

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Junio 2023

Highlights del mes

MatbaRofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros excluyendo los futuros sobre Letras del Tesoro alcanzó en junio 16,9 millones de contratos (8,1% MoM) y un 6,6% superior a junio de 2022.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de junio 2023, excluyendo futuros sobre Letras del Tesoro, se ubicó en 4 millones de contratos (-1,7% MoM y -5,6% YoY).*
- ✓ *En términos nocionales, el volumen agregado del mes fue de 19.337 millones de dólares (+5,4% MoM y +13,5% YoY).*
- ✓ *En el primer semestre del año, y excluyendo la operatoria de futuros de Letras del Tesoro, el volumen operado acumuló 99,2 millones de contratos (35% por encima del mismo período del año anterior), mientras que el interés abierto promedio diario alcanzó 3,4 millones de contratos (-20% vs. el primer semestre del 2022).*

Visión General

Junio | 2023: Volumen en Contratos

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	16,8M	8,1%	6,7%	3,9M	-1,7%	-5,5%
Acciones Individuales	42,8K	22,4%	-5,3%	3,1K	12,5%	-55,7%
Índices Accionarios	26,4K	54,3%	-20,7%	1,6K	41,4%	-5,1%
Energía	15,2K	-12,2%	-28,7%	1,3K	-13,7%	4,9%
Metales	4,1K	3,9%	-11,0%	728,9	-47,2%	-54,9%
Letras del Tesoro	0,0	0,0%	-100,0%	0,0	0,0%	-100,0%
Subtotal (sin LEDES)	16,9M	8,1%	6,6%	4,0M	-1,7%	-5,6%
Total	16,9M	8,1%	-39,1%	4,0M	-1,7%	-36,0%

Fuente: Mtr

Visión General

Junio | 2023: Volumen Nacional

Matba Rofex

	Volumen Nacional en USD			IA Prom. Diario Nacional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	19.232,2M	5,2%	14,1%	4.550,2M	-0,7%	2,1%
Acciones Individuales	26,1M	41,6%	116,2%	2,6M	42,0%	54,4%
Índices Accionarios	59,9M	69,2%	87,5%	3,5M	53,0%	125,1%
Energía	10,7M	-13,6%	-55,3%	905,3K	-14,7%	-35,4%
Metales	8,0M	1,7%	-4,7%	1,4M	-48,7%	-52,0%
Letras del Tesoro	0,0	0,0%	-100,0%	0,0	0,0%	-100,0%
Total	19.337,0M	5,4%	13,5%	4.558,7M	-0,7%	1,8%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2023: Volumen en Contratos

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2023	2022	Var%	2023	2022	Var%
Monedas	98,7M	73,0M	35%	3,4M	4,2M	-20%
Acciones Individuales	253,2K	346,4K	-27%	3,1K	6,3K	-50%
Índices Accionarios	144,6K	226,2K	-36%	1,5K	2,6K	-43%
Energía	88,7K	111,4K	-20%	1,2K	1,8K	-31%
Metales	26,2K	28,1K	-7%	1,3K	1,3K	-3%
Letras del Tesoro	119,2M	46,9M	154%	5,6M	3,2M	77%
Subtotal (sin LEDES)	99,2M	73,7M	35%	3,4M	4,2M	-20%
Total	218,4M	120,6M	81%	9,0M	7,4M	22%

