

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros

Abril 2023

Highlights del mes

Matba Rofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros excluyendo LEDES alcanzó en abril 19 millones de contratos (+9,4% MoM) y un 52,7% superior a abril de 2022.*
- ✓ *En términos notacionales, el volumen agregado del mes fue de 21.214 millones de dólares (+11,3% MoM y +60,1% YoY).*
- ✓ *En los primeros cuatro meses del año, y excluyendo la operatoria de futuros de LEDES, el volumen operado acumuló 66,7 millones de contratos (51% por encima del mismo período del año anterior), mientras que el interés abierto promedio diario alcanzó 3 millones de contratos (-29% vs. el mismo período del 2022).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de abril 2023, excluyendo LEDES, se ubicó en 3,3 millones de contratos (11,3% MoM y -2,6% YoY).*

Visión General

Matba Rofex

Abril | 2023: Volumen en Contratos

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	18,9M	9,6%	53,4%	3,3M	11,3%	-2,4%
Acciones Individuales	34,6K	-17,4%	-34,2%	2,8K	41,0%	-65,7%
Índices Accionarios	23,8K	0,3%	-29,8%	2,0K	36,8%	-29,4%
Energía	11,3K	-39,1%	-24,2%	996,9	-25,8%	-8,8%
Metales	4,7K	-14,3%	38,9%	1,6K	8,6%	23,9%
Letras del Tesoro	0,0	-100,0%	-100,0%	0,0	-100,0%	-100,0%
Subtotal (sin LEDES)	19,0M	9,4%	52,7%	3,3M	11,3%	-2,6%
Total	19,0M	-35,9%	-30,7%	3,3M	-75,6%	-70,6%

Fuente: MtR

Visión General

Matba Rofex

Abril | 2023: Volumen Nocional

	Volumen Nocional en USD			IA Prom. Diario Nocional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	21.134,9M	11,8%	61,9%	3.733,6M	13,4%	3,3%
Índices Accionarios	43,3M	7,1%	18,3%	3,5M	47,9%	17,2%
Acciones Individuales	17,3M	-33,6%	50,0%	2,6M	33,5%	38,6%
Metales	9,6M	-10,4%	44,3%	3,2M	13,5%	29,1%
Energía	8,9M	-33,7%	-40,4%	791,8K	-18,3%	-28,1%
Letras del Tesoro	0,0	-100,0%	-100,0%	0,0	-100,0%	-100,0%
Total	21.214,0M	11,3%	60,1%	3.743,8M	11,9%	1,5%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2023: Volumen en Contratos

