

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Octubre 2021

Highlights del mes

MatbaRofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en octubre 25,9 millones de contratos (+114,4% MoM y +162,6% YoY).*
- ✓ *El salto mensual se explica por el volumen puntual registrado en futuros sobre Letras del Tesoro, de 15 millones de contratos, mientras que en términos nocionales, el volumen agregado fue de 11.928 millones de dólares (-0,9% MoM y +53,4% YoY).*
- ✓ *En octubre, el interés abierto promedio diario de todos los productos se ubicó en 9,8 millones de contratos, 163,7% superior al mes anterior.*
- ✓ *En los 10 meses del 2021, el volumen operado ascendió a 106,6 millones de contratos, un 31,1% superior con respecto al mismo período del 2020.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del 2021 de todos los productos alcanzó 3,7 millones de contratos, un 39,5% por encima del mismo período del año anterior.*

Visión General

Octubre | 2021

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Letras del Tesoro	15,0M	2.103,0%	NA	5,6M	710,3%	NA
Monedas	10,8M	-3,4%	12,0%	4,2M	39,1%	57,4%
Índices Accionarios	84,1K	-43,5%	-39,4%	11,4K	26,7%	32,2%
Acciones Individuales	62,7K	-30,8%	-40,9%	6,6K	11,2%	-35,8%
Energía	8,1K	1,9%	81,3%	2,4K	54,1%	-37,9%
Metales	3,7K	22,1%	-27,9%	468,1	-53,4%	-87,3%
Total	25,9M	114,4%	162,6%	9,8M	163,7%	265,0%

Fuente: MtR

Visión General

Octubre | 2021

Matba Rofex

	Volumen Nacional en USD			IA Prom. Diario Nacional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	11.666,0M	-1,4%	52,0%	4.517,6M	42,0%	52,0%
Letras del Tesoro	136,7M	1.929,0%	NA	51,1M	660,1%	NA
Índices Accionarios	95,8M	-41,5%	73,2%	12,5M	31,7%	73,2%
Acciones Individuales	16,3M	-21,7%	18,0%	1,8M	34,3%	18,0%
Metales	6,6M	21,9%	-88,2%	834,7K	-53,5%	-88,2%
Energía	6,5M	16,6%	26,4%	2,0M	75,3%	26,4%
Total	11.928,0M	-0,9%	53,4%	4.585,9M	43,2%	53,4%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Acumulado | 2021

Matba Rofex

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2021	2020	Var%	2021	2020	Var%
Monedas	89,1M	78,3M	13,7%	3,1M	2,6M	17,2%
Letras del Tesoro	15,9M	0,0	NA	2,3M	0,0	NA
Índices Accionarios	921,9K	2,0M	-54,0%	7,1K	9,7K	-26,1%
Acciones Individuales	608,5K	602,3K	1,0%	5,8K	5,5K	5,6%
Energía	71,4K	253,9K	-71,9%	2,2K	4,0K	-45,5%
Metales	33,1K	117,3K	-71,8%	839,8	4,3K	-80,3%
Total	106,6M	81,3M	31,1%	3,7M	2,6M	39,5%

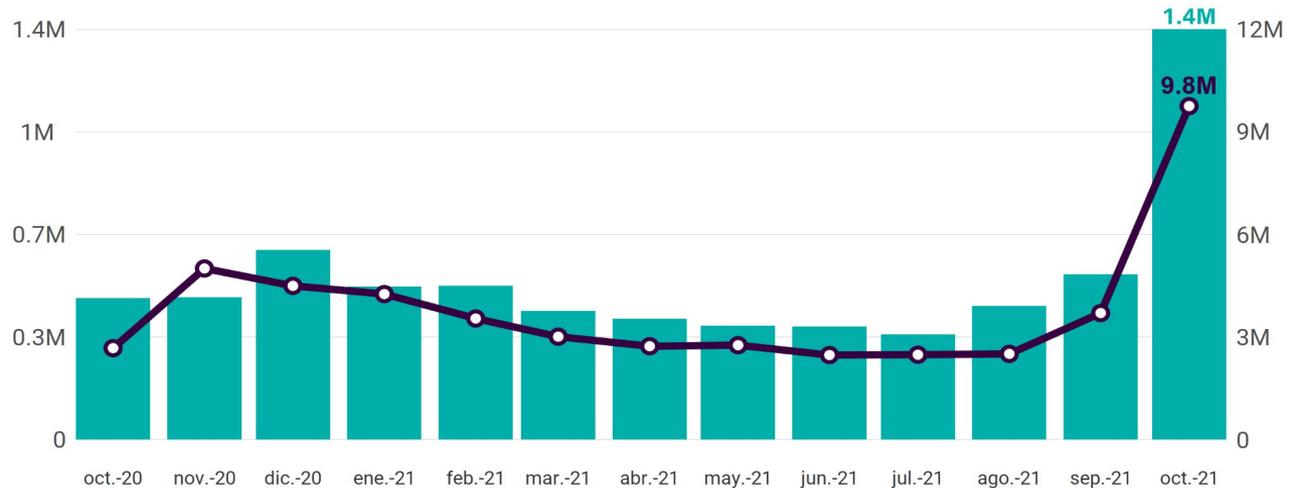
*En contratos, datos acumulados al 31/10 de cada año

