

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Junio 2022

Highlights del mes

MatbaRofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en junio 22,8 millones de contratos (-3,6% MoM). En términos interanuales, este volumen fue un 188,5% superior al mismo mes de 2021.*
- ✓ *La operatoria de futuros y opciones de dólar alcanzó en el sexto mes del año 15,8 millones de contratos, un 16,7% superior a mayo y un 105,1% por encima de junio de 2021.*
- ✓ *En términos nocionales, el volumen agregado del mes fue de 16.990 millones de dólares (+16,4% MoM y +105,6% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del mes para todos los productos se ubicó en 6,2 millones de contratos (-14,4% MoM y +150% YoY).*
- ✓ *En los primeros seis meses del año y excluyendo la operatoria de futuros de LEDES, el volumen operado acumuló 73,7 millones de contratos (41,9% por encima del mismo período del año anterior), mientras que el interés abierto promedio diario alcanzó 4,2 millones de contratos (+34,7% vs. los primeros seis meses del 2021).*

Visión General

Junio | 2022: Volumen en Contratos

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	15,8M	16,7%	105,1%	4,2M	5,6%	69,8%
Letras del Tesoro	6,9M	-31,0%	N/C	2,0M	-38,8%	N/C
Acciones Individuales	45,3K	3,2%	-33,7%	6,9K	22,6%	31,5%
Índices Accionarios	33,2K	-5,1%	-75,0%	1,7K	7,3%	-59,4%
Energía	21,3K	40,4%	274,7%	1,2K	40,0%	-1,7%
Metales	4,6K	-8,6%	88,1%	1,6K	-8,4%	318,0%
Total	22,8M	-3,6%	188,5%	6,2M	-14,4%	150,0%

Fuente: MtR

Visión General

Junio | 2022: Volumen Nocional

Matba Rofex

	Volumen Nocional en USD			IA Prom. Diario Nocional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	16.859,3M	16,8%	107,7%	4.456,0M	5,6%	69,0%
Letras del Tesoro	54,6M	-33,8%	N/C	15,8M	-41,2%	Inf%
Índices Accionarios	32,0M	-13,5%	-74,0%	1,6M	-3,5%	-55,3%
Energía	23,9M	45,9%	498,1%	1,4M	46,8%	59,4%
Acciones Individuales	12,1M	26,3%	-25,8%	1,7M	31,5%	22,5%
Metales	8,4M	-9,4%	85,9%	3,0M	-9,1%	322,1%
Total	16.990,3M	16,4%	105,6%	4.479,5M	5,3%	69,5%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2022: Volumen en Contratos

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2022	2021	Var%	2022	2021	Var%
Monedas	73,0M	51,0M	43,0%	4,2M	3,1M	35,0%
Letras del Tesoro	41,9M	0,0	N/C	3,2M	0,0	N/C
Acciones Individuales	346,4K	338,6K	2,3%	6,4K	5,3K	19,5%
Índices Accionarios	226,2K	504,8K	-55,2%	2,6K	6,2K	-58,5%
Energía	111,4K	41,8K	166,7%	1,9K	2,5K	-25,0%
Metales	28,1K	18,7K	50,2%	1,4K	769,1	77,6%
Subtotal (sin LEDES)	73,7M	51,9M	41,9%	4,2M	3,1M	34,7%
Total	115,6M	51,9M	122,6%	7,4M	3,1M	137,7%

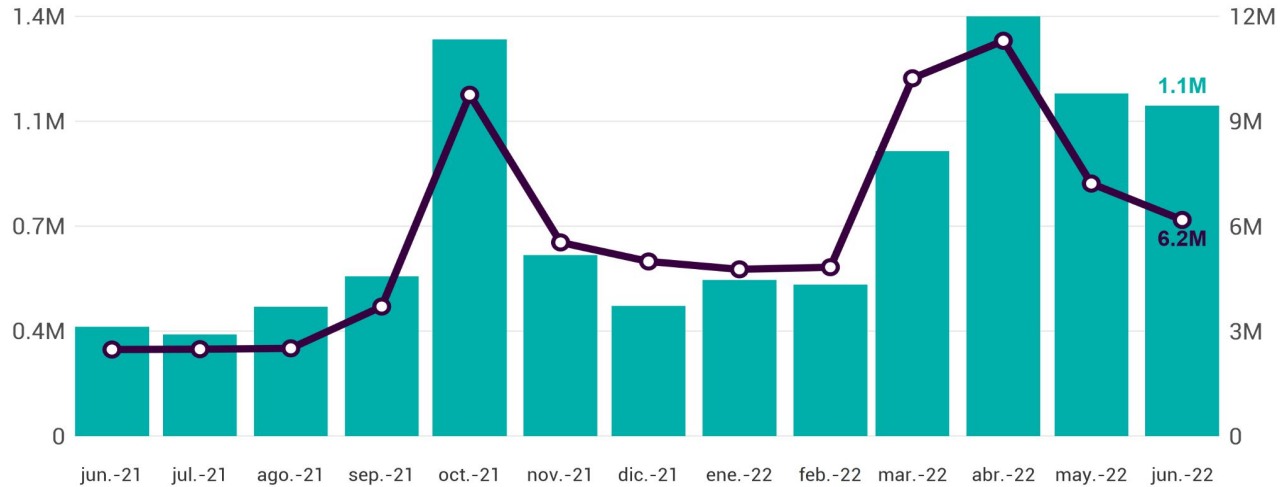
*En contratos, datos acumulados al 30/06 de cada año