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

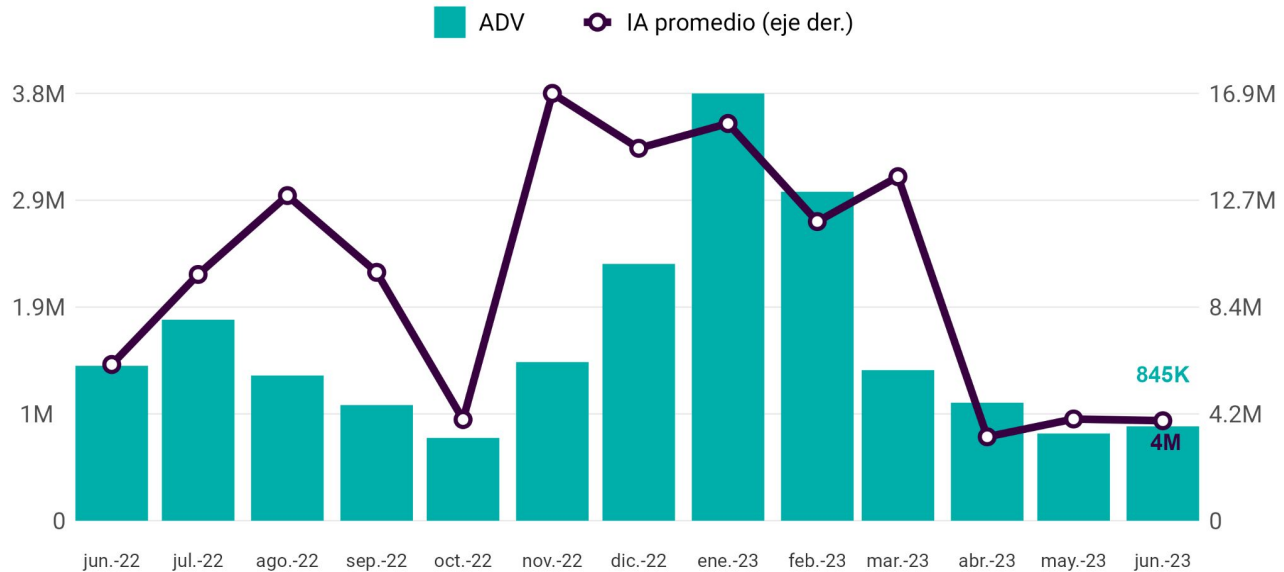
Fuente: MtR

Visión General

Volumen Histórico de FyO

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos



Nota: Se incluye la operatoria de Letras del Tesoro
Fuente: MTR

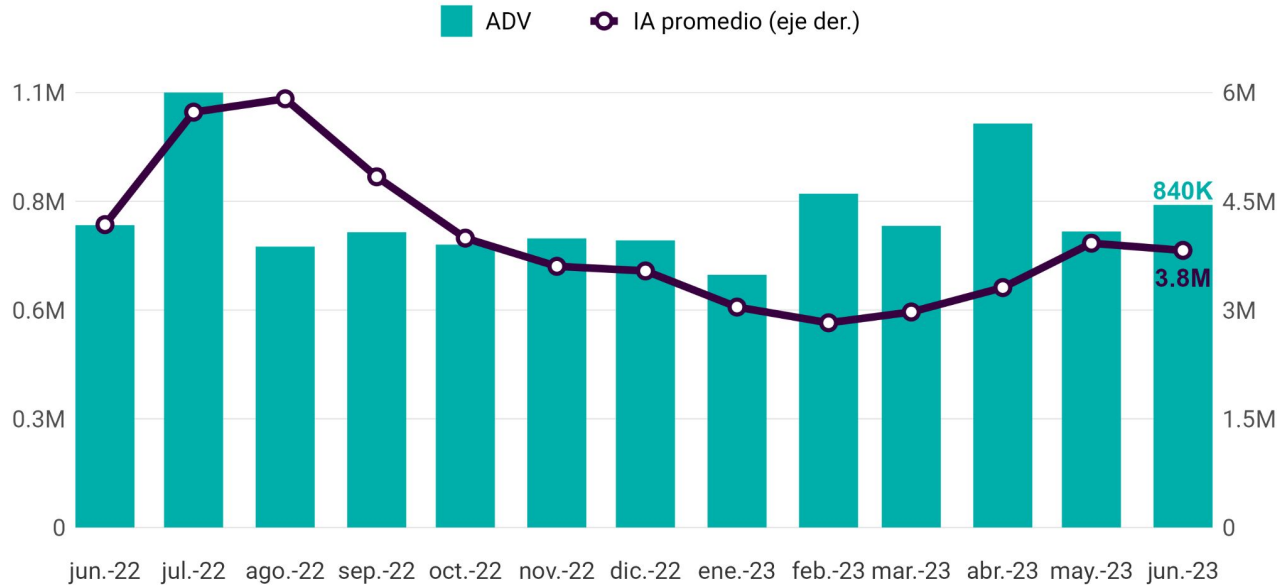
Dólar: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos



