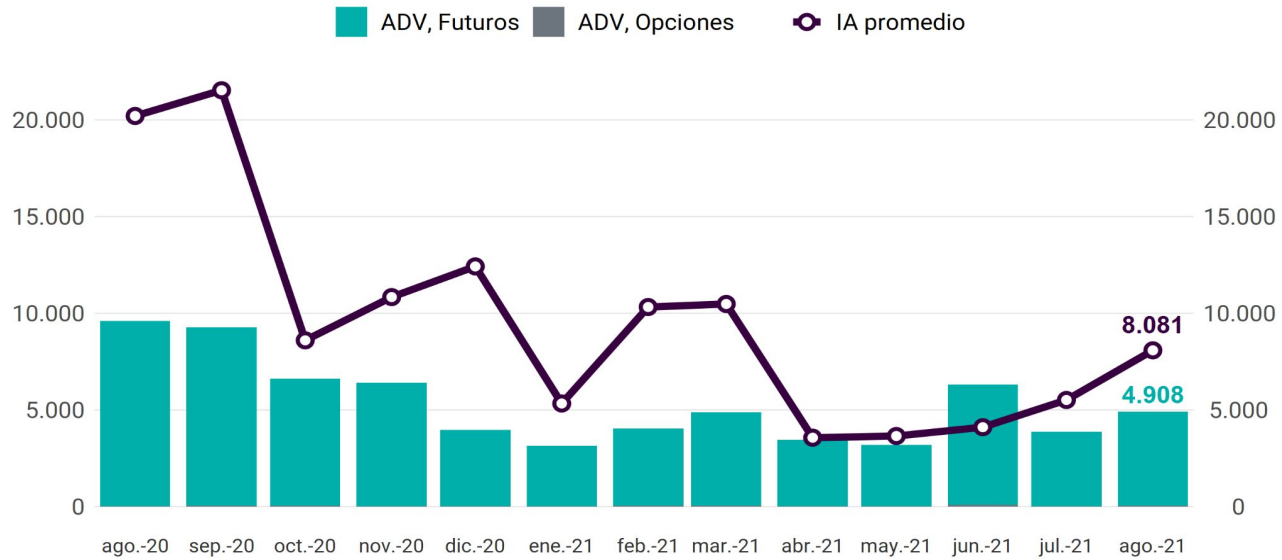
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