Fuente: Mtr

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

Nota: el aumento tanto en volumen como en IA se debe a la operatoria de 15M de contratos sobre Letras del Tesoro en los días 20/10 y 21/10

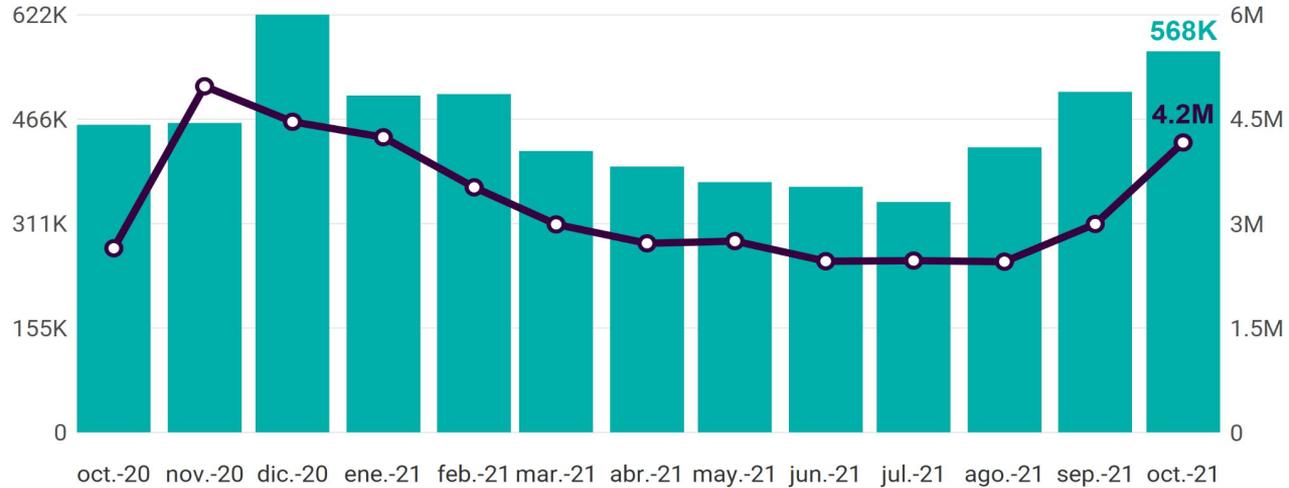
Dólar: Operatoria

Futuros y Opciones

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

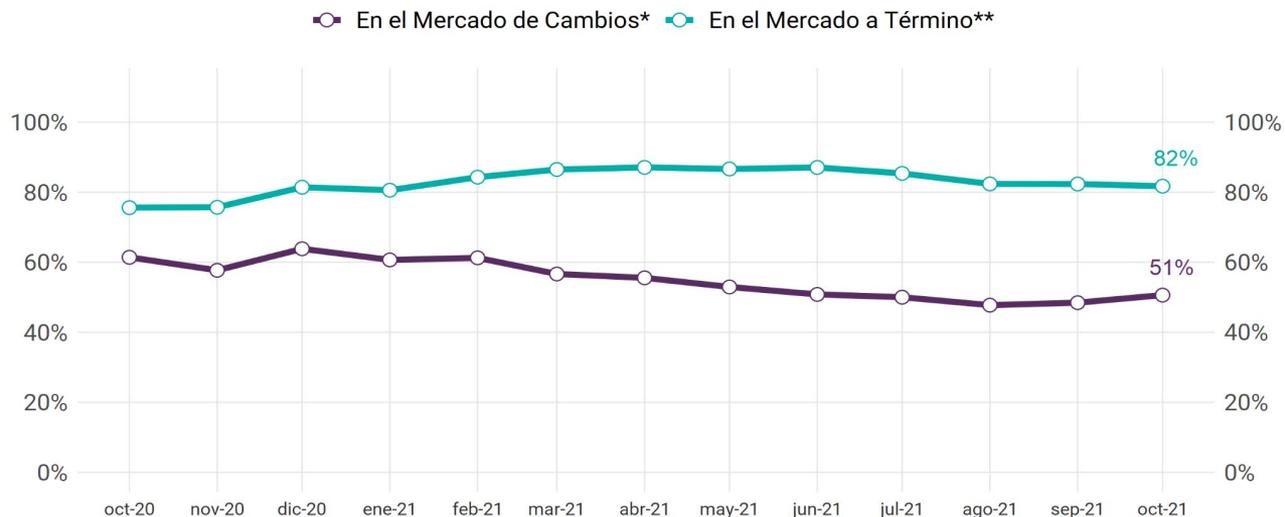
Dólar: Market Share

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 31/10			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR102021	99,72	-0,73	-0,7% ▼	3.010.112	9% ▲	0	-100% ▼
DLR112021	102,44	-1,01	-1,0% ▼	3.039.153	112% ▲	1.562.714	106% ▲
DLR122021	107,89	-0,14	-0,1% ▼	1.662.230	9% ▲	993.598	86% ▲