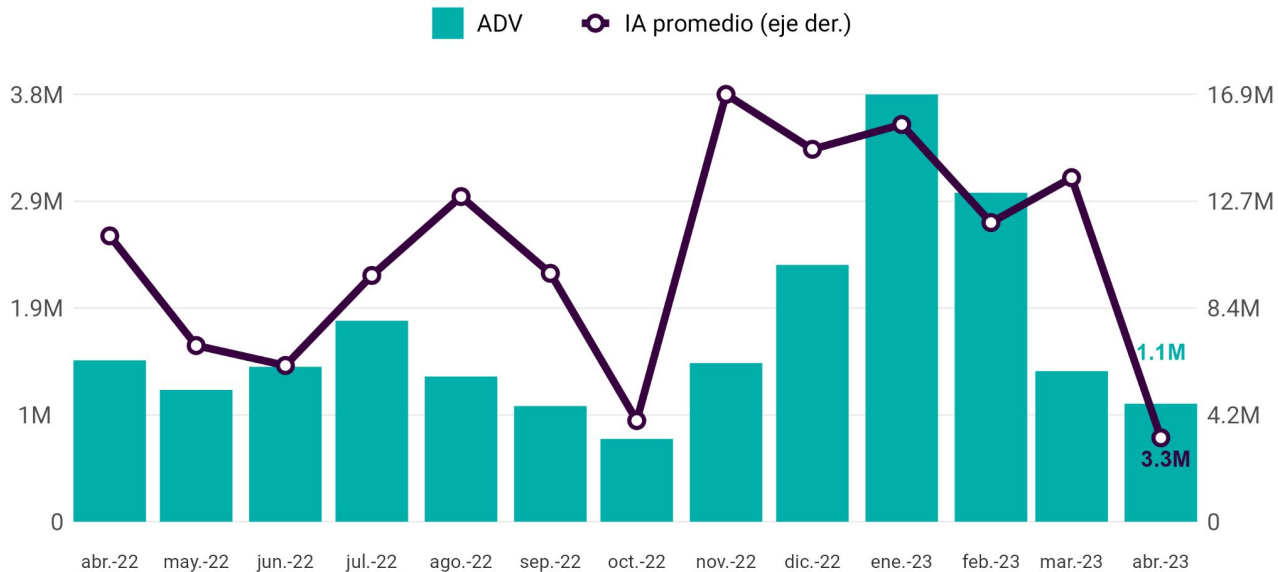
	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2023	2022	Var%	2023	2022	Var%
Letras del Tesoro	119,2M	25,0M	377%	8,4M	3,5M	140%
Monedas	66,4M	43,7M	52%	3,0M	4,2M	-29%
Acciones Individuales	175,3K	257,3K	-32%	3,3K	6,3K	-48%
Índices Accionarios	101,1K	157,9K	-36%	1,5K	3,1K	-50%
Energía	56,1K	74,9K	-25%	1,2K	2,2K	-47%
Metales	18,2K	18,5K	-2%	1,4K	1,2K	19%
Subtotal (sin LEDES)	66,7M	44,2M	51%	3,0M	4,3M	-29%
Total	185,9M	69,2M	169%	11,5M	7,8M	48%

*En contratos, datos acumulados al 30/04 de cada año

Fuente: MtR

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos



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

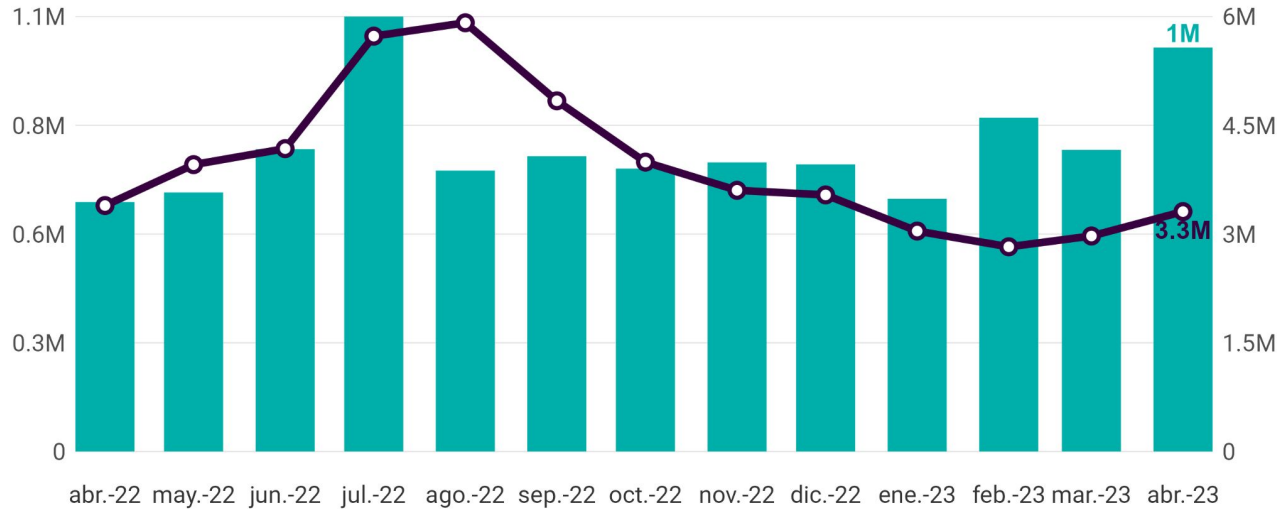
Dólar: Operatoria

Futuros y Opciones

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

■ ADV ○ IA promedio (eje der.)