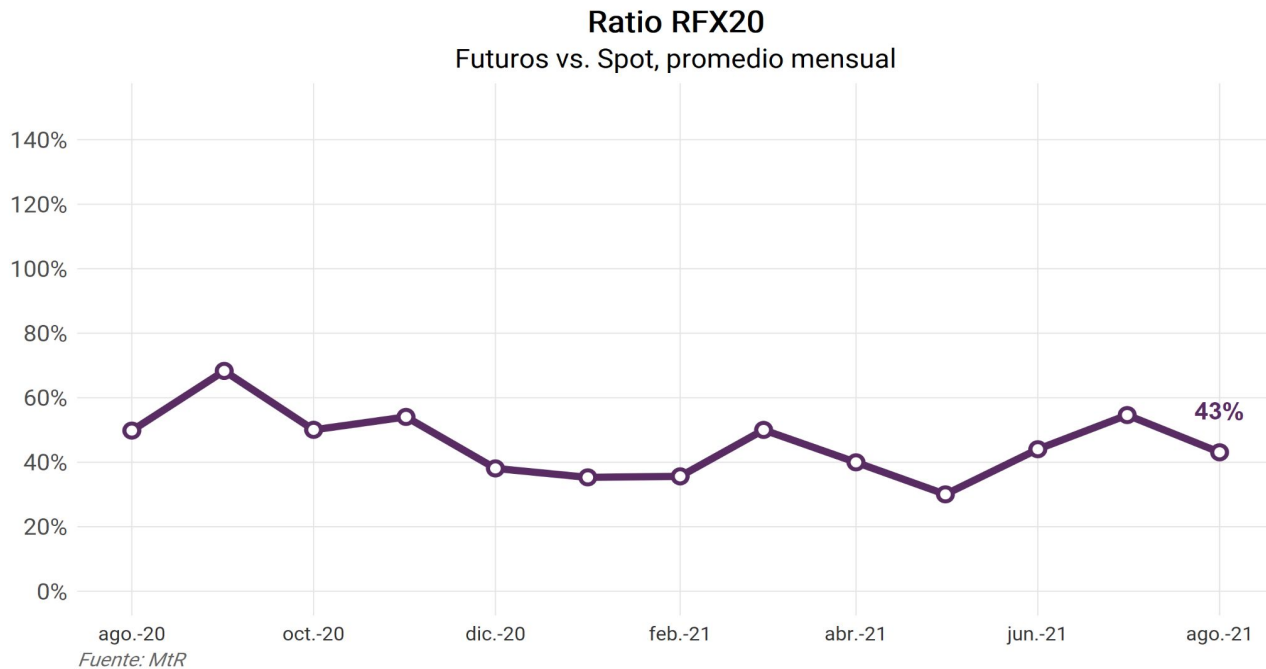


Fuente: MtR

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



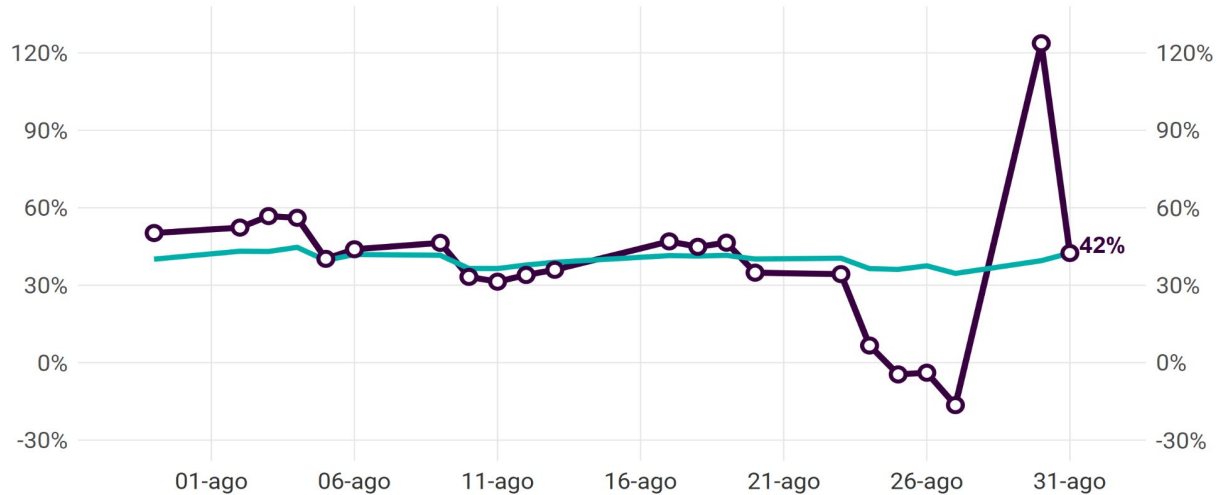
RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