DLR012022	114,40	0,35	0,3% ▲	1.394.543	128% ▲	690.442	170% ▲
DLR022022	119,40	0,98	0,8% ▲	959.010	167% ▲	544.356	156% ▲
DLR032022	125,40	1,58	1,3% ▲	466.741	40% ▲	363.143	142% ▲
DLR042022	130,45	2,00	1,6% ▲	127.770	281% ▲	69.744	236% ▲
DLR052022	136,00	2,80	2,1% ▲	25.391	30% ▲	24.792	62% ▲
DLR062022	140,60	3,05	2,2% ▲	9.221	-89% ▼	12.167	35% ▲
DLR072022	145,50	3,60	2,5% ▲	18.305	-40% ▼	14.133	90% ▲
DLR082022	150,50	N/C	N/C	23.284	N/C	10.569	N/C
DLR092022	155,50	6,50	4,4% ▲	45.878	Inf% ▲	11.942	Inf% ▲
PROMEDIO/TOTAL	N/C	1,73	1,2% ▲	10.781.638	-3% ▼	4.297.600	33% ▲

Fuente: Mtr

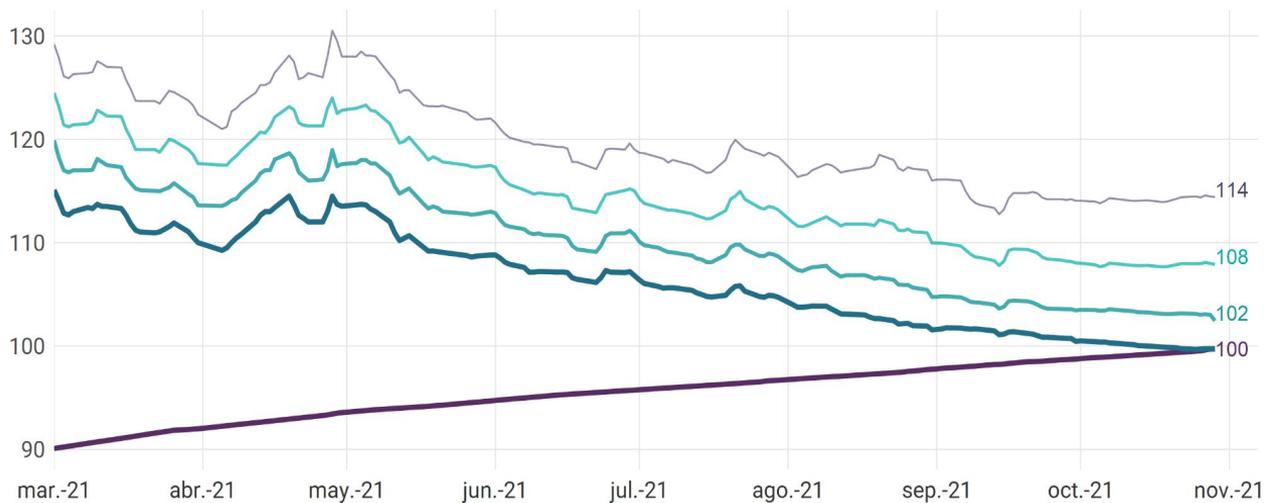
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR102021 DLR112021 DLR122021 DLR012022