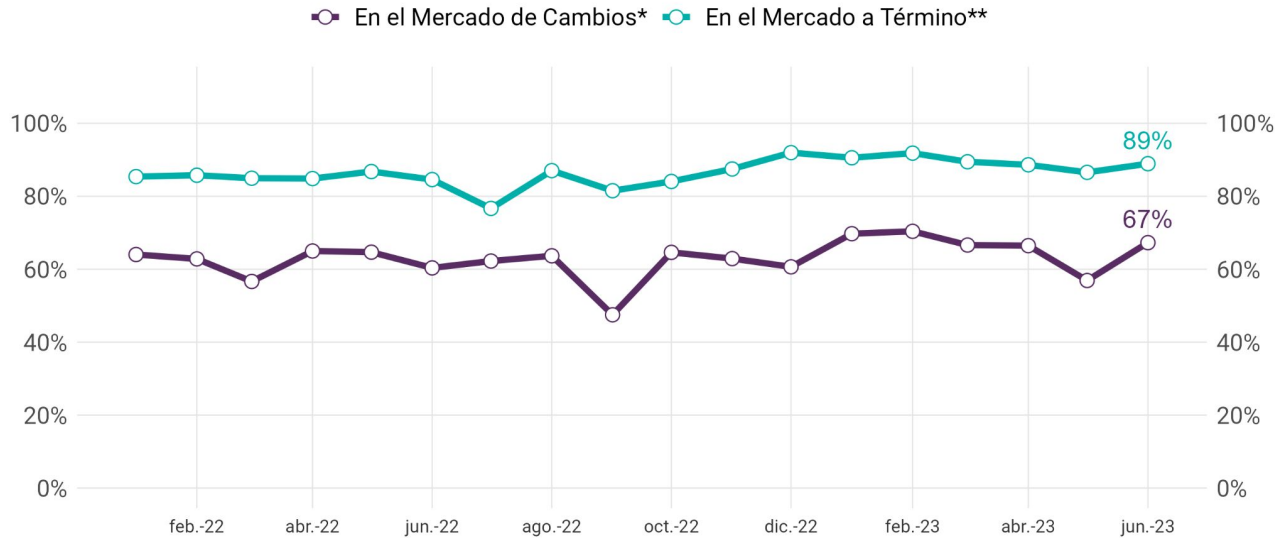
Fuente: MtR

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

MatbaRofex

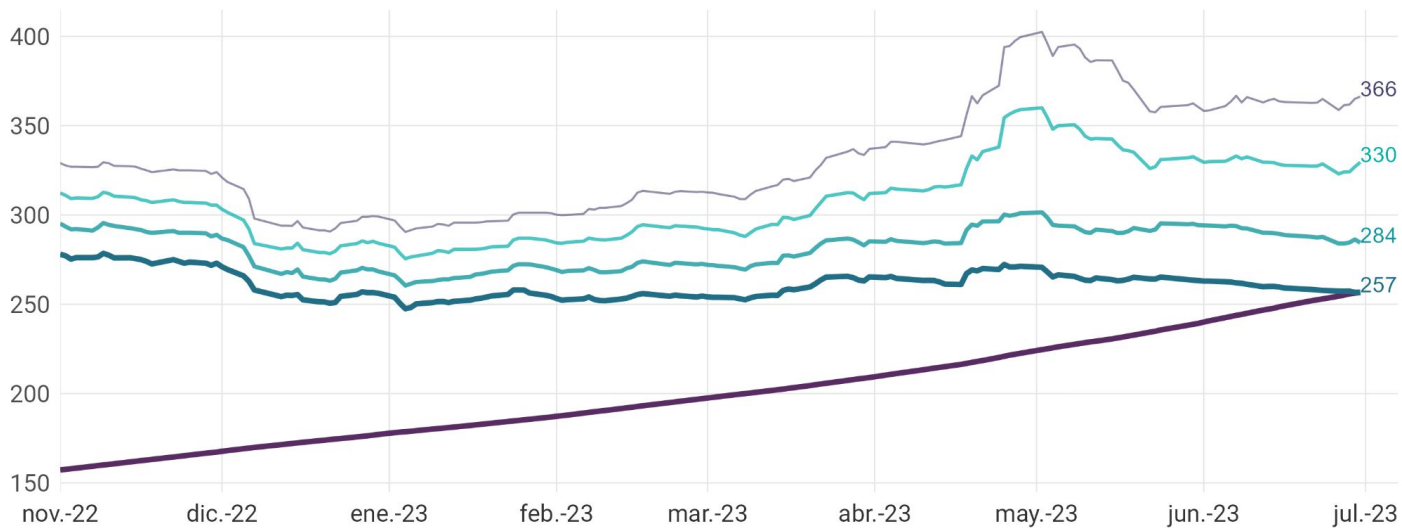
Posición	Precio de Ajuste al 30/06			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR062023	256,68	-6,57	-2,5% ▼	8.286.164	57% ▲	0	-100% ▼
DLR072023	284,50	-9,80	-3,3% ▼	5.976.331	249% ▲	2.110.522	248% ▲
DLR082023	329,50	-1,50	-0,5% ▼	1.009.771	-12% ▼	389.229	133% ▲
DLR092023	366,30	5,95	1,7% ▲	723.788	92% ▲	176.784	111% ▲
DLR102023	405,00	11,60	2,9% ▲	381.481	67% ▲	109.112	99% ▲
DLR112023	443,50	18,00	4,2% ▲	235.098	57% ▲	106.103	70% ▲
DLR122023	517,00	40,00	8,4% ▲	66.341	-45% ▼	53.459	27% ▲
DLR012024	573,00	49,00	9,4% ▲	37.988	187% ▲	23.967	251% ▲
DLR022024	615,00	63,00	11,4% ▲	43.900	143% ▲	18.586	124% ▲
DLR032024	646,00	63,00	10,8% ▲	7.369	-75% ▼	10.577	0% ▲
DLR042024	686,80	64,80	10,4% ▲	27.182	-28% ▼	14.323	5% ▲
DLR052024	730,00	N/C	N/C	11.606	N/C	5.573	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	27,04	4,8% ▲	16.807.019	9% ▲	3.018.235	3% ▲

Fuente: Mtr

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR062023 DLR072023 DLR082023 DLR092023