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

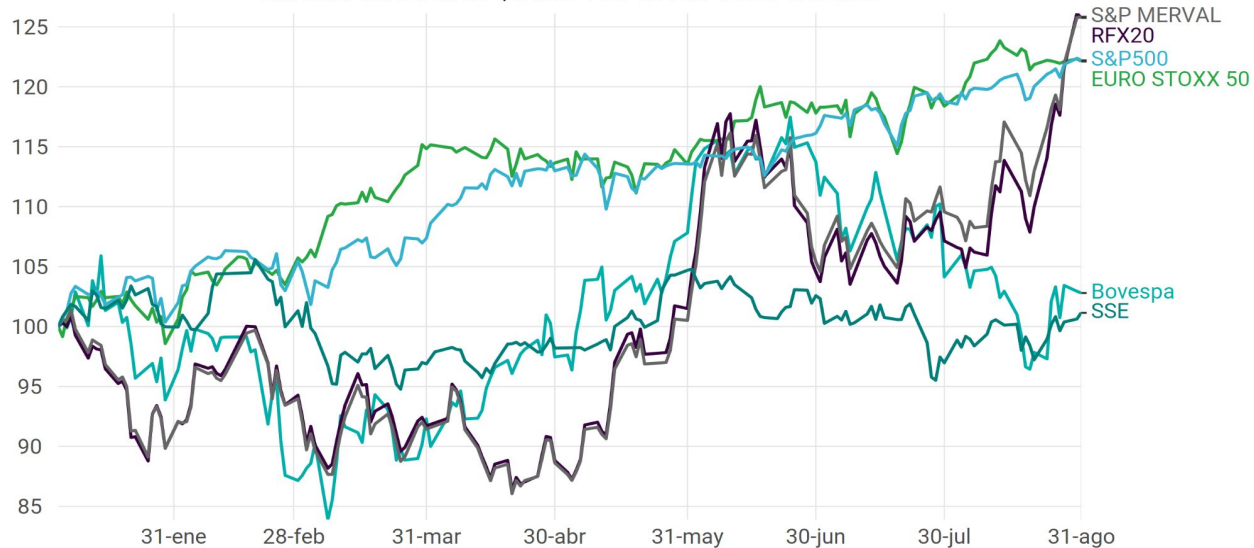
○ Primera Posición — Segunda Posición



Fuente: MtR

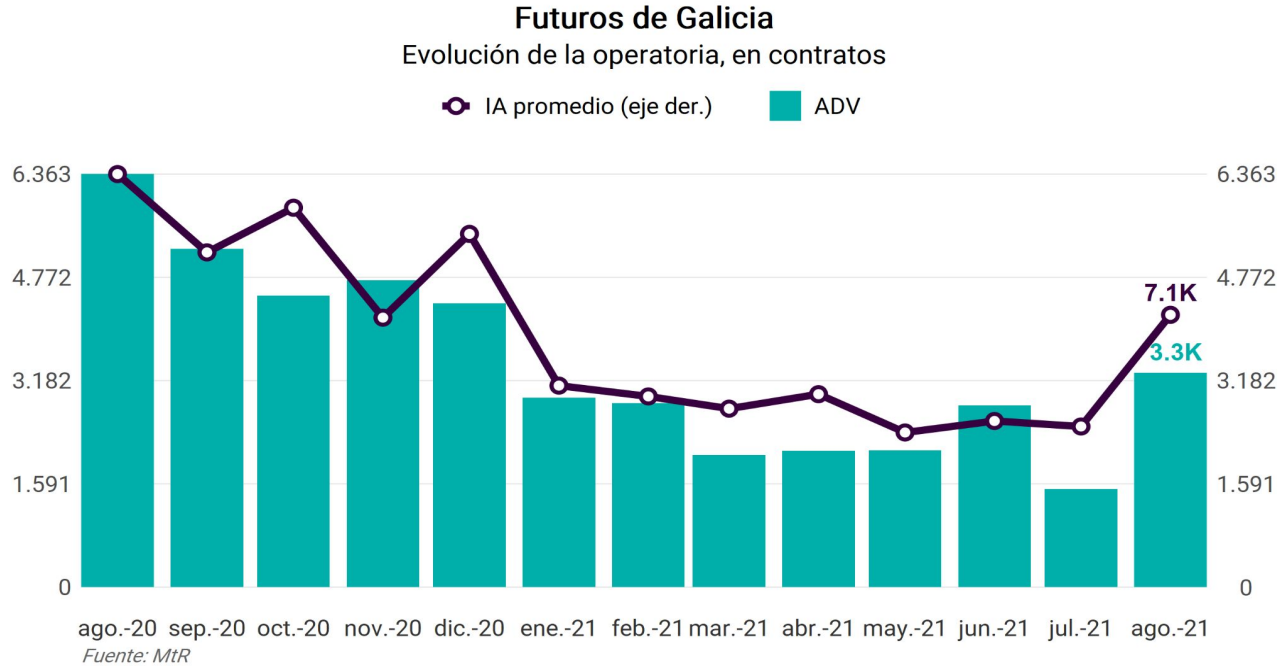
Principales Índices Accionarios Mundiales