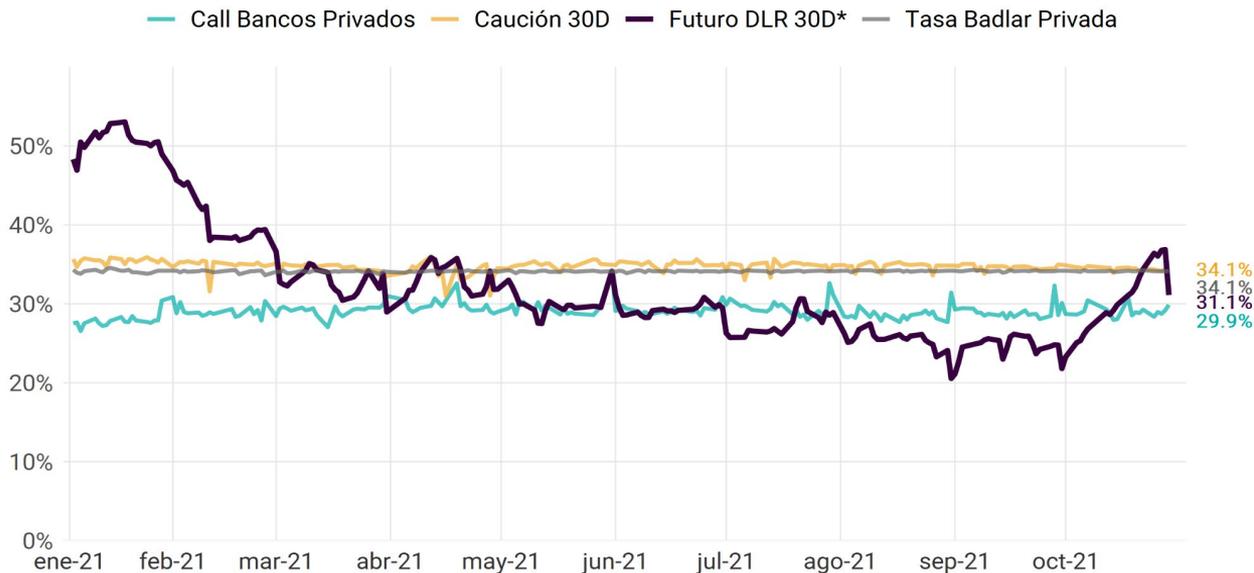


Fuente: MTR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Evolución de Tasas Seleccionadas (TNA)



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

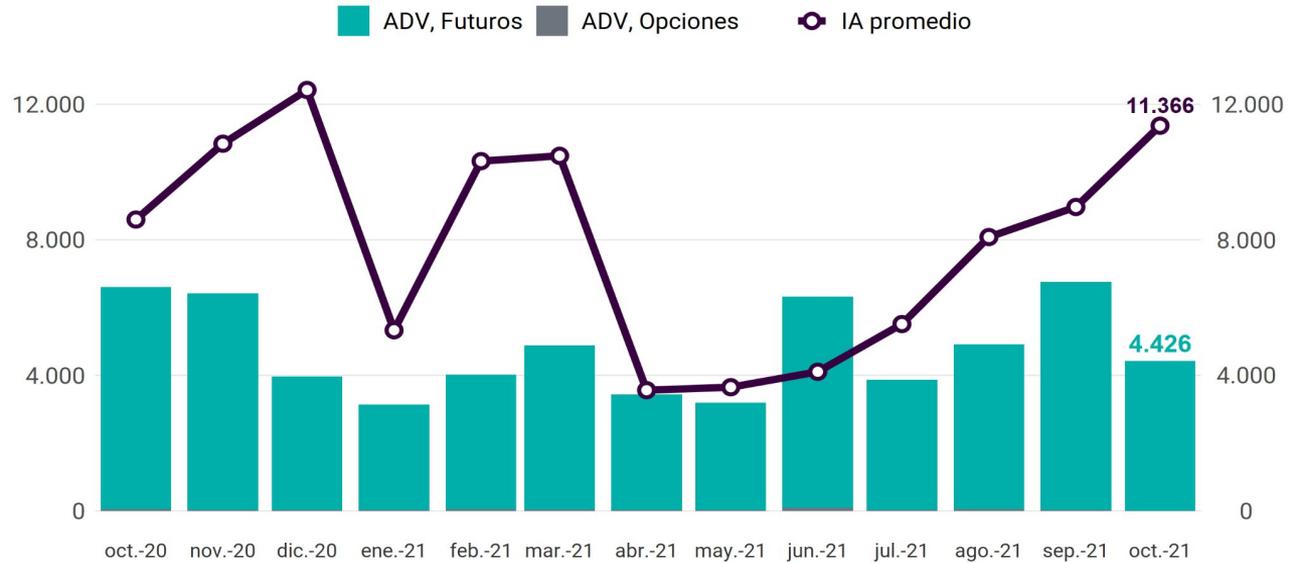
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