Fuente: MtR

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

IA promedio (eje der.) ADV

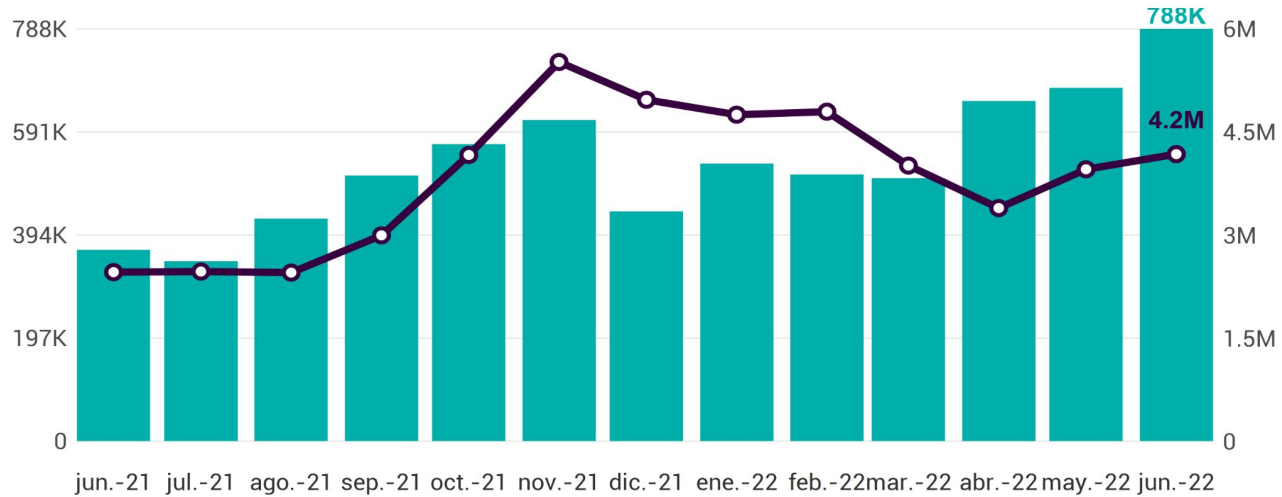


Fuente: MTR

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

○ IA promedio (eje der.) ■ ADV



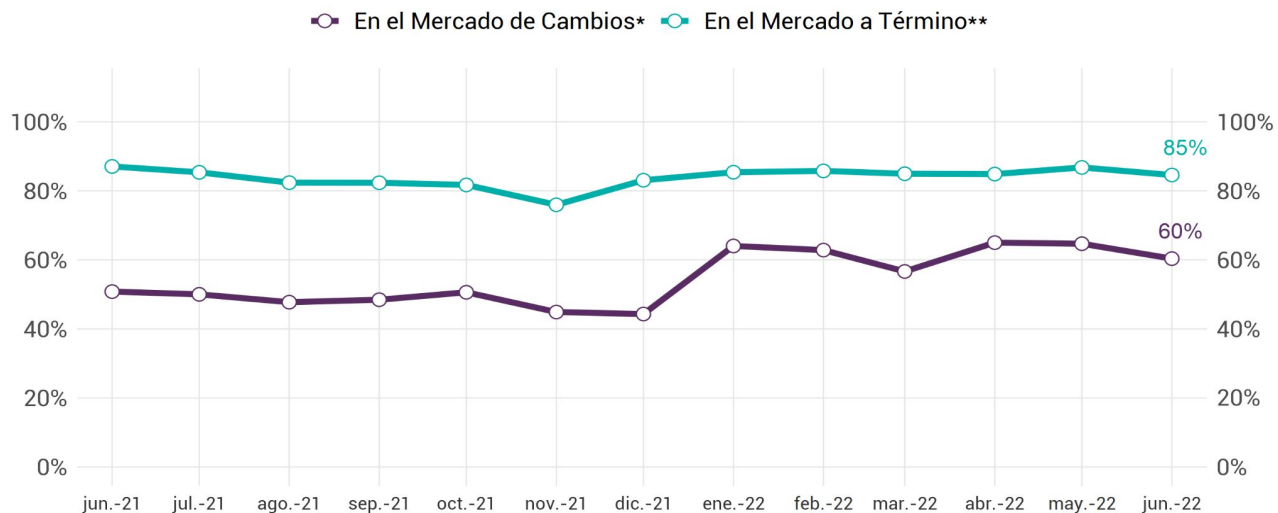
Fuente: MtR

Dólar: Market Share

Mercado de Cambios

Matba Rofex

Mercado de Cambios Market Share MtR Mensual



*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

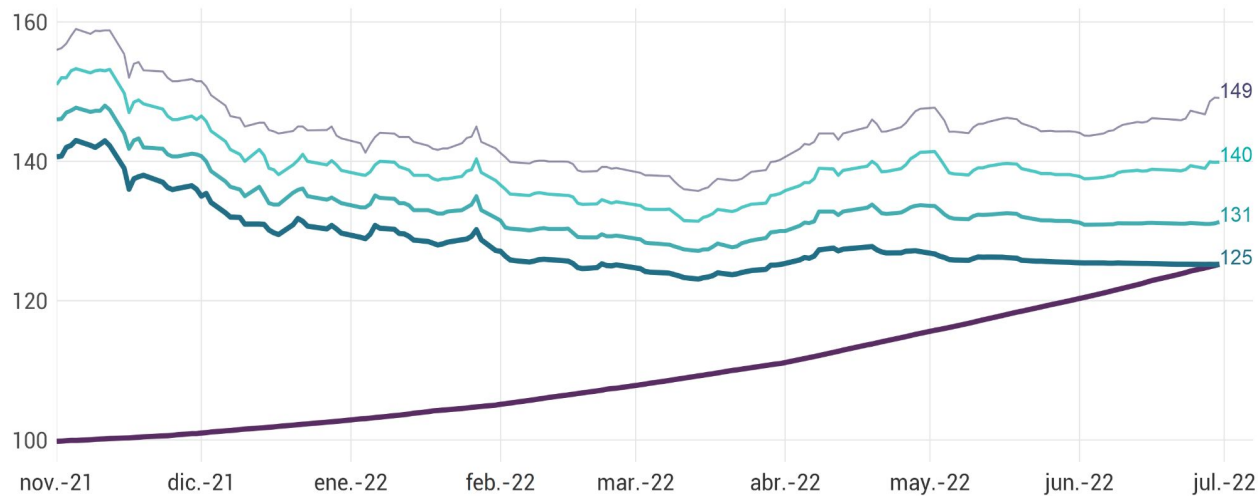
Posición	Precio de Ajuste al 30/06			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR062022	125,22	-0,30	-0,2% ▼	5.886.676	129% ▲	0	-100% ▼
DLR072022	131,30	-0,14	-0,1% ▼	6.801.570	419% ▲	3.190.732	544% ▲
DLR082022	139,90	1,80	1,3% ▲	1.343.398	73% ▲	543.436	288% ▲
DLR092022	149,10	4,79	3,3% ▲	774.801	94% ▲	225.221	132% ▲
DLR102022	158,20	7,49	5,0% ▲	341.015	45% ▲	102.314	38% ▲
DLR112022	167,00	9,94	6,3% ▲	416.933	281% ▲	153.300	53% ▲
DLR122022	175,25	11,67	7,1% ▲	120.558	59% ▲	42.733	34% ▲
DLR012023	184,50	13,80	8,1% ▲	35.775	-26% ▼	29.509	3% ▲
DLR022023	192,00	15,25	8,6% ▲	11.122	-20% ▼	22.446	50% ▲
DLR032023	200,50	17,85	9,8% ▲	8.060	-57% ▼	9.999	31% ▲
DLR042023	207,50	19,45	10,3% ▲	2.423	-8% ▼	4.852	103% ▲
DLR052023	215,50	N/C	N/C	6.578	N/C	3.147	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	9,24	5,4% ▲	15.748.909	29% ▲	4.327.689	-2% ▼

Fuente: MtR

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR062022 DLR072022 DLR082022 DLR092022