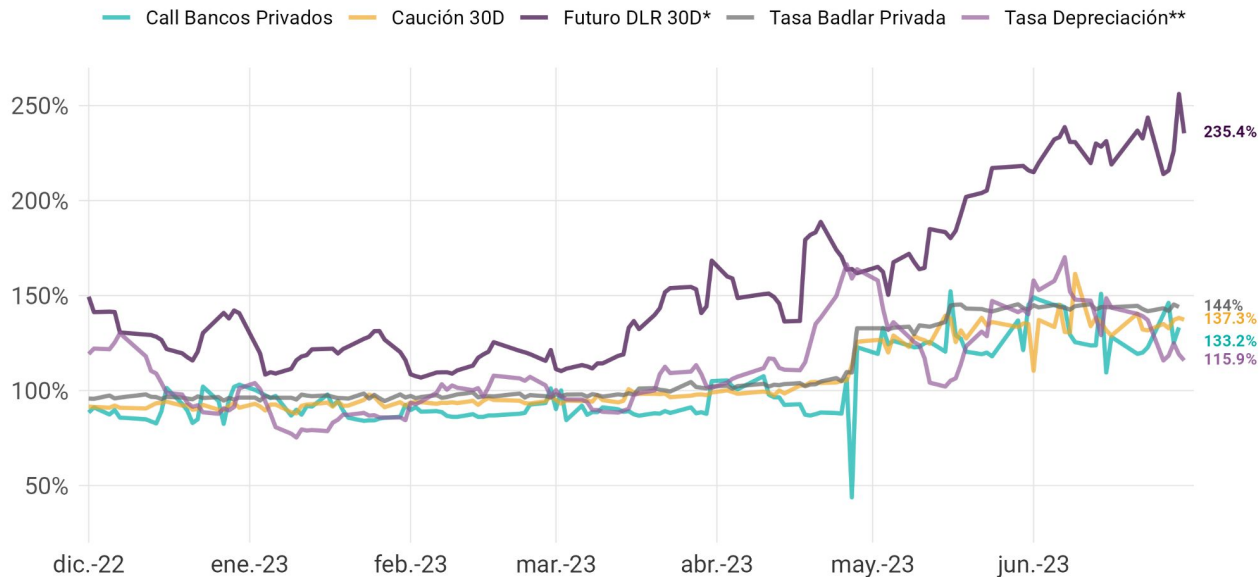
Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Matba Rofex

Tasas Efectivas Anuales (TEA)



*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

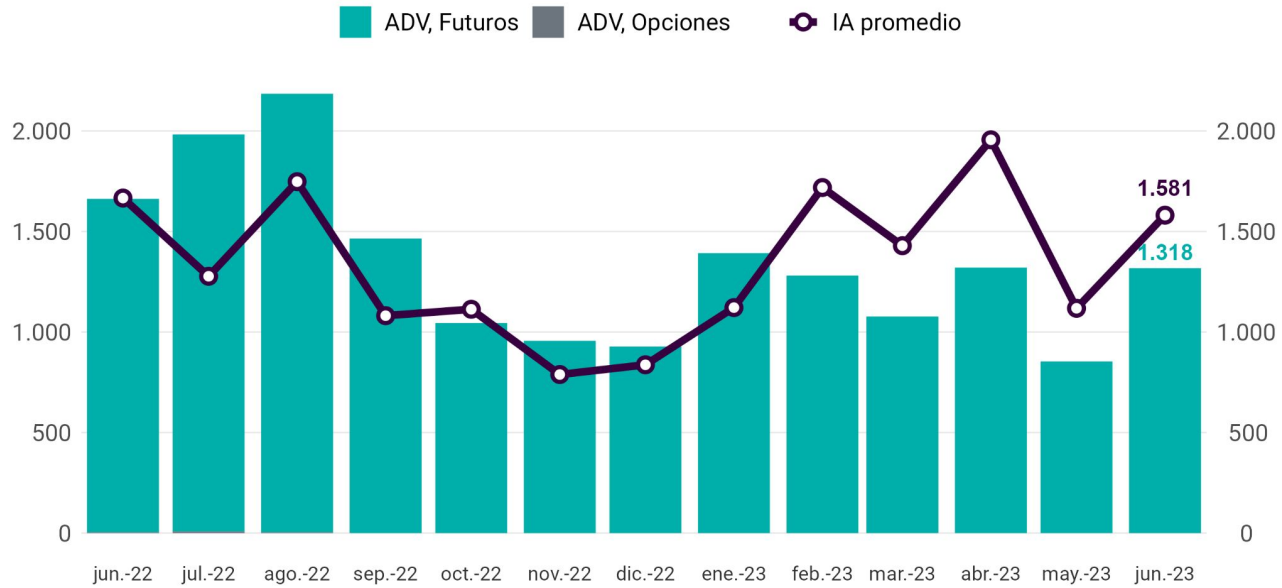
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