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



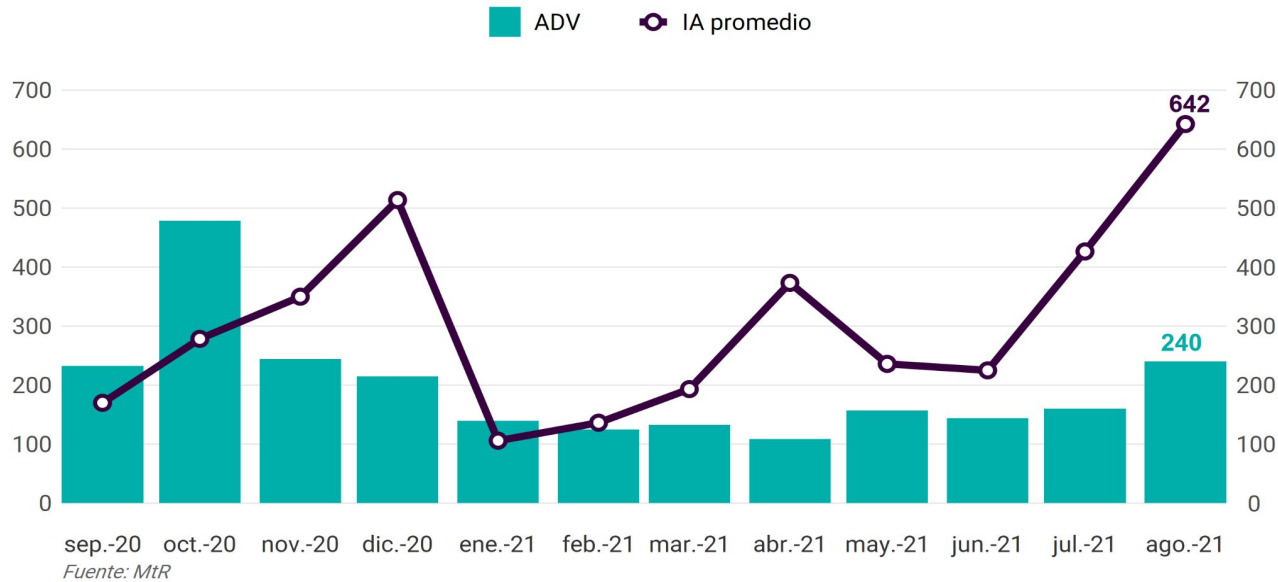
Fuente: MTR y Reuters

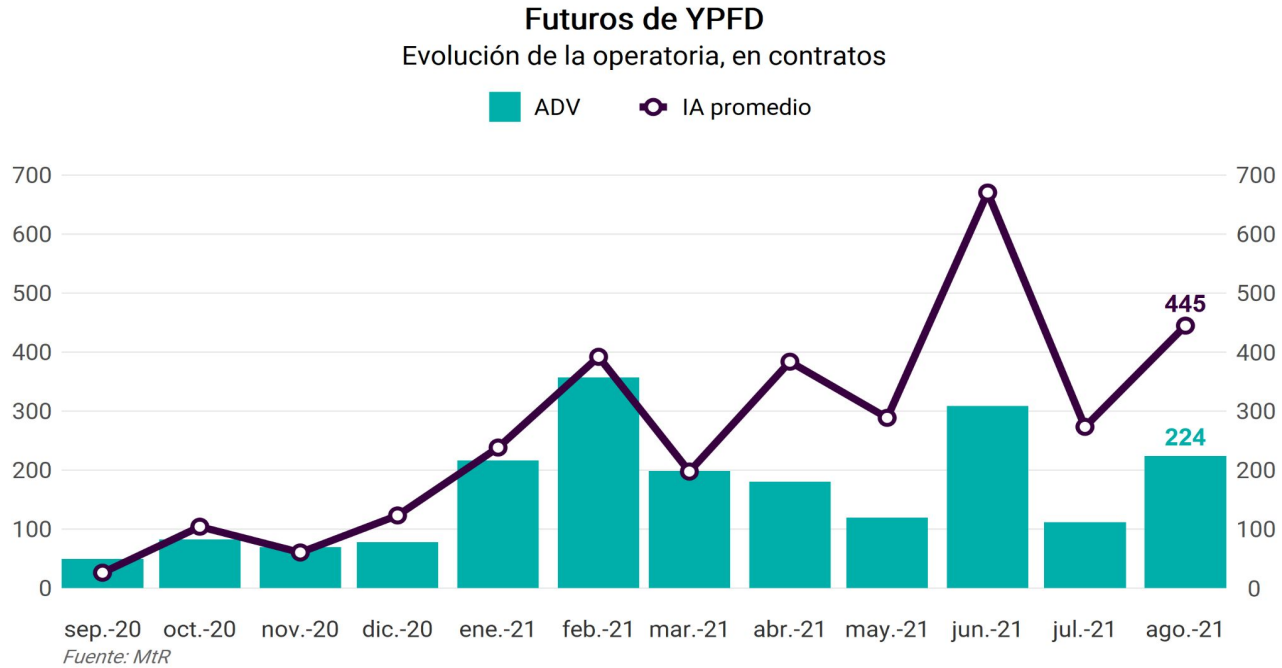
*Para el RFX20 y S&P Merval se utilizó el dólar CCL y variaciones porcentuales contra el 4/1/2021