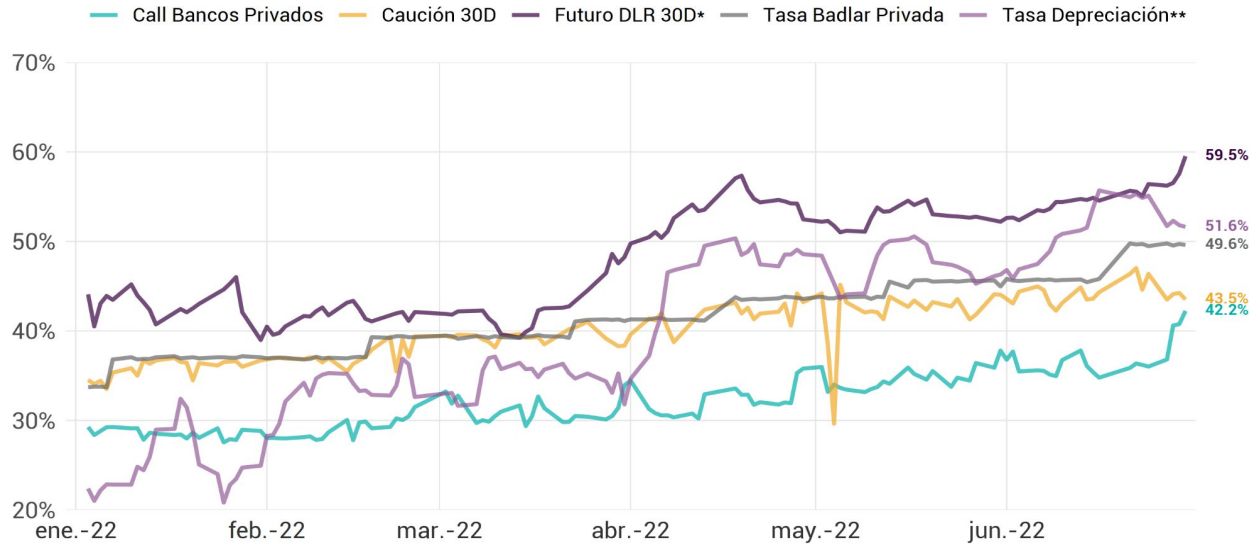


Fuente: MTR

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 periodos

Fuente: MtR y Reuters

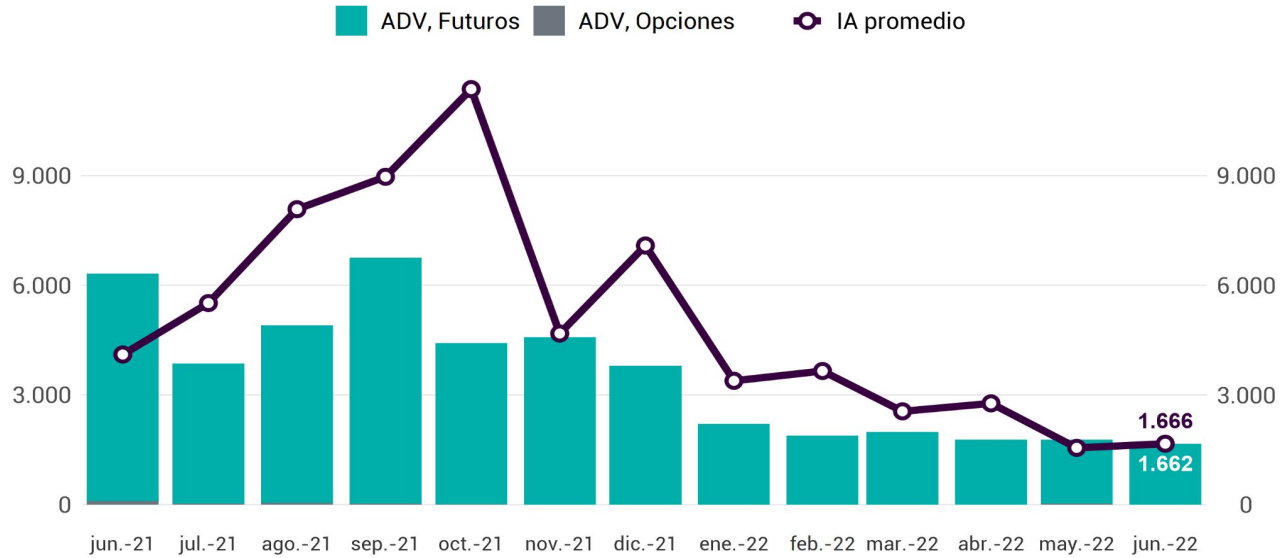
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