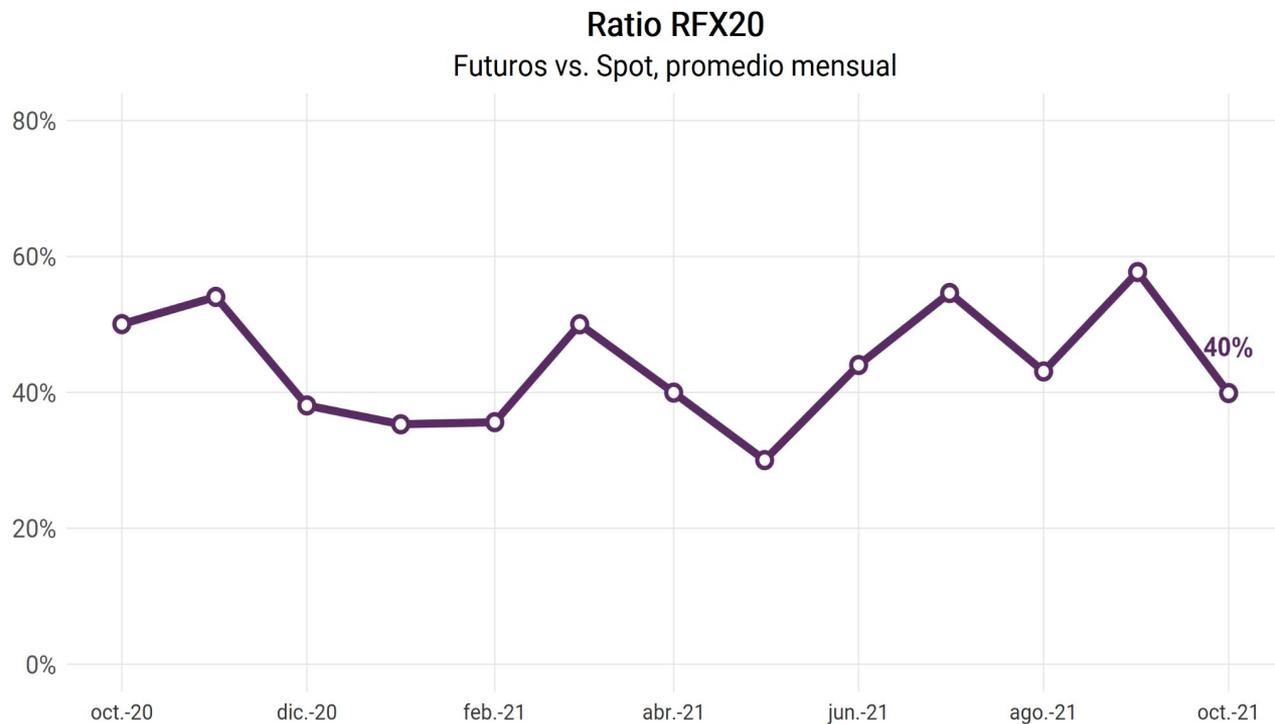


Fuente: Mtr

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



Fuente: Mtr

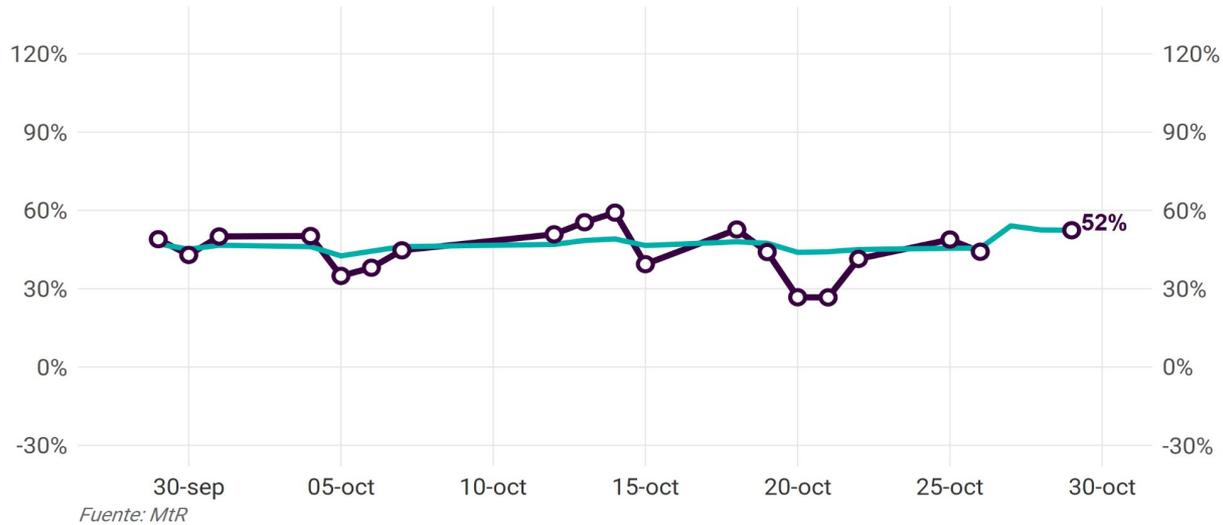
RFX20: Tasas implícitas

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



Principales Índices Accionarios Mundiales