Futuros de Pampa Energía

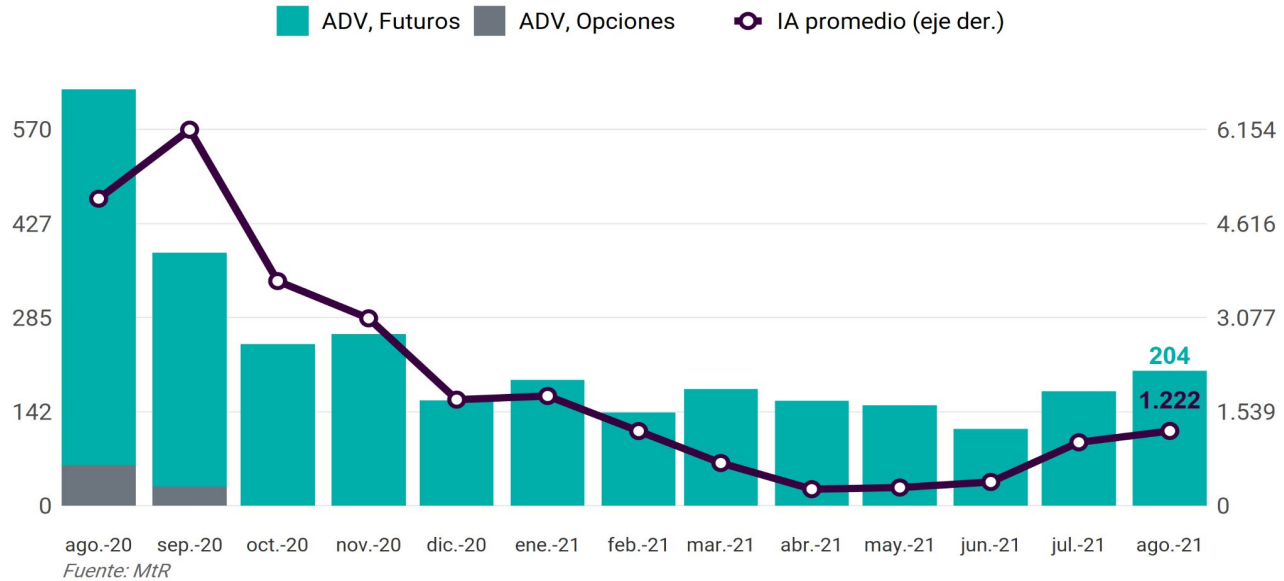
Evolución de la operatoria, en contratos