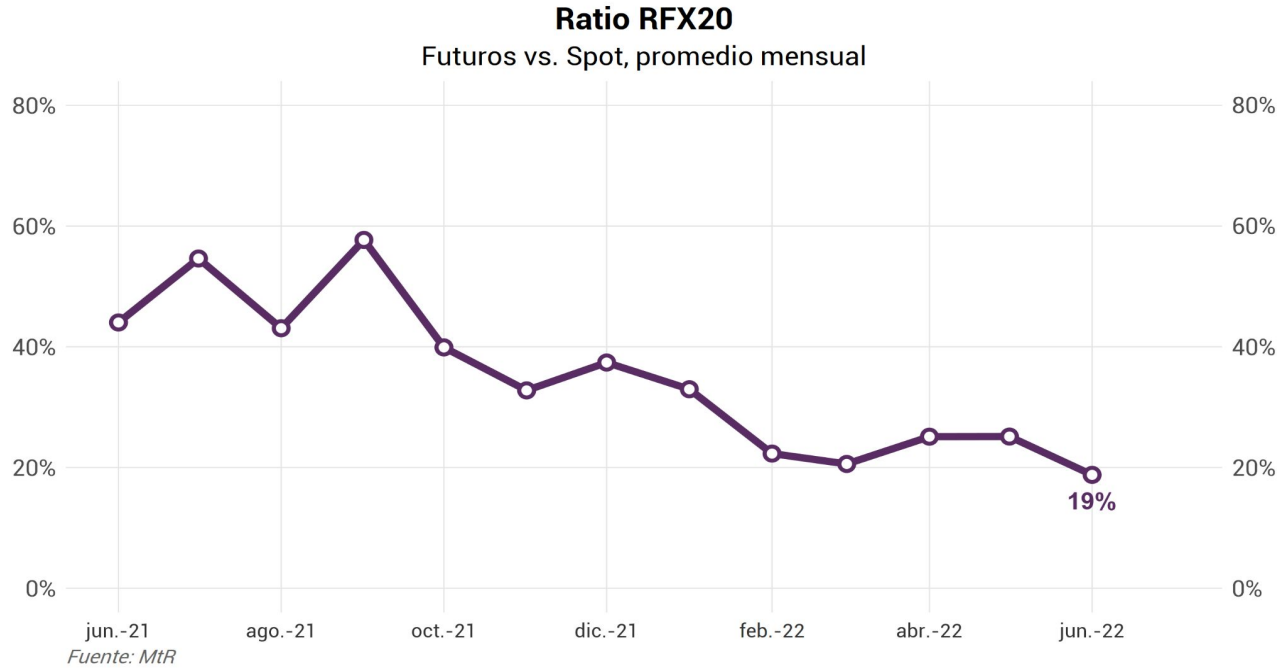


Fuente: Mtr

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex

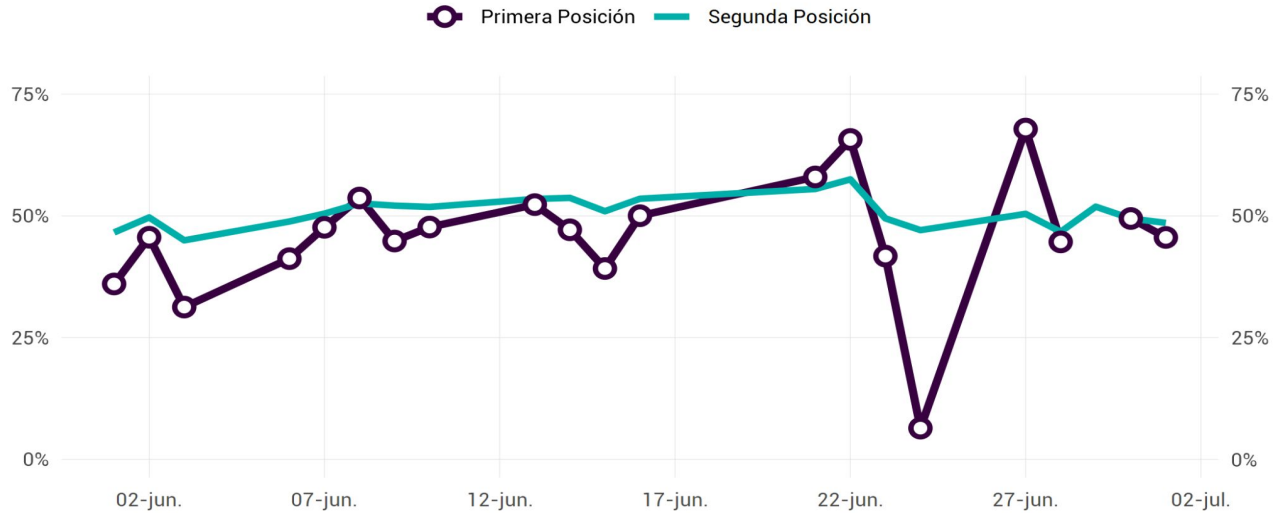


RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

