

Matba Rofex

# Informe Mensual de Derivados Financieros Mayo 2021

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en mayo 7,2 millones de contratos (-10,4% MoM y -23,8% YoY).*
- ✓ *En el quinto mes del año, la operatoria de futuros y opciones sobre monedas se ubicó en 7,1 millones de contratos (-10,5% MoM y -22,4% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de todos los productos aumentó un 1,1% en el mes, ubicándose en 2,8 millones de contratos.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario acumulado del 2021 de todos los productos alcanzó 3,3 millones de contratos, un 109,2% por encima del mismo período del año anterior.*
- ✓ *En el acumulado del 2021, el volumen operado asciende a 44 millones de contratos, un 23,1% superior con respecto al mismo período del 2020.*

# Visión General

Mayo | 2021

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	7,1M	-10,5%	-22,4%	2,7M	1,2%	4,8%
Índices Accionarios	60,7K	-11,8%	-72,2%	3,7K	2,5%	-28,6%
Acciones Individuales	45,2K	-5,3%	-1,3%	4,6K	-21,3%	-2,4%
Energía	4,9K	6,6%	-86,6%	3,0K	3,6%	-25,3%
Metales	2,9K	-9,5%	-82,0%	295,4	9,9%	-94,5%
<b>Total</b>	<b>7,2M</b>	<b>-10,4%</b>	<b>-23,8%</b>	<b>2,8M</b>	<b>1,1%</b>	<b>4,5%</b>

Fuente: MtR

# Visión General

Acumulado | 2021

Matba Rofex

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2021	2020	Var%	2021	2020	Var%
Monedas	43,3M	34,3M	26,4%	3,2M	1,5M	110,2%
Índices Accionarios	372,1K	1,0M	-62,8%	6,7K	4,4K	52,5%
Acciones Individuales	270,4K	115,9K	133,3%	5,3K	1,9K	187,5%
Energía	36,1K	287,6K	-87,4%	2,8K	4,4K	-37,6%
Metales	16,3K	77,8K	-79,1%	850,3	4,1K	-79,1%
<b>Total</b>	<b>44,0M</b>	<b>35,8M</b>	<b>23,1%</b>	<b>3,3M</b>	<b>1,6M</b>	<b>109,2%</b>