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año

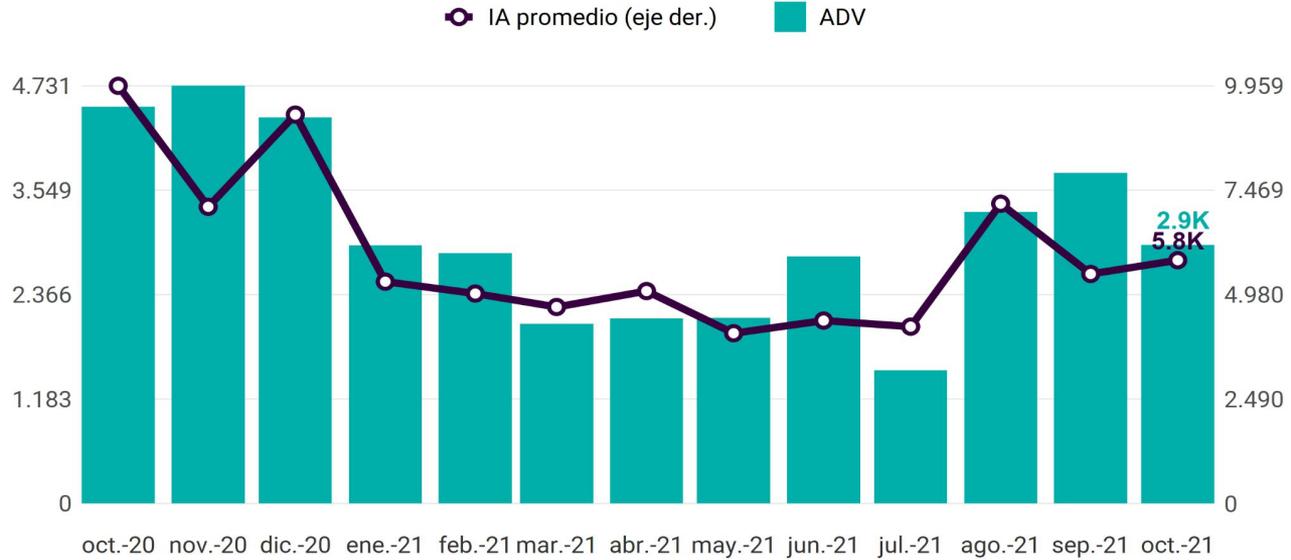


Fuente: MTR y Reuters

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

Futuros de Galicia

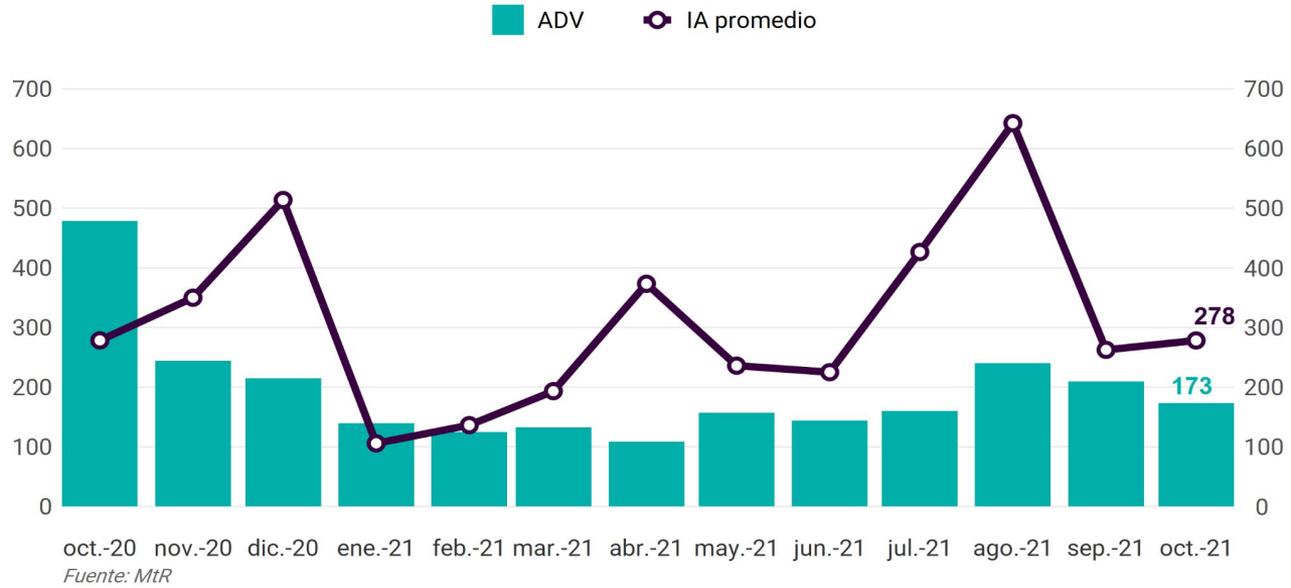
Evolución de la operatoria, en contratos