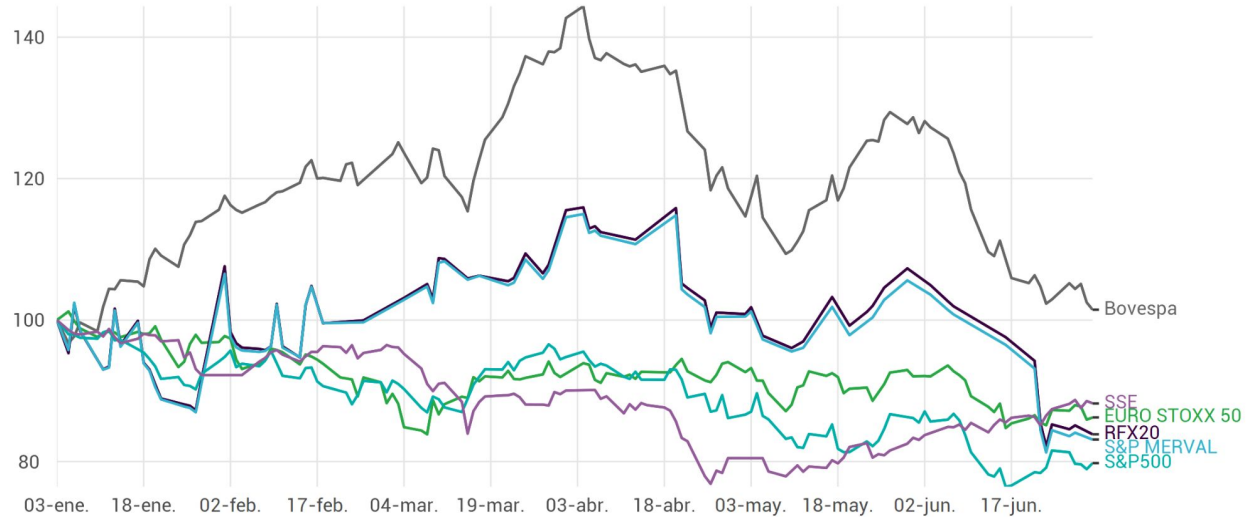
TNA en base a precios de ajuste de cada día y el cierre del spot del último mes



Fuente: Matba Rofex

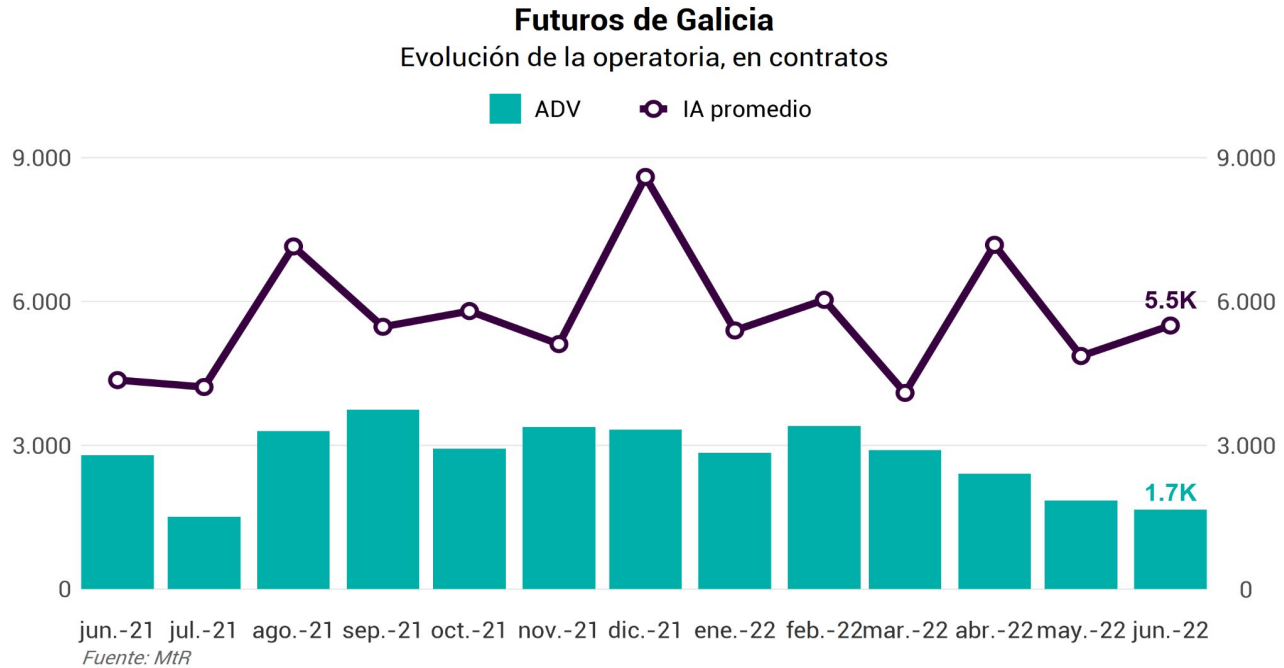
Evolución de Índices Accionarios Seleccionados