\*En contratos, datos acumulados al 31/5 de cada año

Fuente: MtR

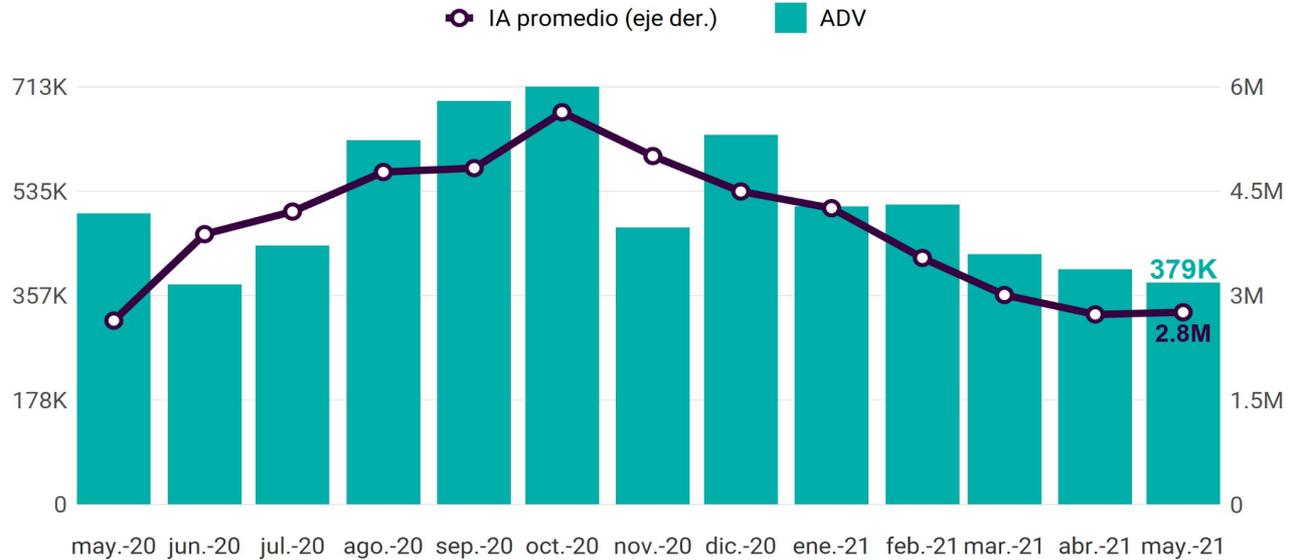
# Visión General

## Volumen Histórico de FyO

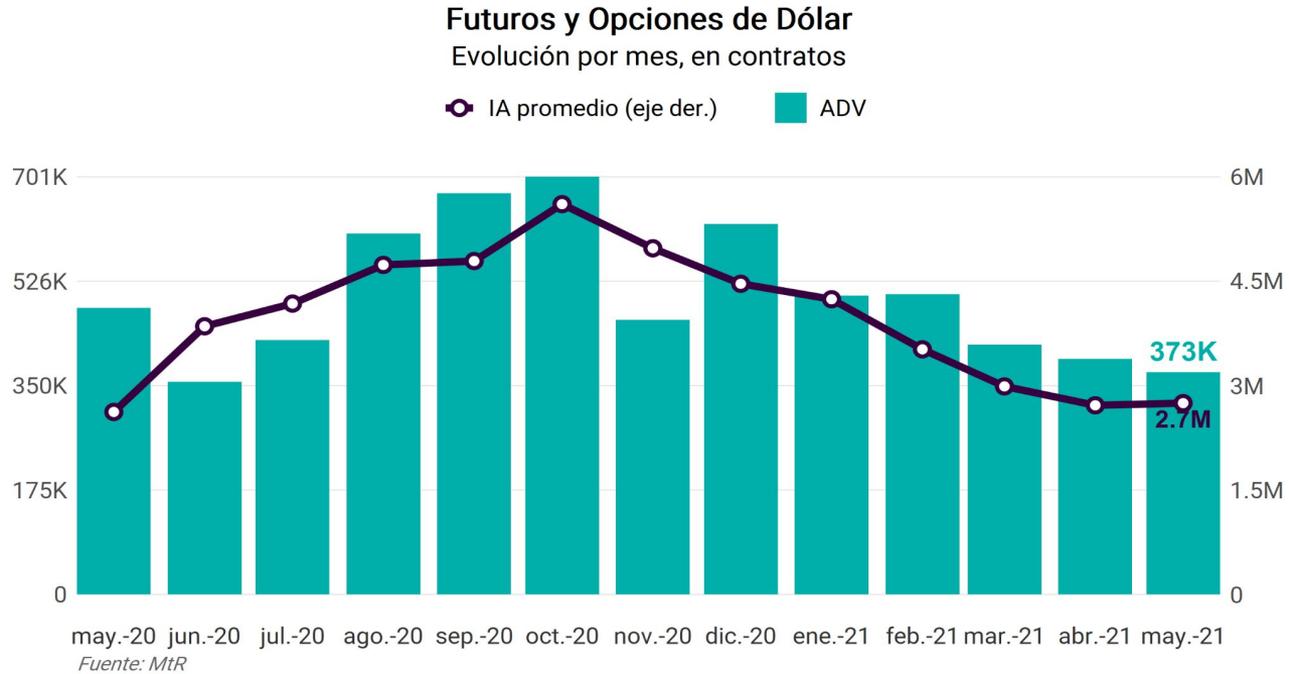
MatbaRofex

### Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos



Fuente: MtR



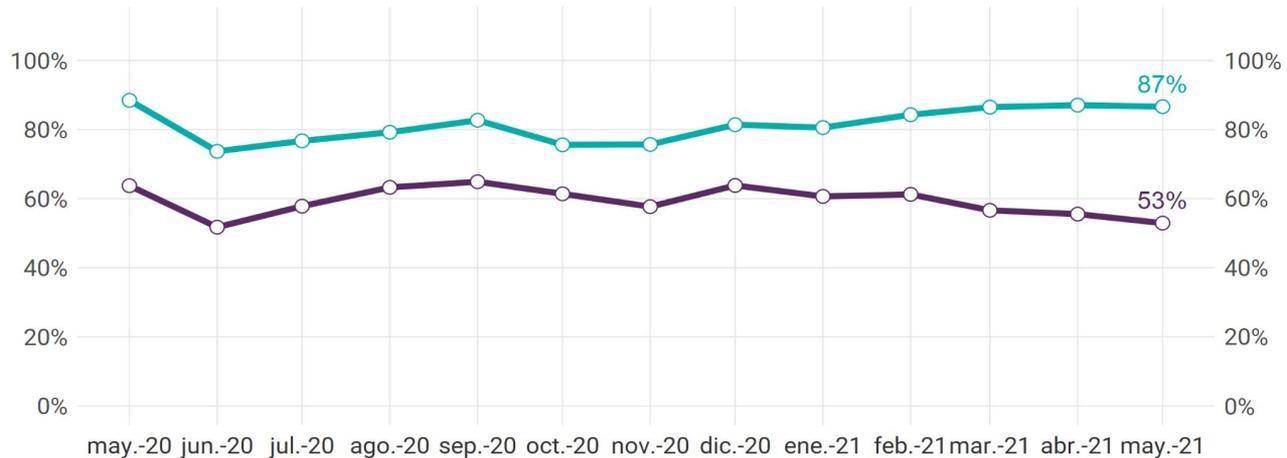
# Dólar: Market Share

## 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 31/05			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR052021	94,69	-1,41	-1,5% ▼	2.255.091	-9% ▼	0	-100% ▼
DLR062021	97,34	-1,51	-1,5% ▼	2.023.254	163% ▲	908.301	111% ▲
DLR072021	99,80	-2,00	-2,0% ▼	845.642	41% ▲	355.930	78% ▲
DLR082021	102,65	-2,95	-2,8% ▼	541.849	30% ▲	211.993	50% ▲