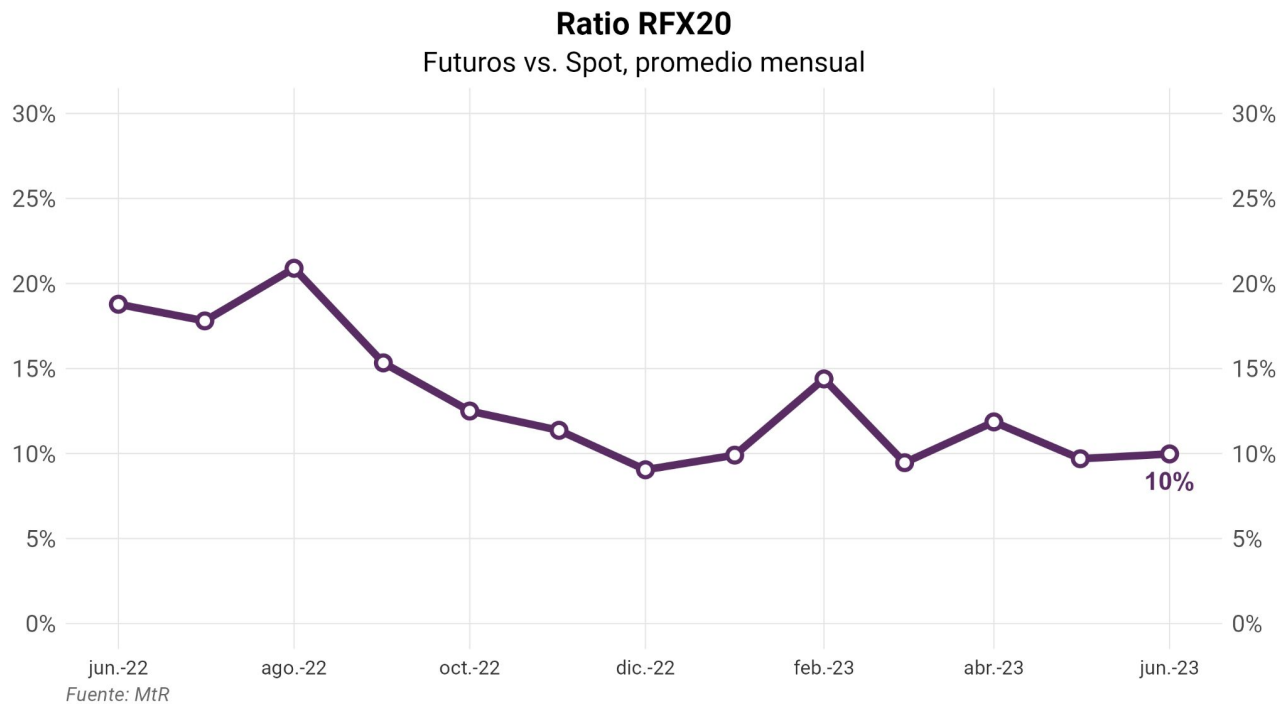


Fuente: MTR

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex

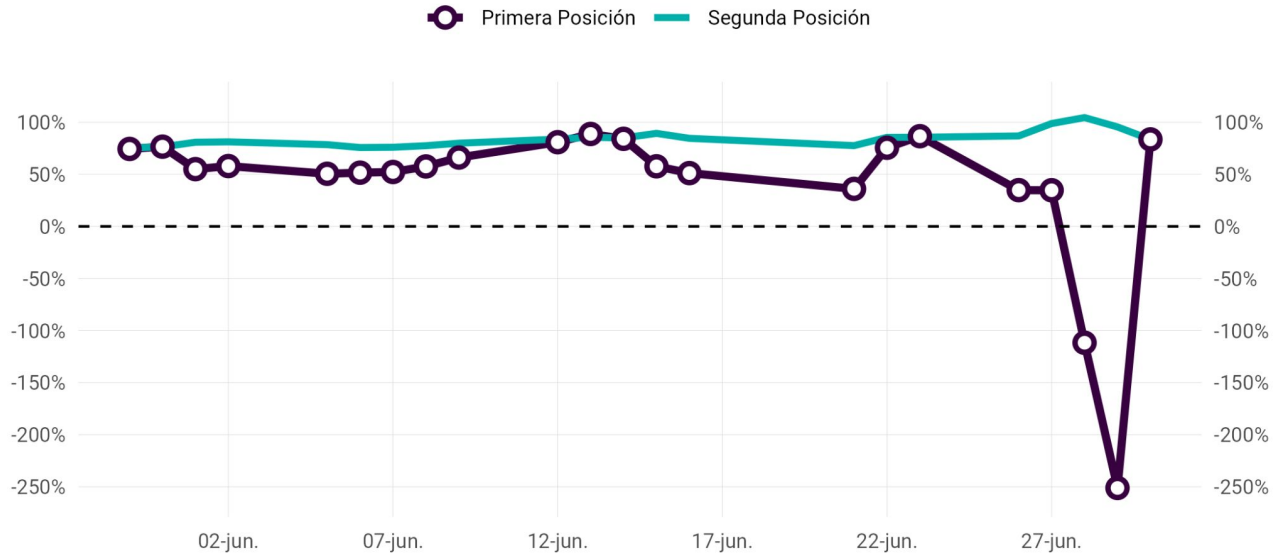


RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

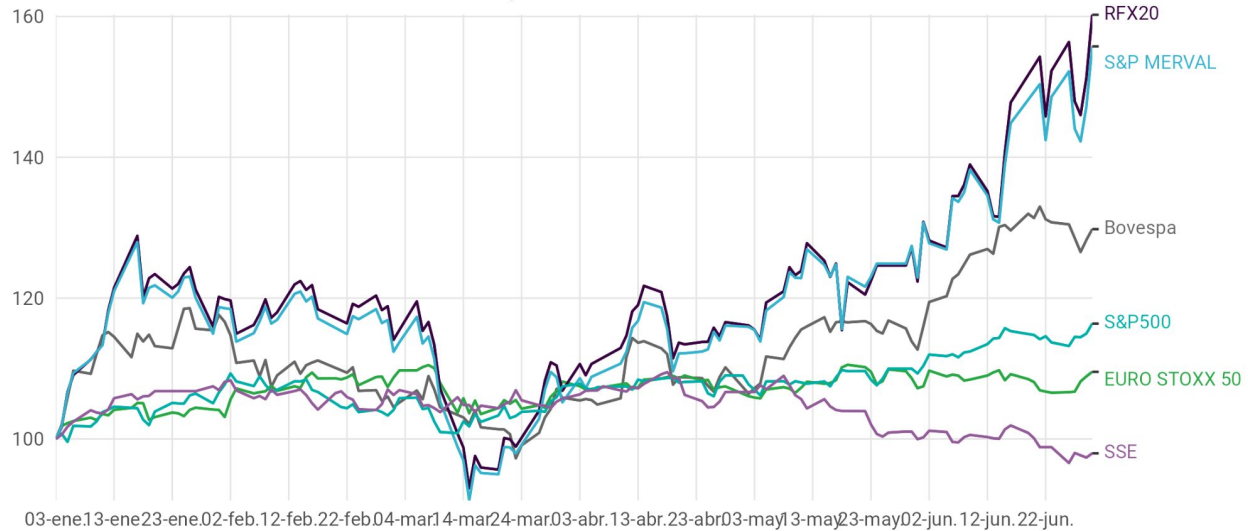
TNA en base a precios de ajuste de cada día y el cierre del spot del último mes