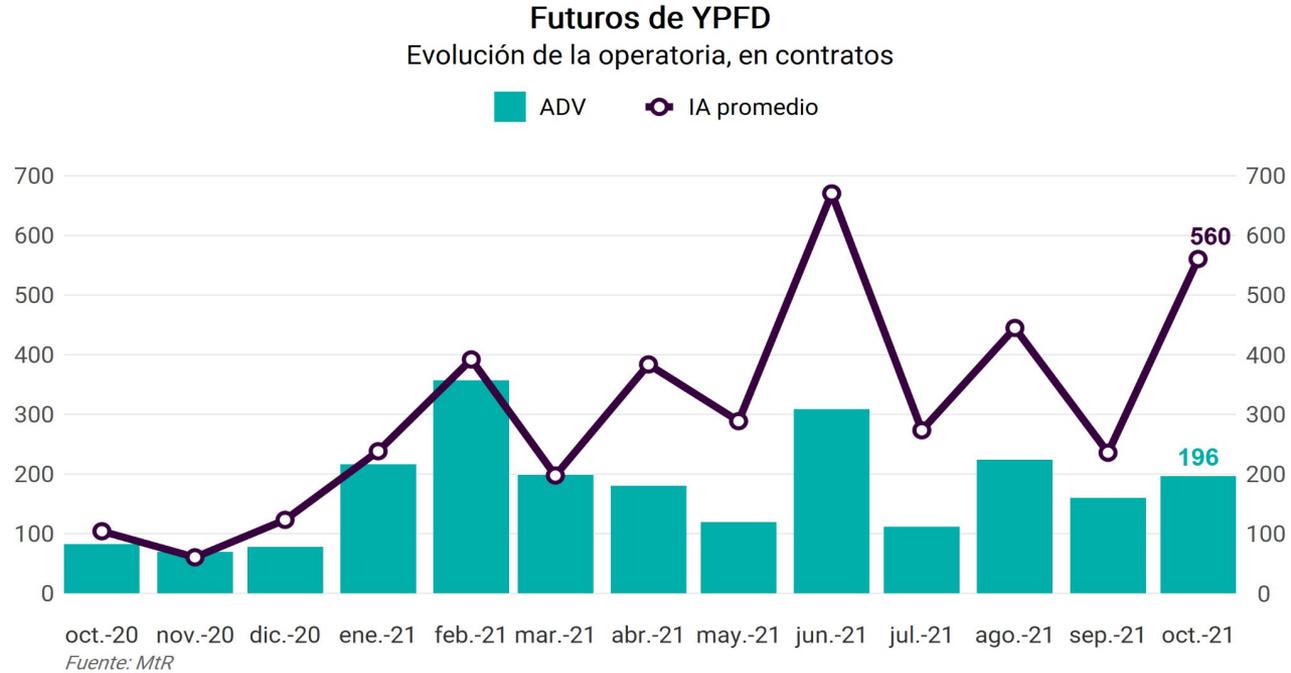


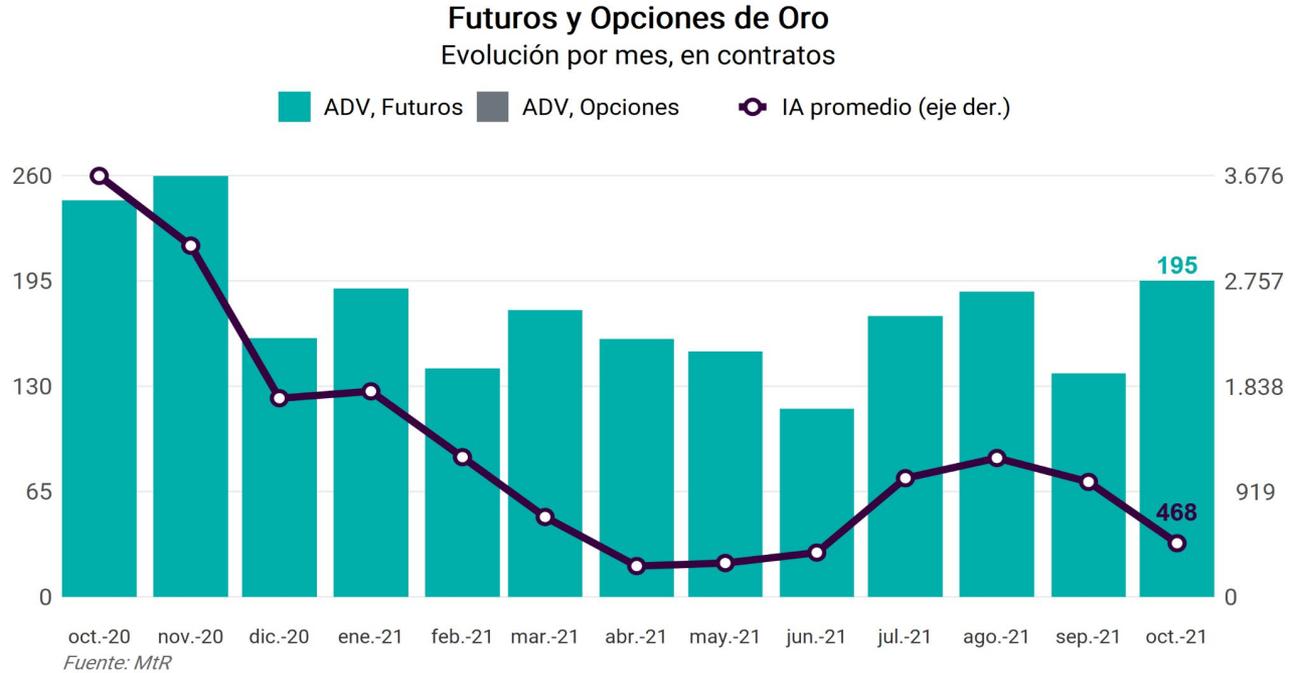
Fuente: Mtr

Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos







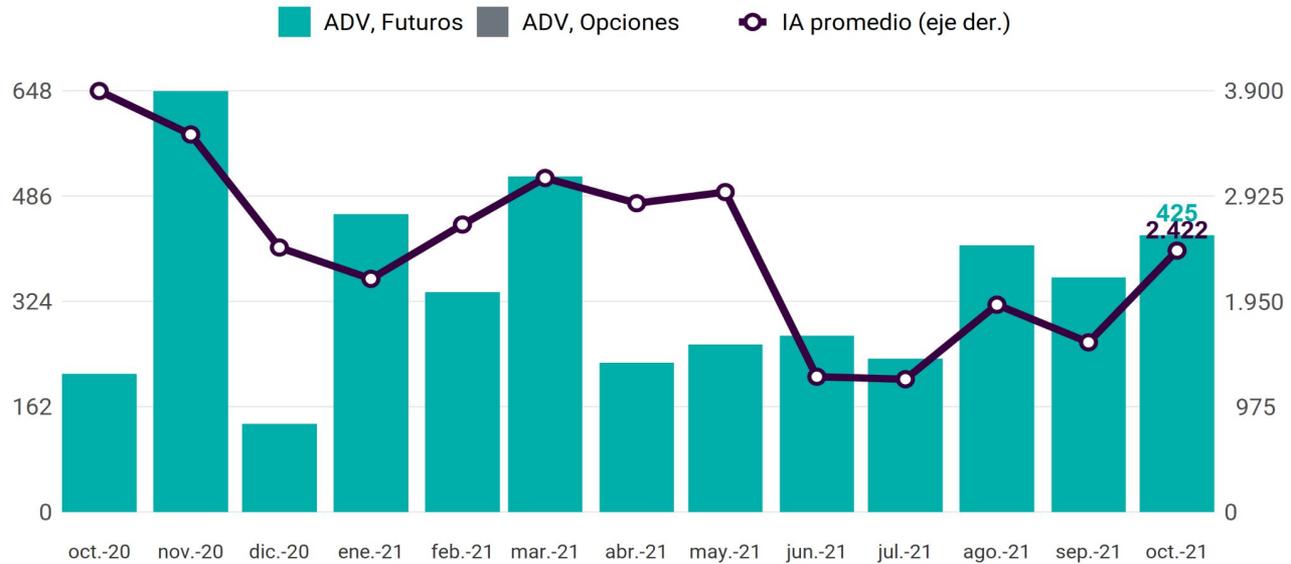
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