DLR092021	105,55	-4,01	-3,7% ▼	485.288	34% ▲	218.971	51% ▲
DLR102021	108,80	-4,72	-4,2% ▼	290.005	-12% ▼	183.588	33% ▲
DLR112021	113,00	-4,60	-3,9% ▼	336.278	74% ▲	212.309	32% ▲
DLR122021	117,46	-5,35	-4,4% ▼	129.470	-30% ▼	127.003	9% ▲
DLR012022	122,00	-6,00	-4,7% ▼	158.359	211% ▲	37.753	110% ▲
DLR022022	127,21	-5,79	-4,4% ▼	19.167	29% ▲	9.267	65% ▲
DLR052022	142,00	N/C	N/C	0	N/C	0	N/C
<b>PROMEDIO/TOTAL</b>	<b>N/C</b>	<b>-3,83</b>	<b>-3,3% ▼</b>	<b>7.084.793</b>	<b>-10% ▼</b>	<b>2.265.405</b>	<b>-9% ▼</b>

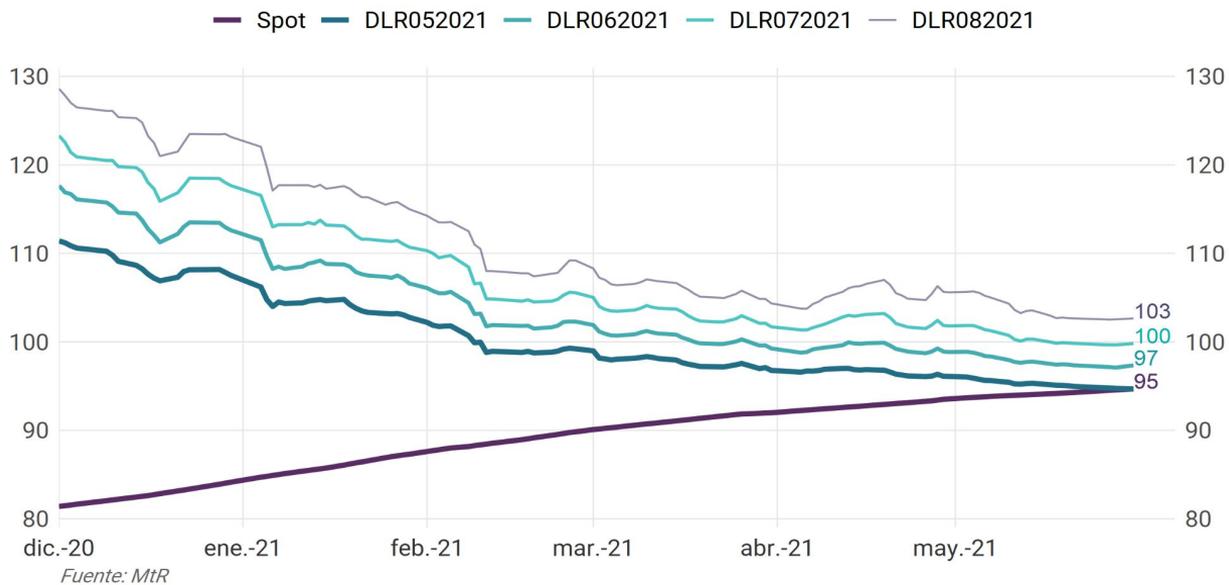
Fuente: Mtr

# Dólar: Cotizaciones

## Futuros

### Cotizaciones de Futuros de Dólar

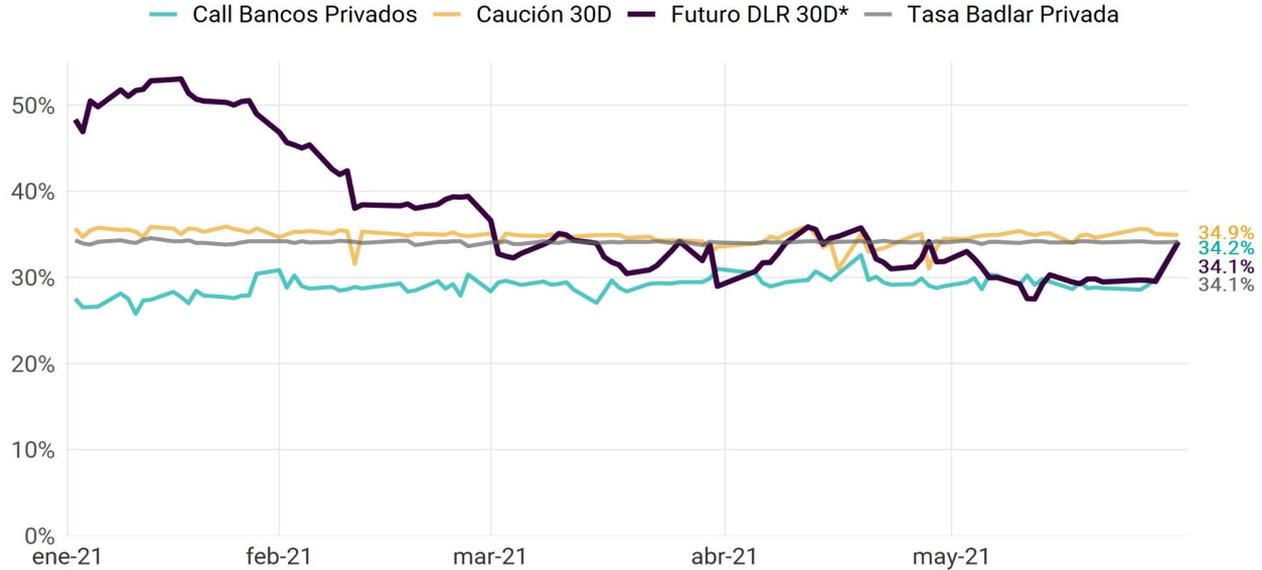
AR\$/US\$, últimos 6 meses del spot y primeras cuatro posiciones