Fuente: Matba Rofex

Evolución de Índices Accionarios Seleccionados

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año

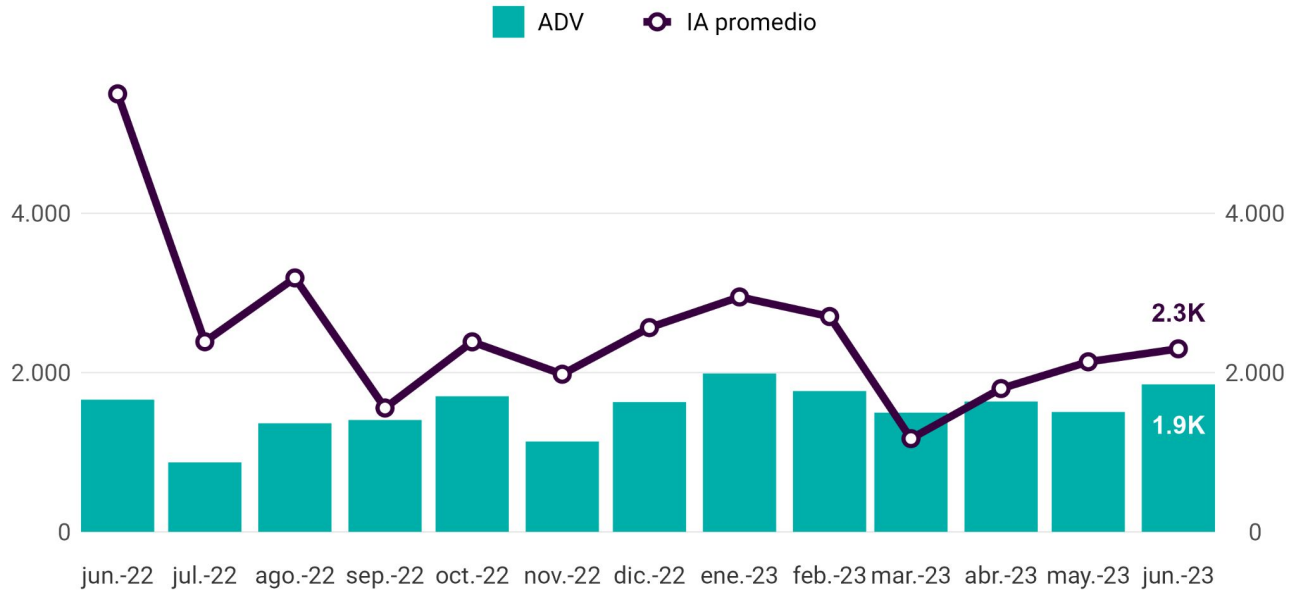


Fuente: MtR y Reuters

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

Futuros de Galicia

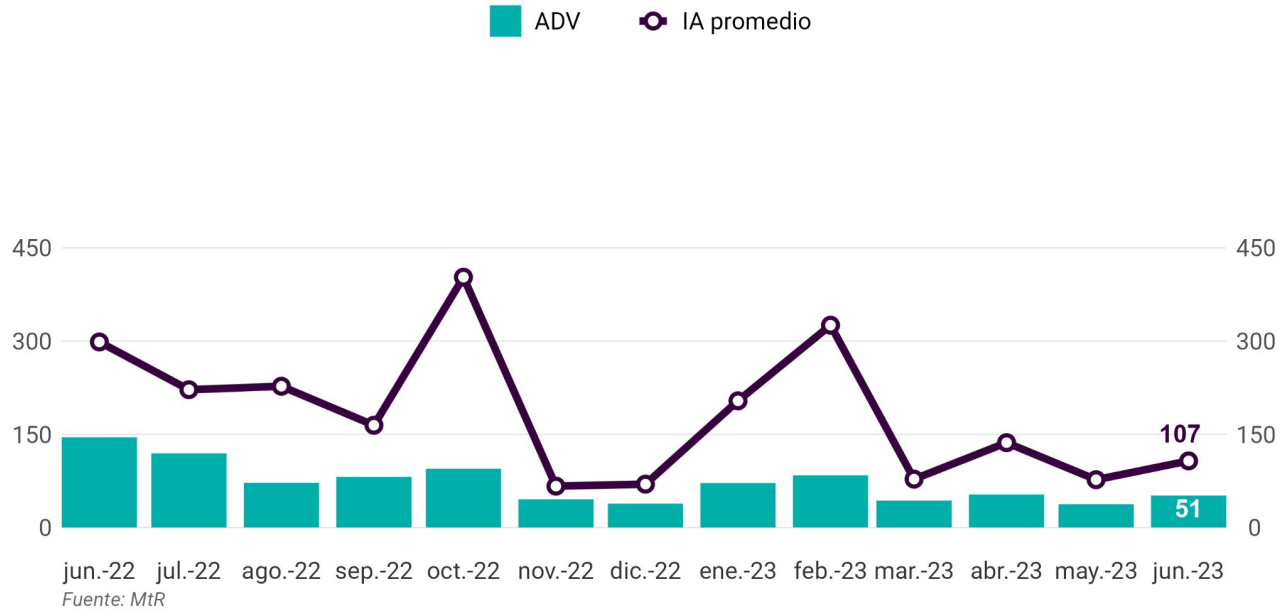
Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: MtR

Futuros de Pampa Energía

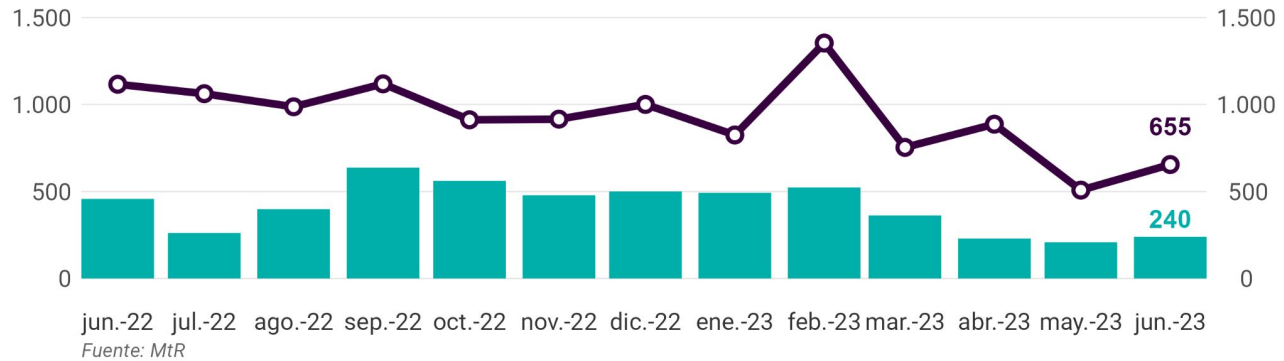
Evolución de la operatoria, en contratos