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



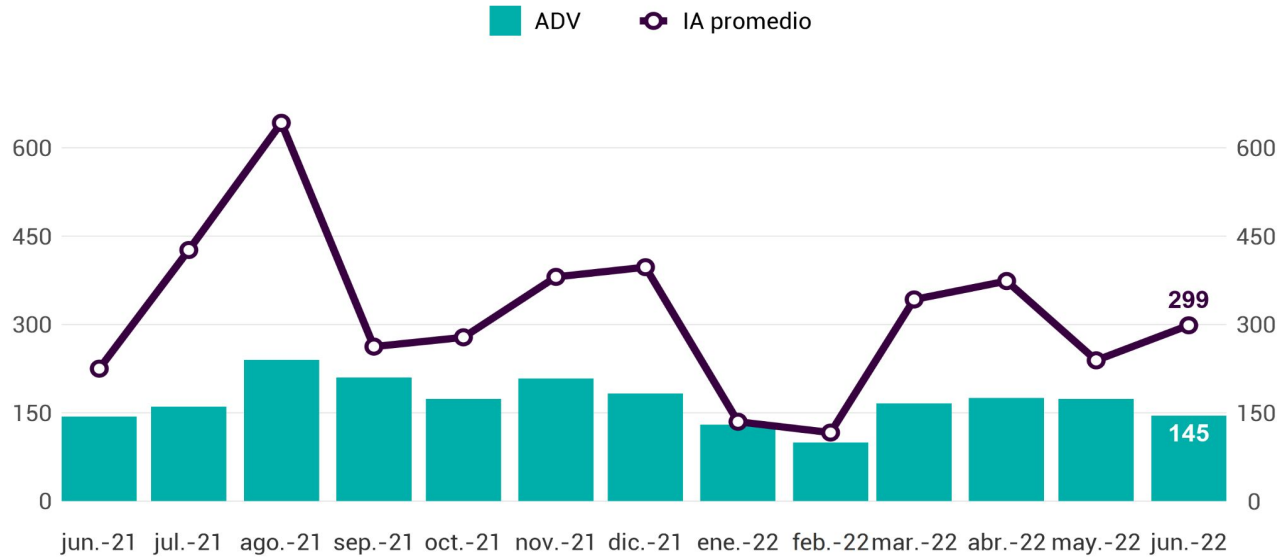
Fuente: Mtr y Reuters

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

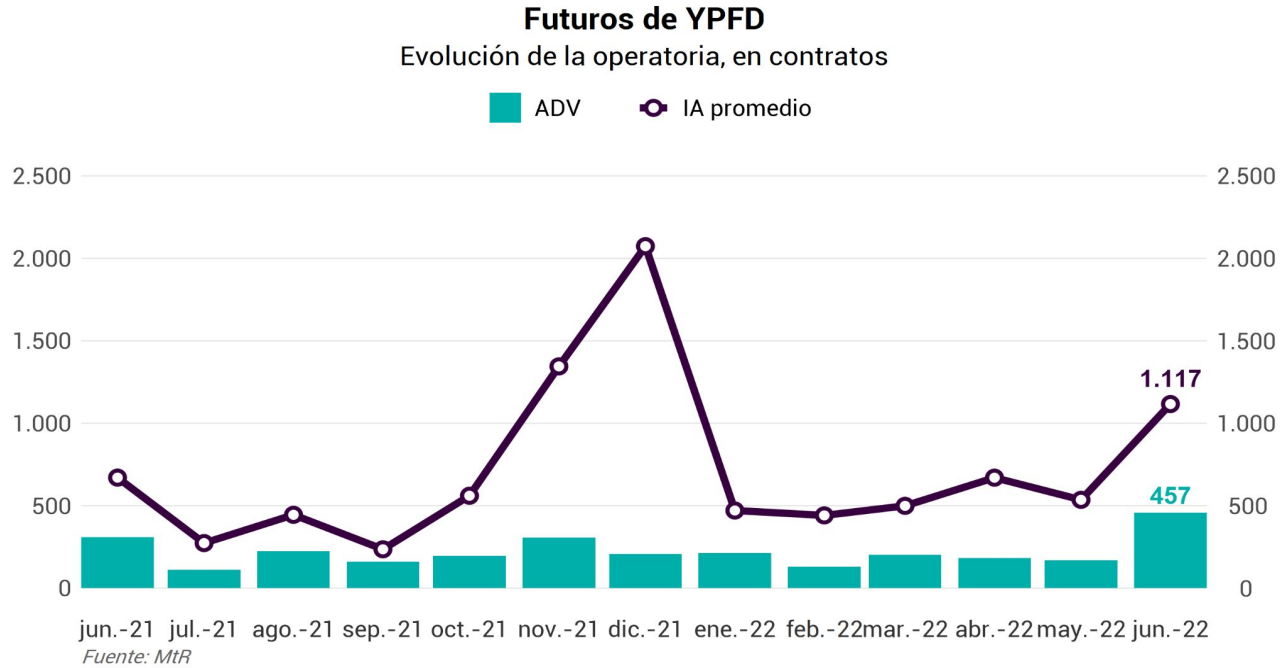


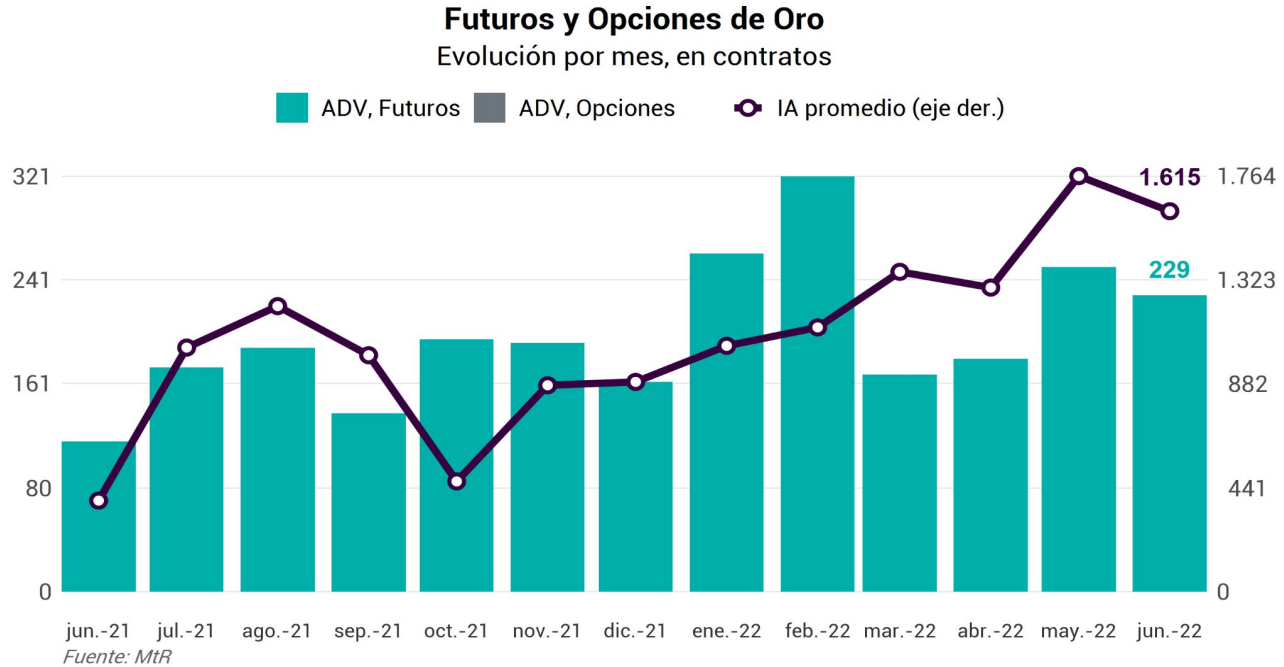
Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: MtR





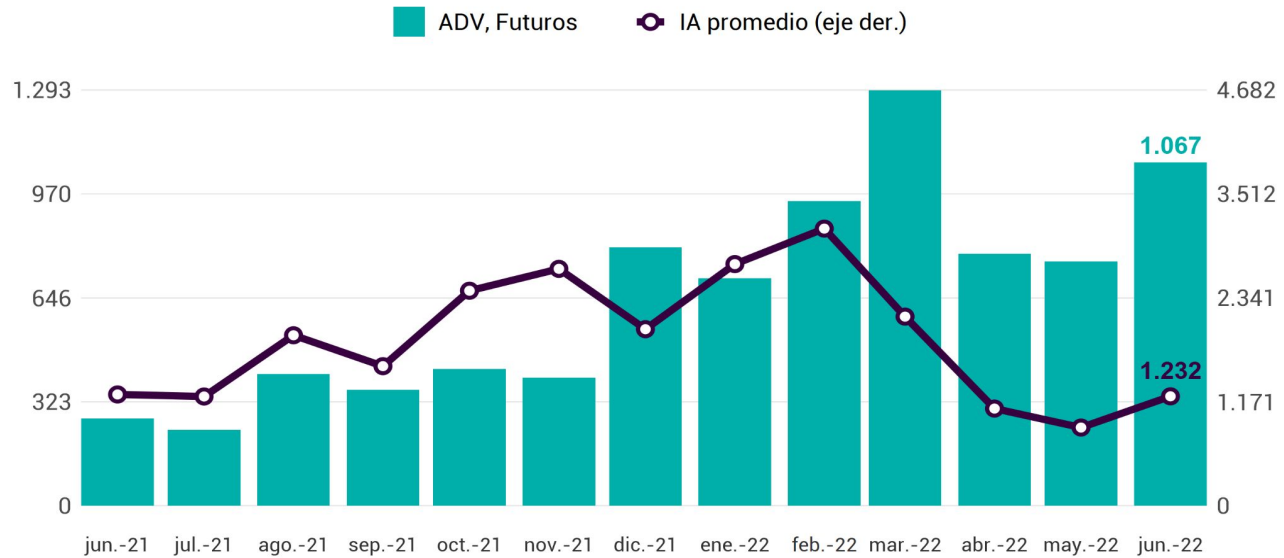
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros 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 Najjar
Analista

Francisco Scognamillo
Analista

Lucía Madoery
Analista