# Dólar: Evolución de tasas

## Futuros

### Evolución de Tasas Seleccionadas (TNA)



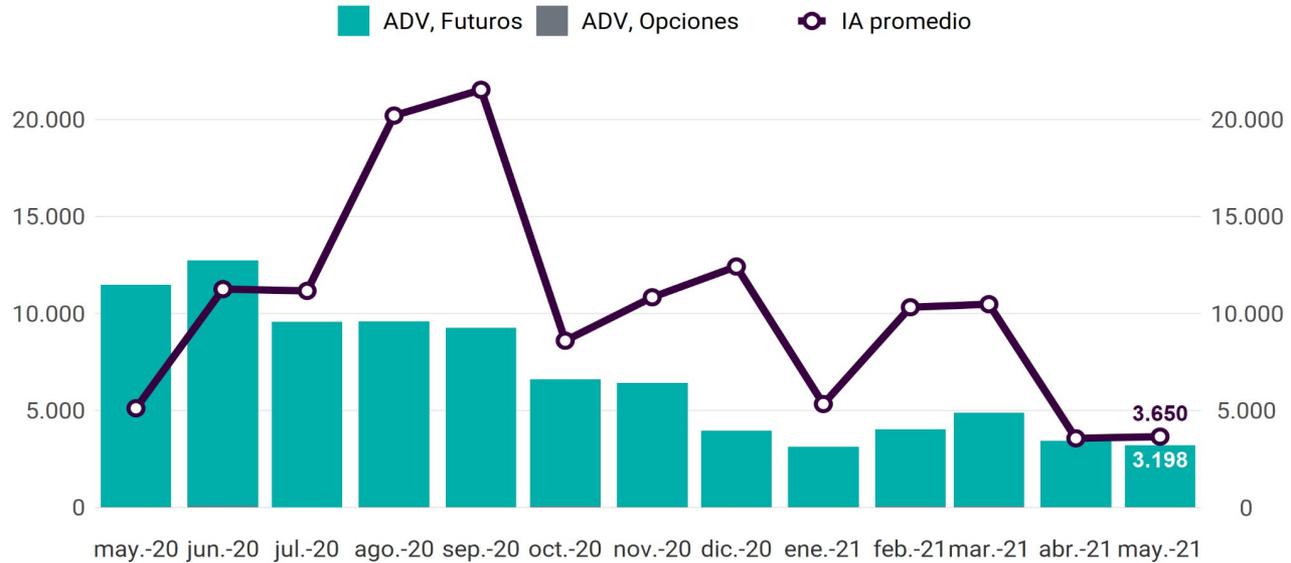
\*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días  
Fuente: MtR y Reuters