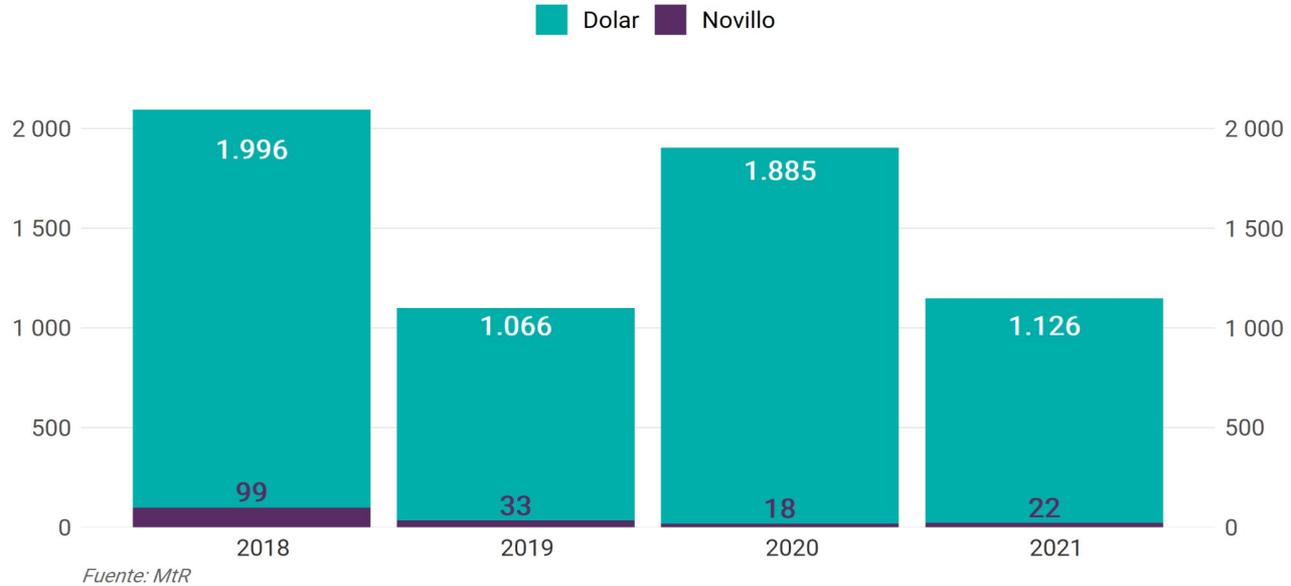
Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Fuente: MtR

Volumen acumulado anual UFEX
Datos hasta octubre 2021, en contratos



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

Valentín Bruzzoni
Analista

Francisco Scognamillo
Analista