Futuros y Opciones de Oro

Evolución por mes, en contratos



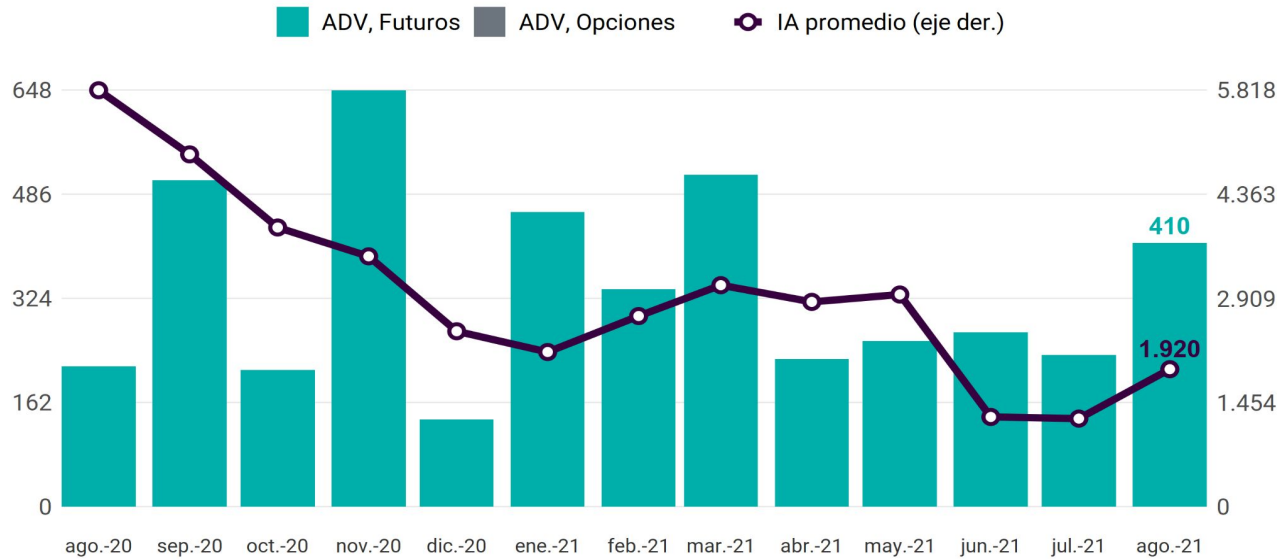
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

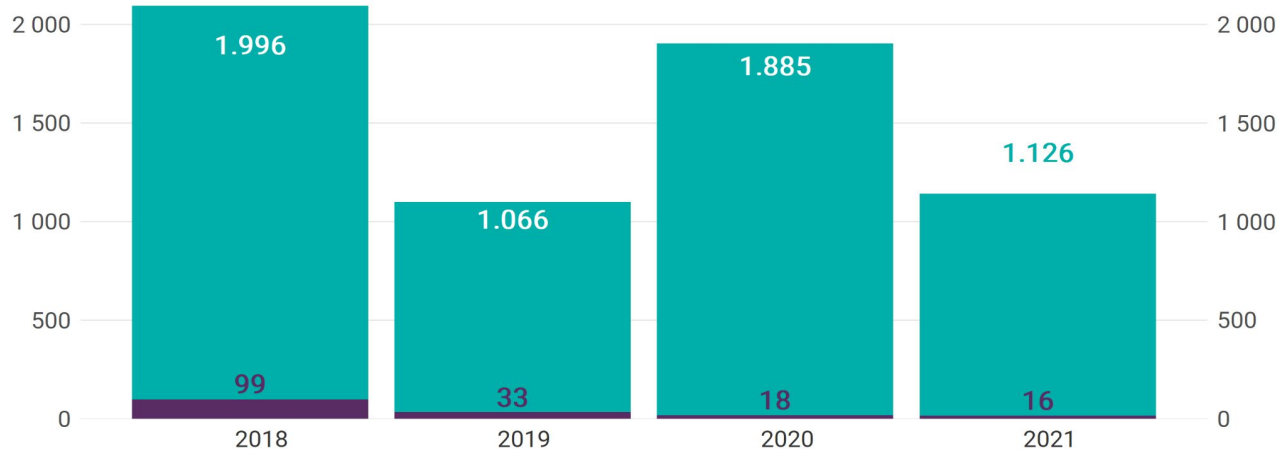
Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Volumen acumulado anual UFEX
Datos hasta agosto 2021, en contratos

■ Dolar ■ Novillo



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

Valentín Bruzzoni
Analista

Jacqueline Najjar
Analista