# RFX20: Operatoria

## Futuros y Opciones

### Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

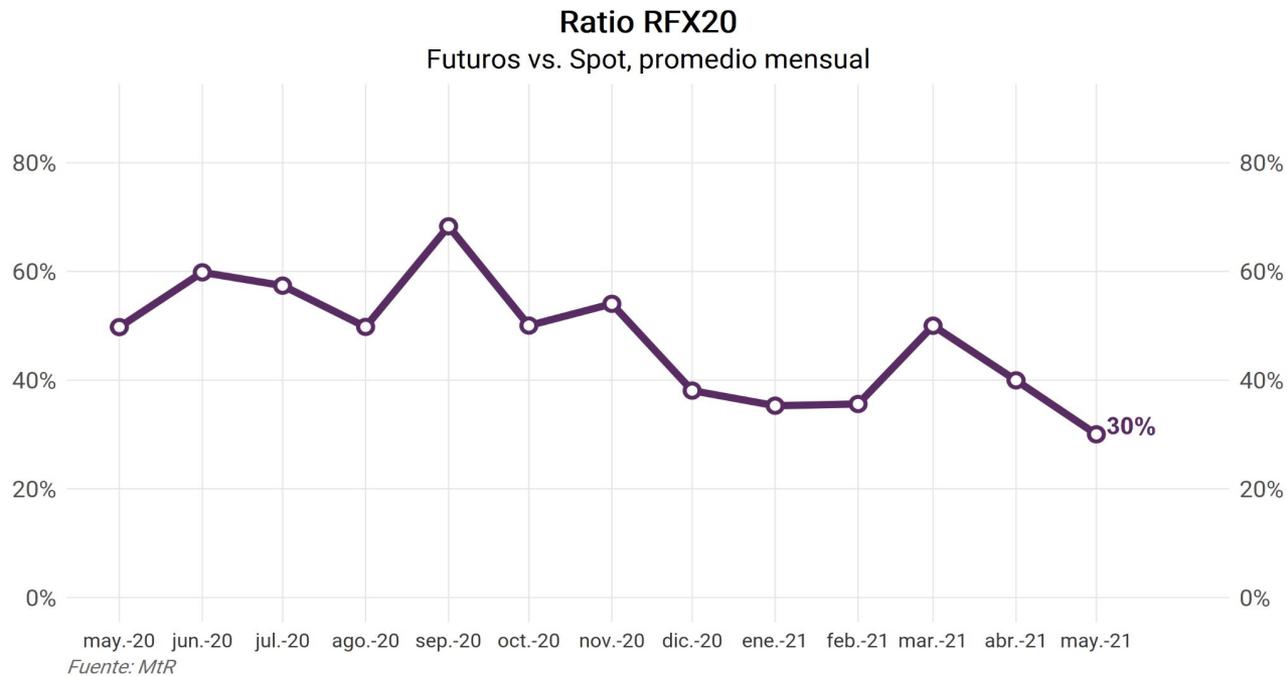


Fuente: Mtr

# RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



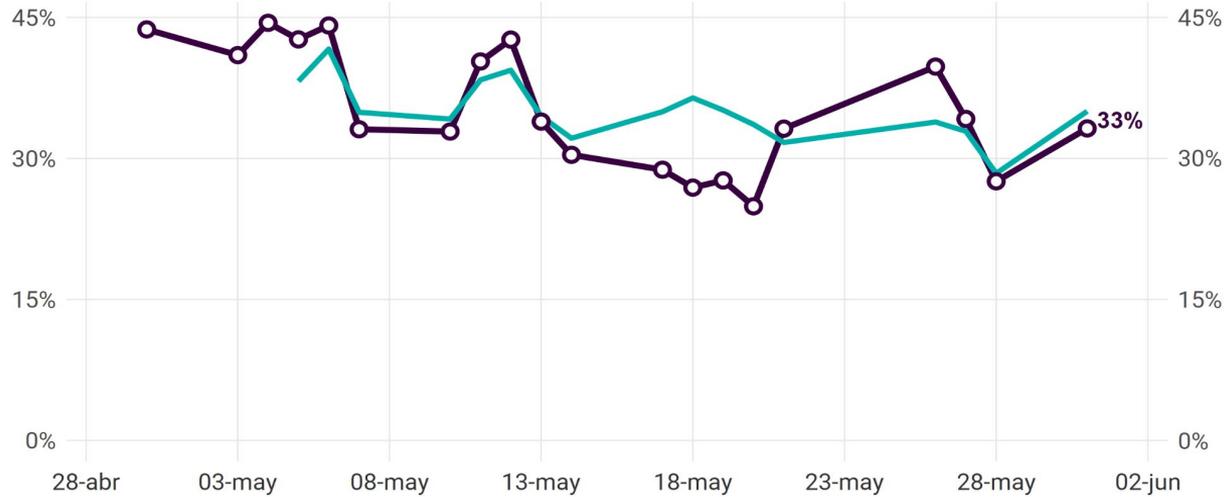
# RFX20: Tasas implícitas

## 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

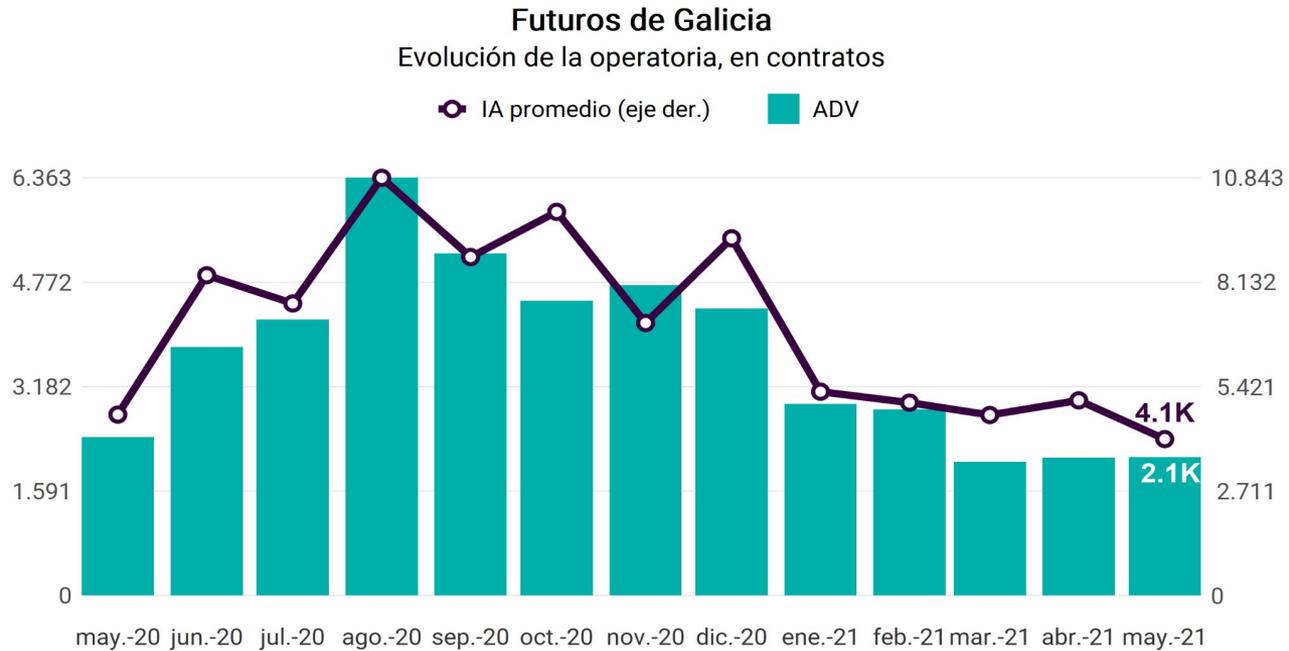
### Principales Índices Accionarios Mundiales