Futuros de YFPD

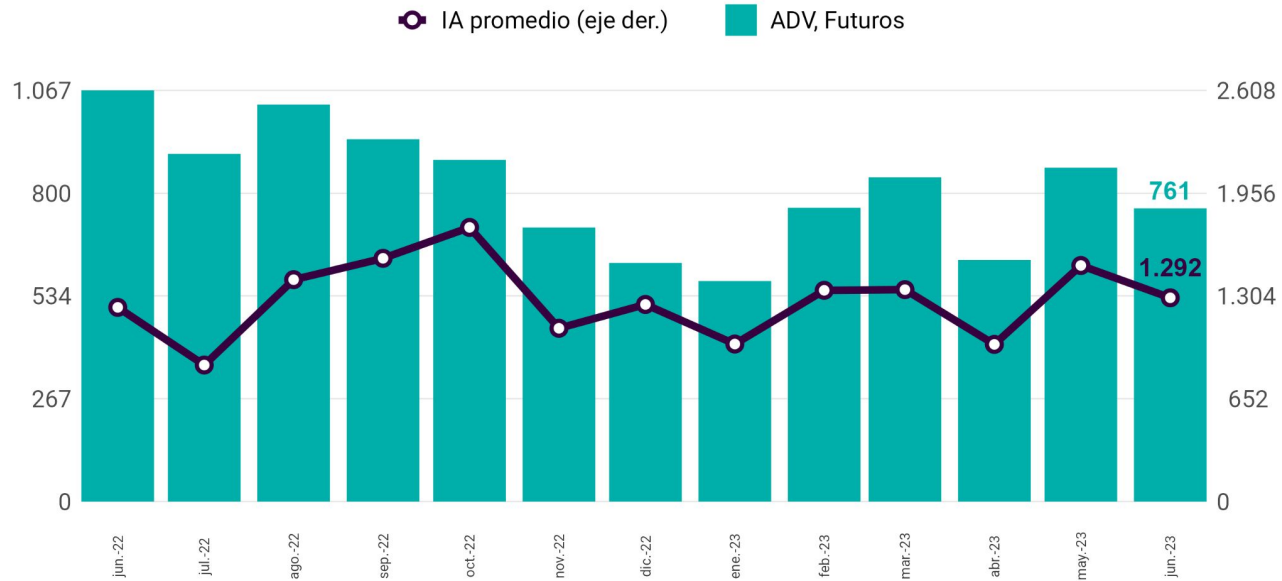
Evolución de la operatoria, en contratos

■ ADV ○ IA promedio

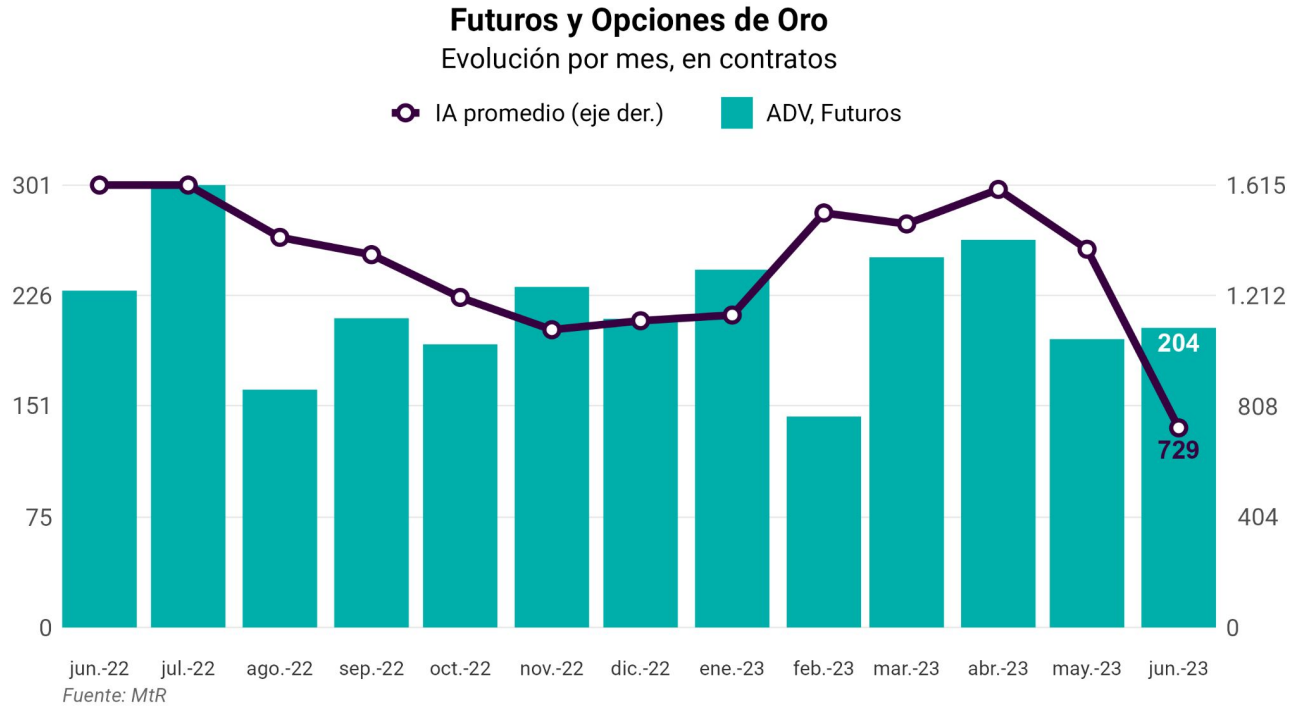


Futuros de Petróleo

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
Responsable

Jacqueline Najar
Analista

Lucía Madoery
Analista

Aarón Hierrezuelo
Analista