Medido en Dólares\*, base 100 desde inicio del año

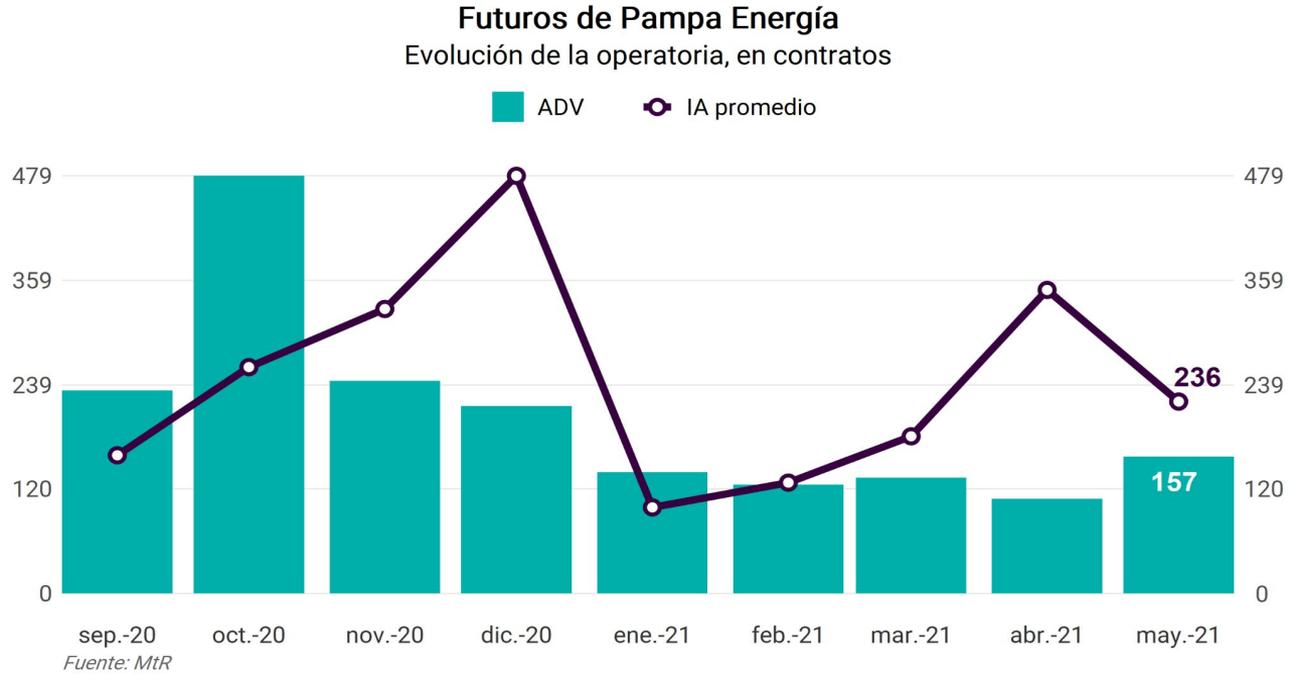


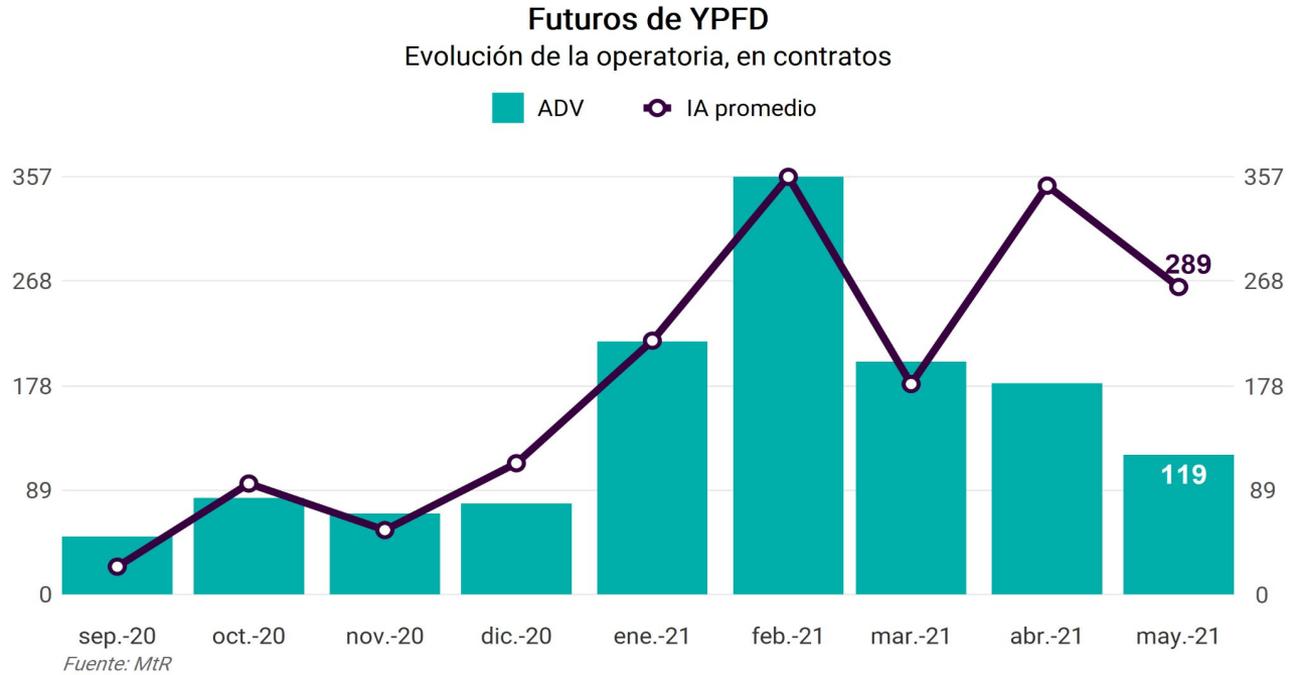
Fuente: MTR y Reuters

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

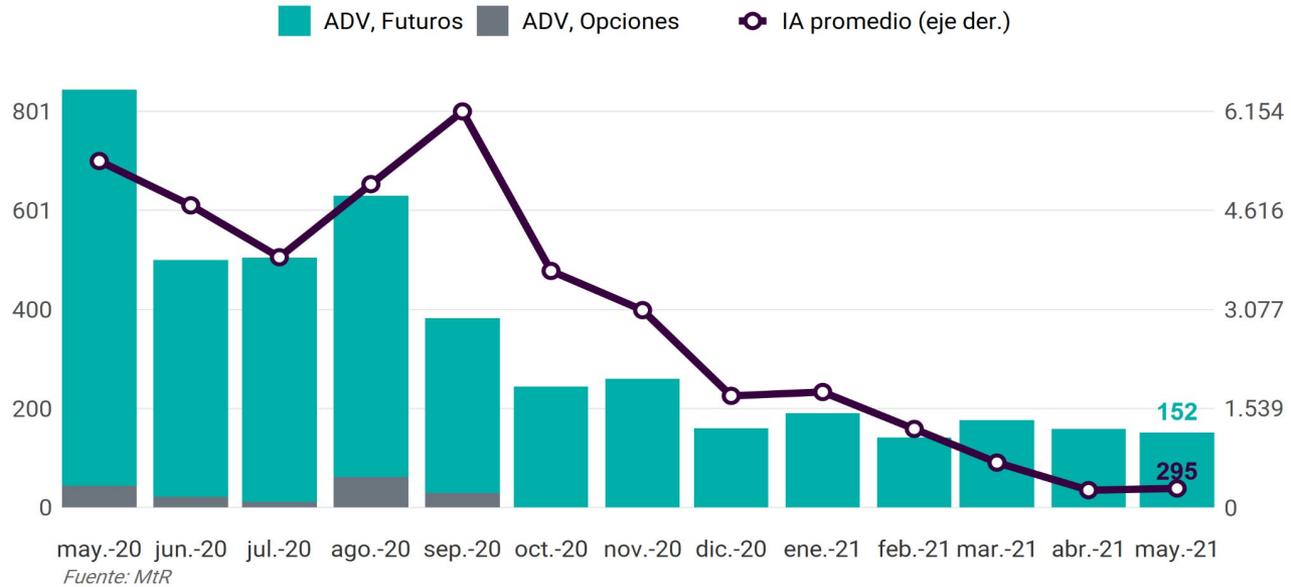


Fuente: Mtr





**Futuros y Opciones de Oro**  
Evolución por mes, en contratos



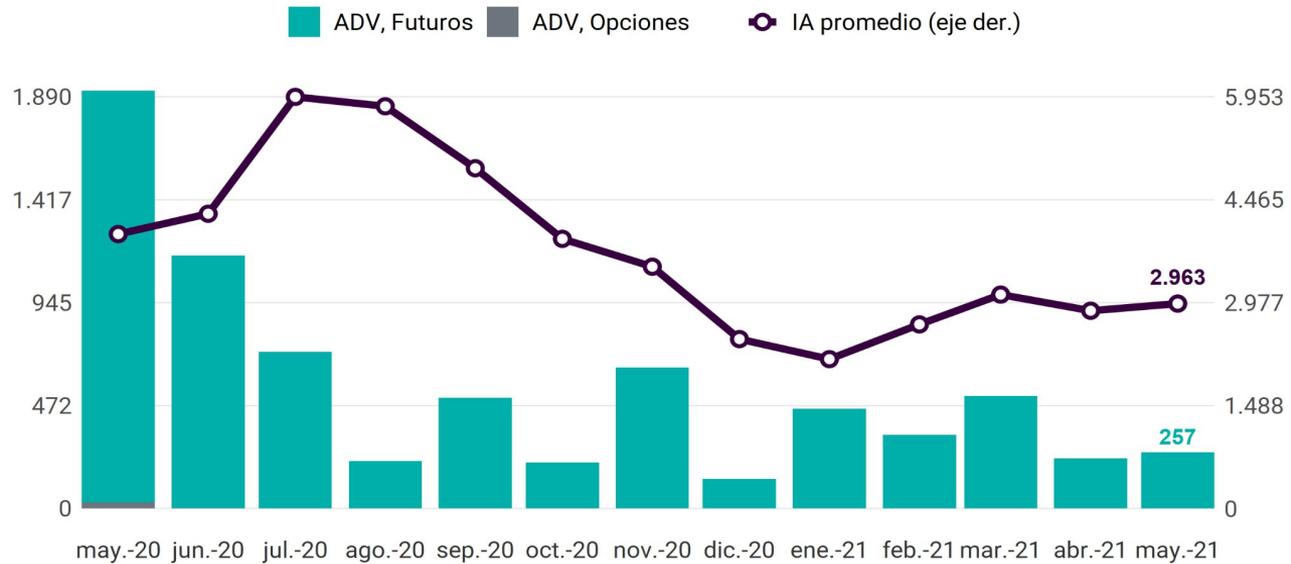
# Petróleo: Operatoria

## Futuros y Opciones

MatbaRofex

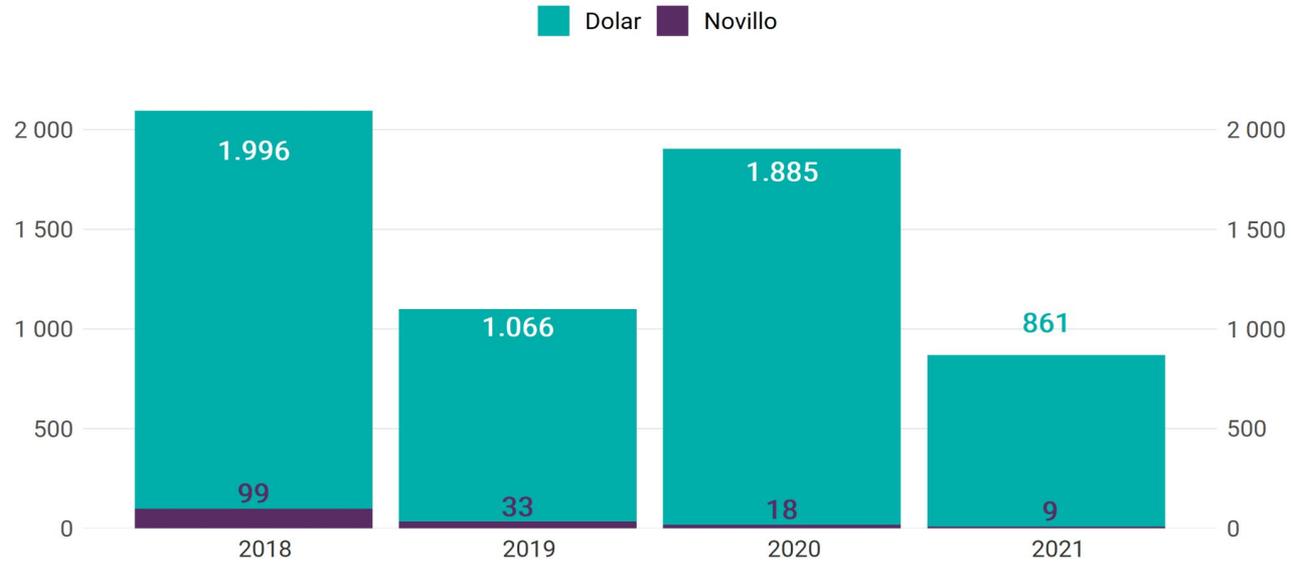
### Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Fuente: Mtr

**Volumen acumulado anual UFEX**  
Datos hasta mayo 2021, en contratos



Fuente: Mtr

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

[investigacion@matbarofex.com.ar](mailto:investigacion@matbarofex.com.ar)

**Marcelo Comisso**  
Gerente

**Juan Francisco Gómez**  
Responsable

**Camila Ajler**  
Analista

**Valentín Bruzzoni**  
Analista

**Jacqueline Najar**  
Analista