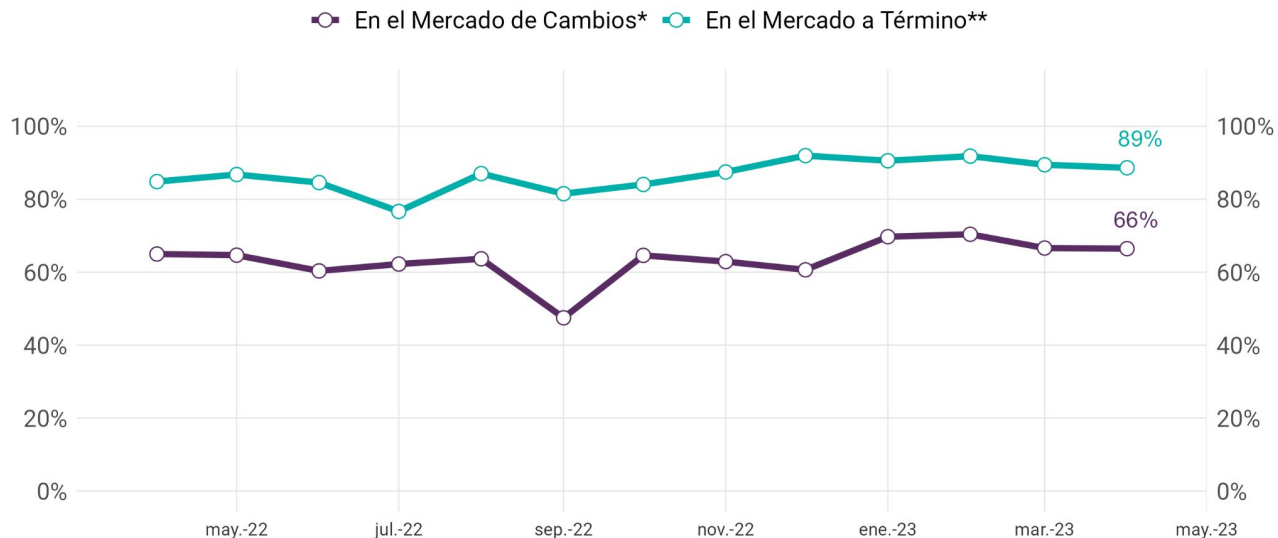


Fuente: MtR

Dólar: Market Share

Mercado de Cambios

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 30/04			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR042023	222,57	-2,93	-1,3% ▼	8.635.796	105% ▲	0	-100% ▼
DLR052023	242,85	-3,05	-1,2% ▼	6.879.186	269% ▲	2.504.393	367% ▲
DLR062023	271,30	5,95	2,2% ▲	1.731.262	101% ▲	460.320	145% ▲
DLR072023	301,00	15,75	5,5% ▲	1.079.342	129% ▲	289.611	130% ▲
DLR082023	359,00	47,00	15,1% ▲	378.936	121% ▲	79.347	31% ▲
DLR092023	399,60	62,60	18,6% ▲	84.757	42% ▲	48.335	72% ▲
DLR102023	439,90	76,90	21,2% ▲	85.855	415% ▲	28.020	92% ▲
DLR112023	480,00	90,00	23,1% ▲	41.168	135% ▲	23.080	38% ▲
DLR122023	521,00	98,00	23,2% ▲	11.276	66% ▲	8.306	61% ▲
DLR012024	568,00	118,00	26,2% ▲	4.894	2% ▲	4.994	35% ▲
DLR022024	608,00	127,05	26,4% ▲	5.186	-25% ▼	6.021	19% ▲
DLR032024	645,00	N/C	N/C	4.457	N/C	3.684	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	57,75	14,4% ▲	18.942.115	10% ▲	3.456.111	41% ▲

Fuente: Mtr

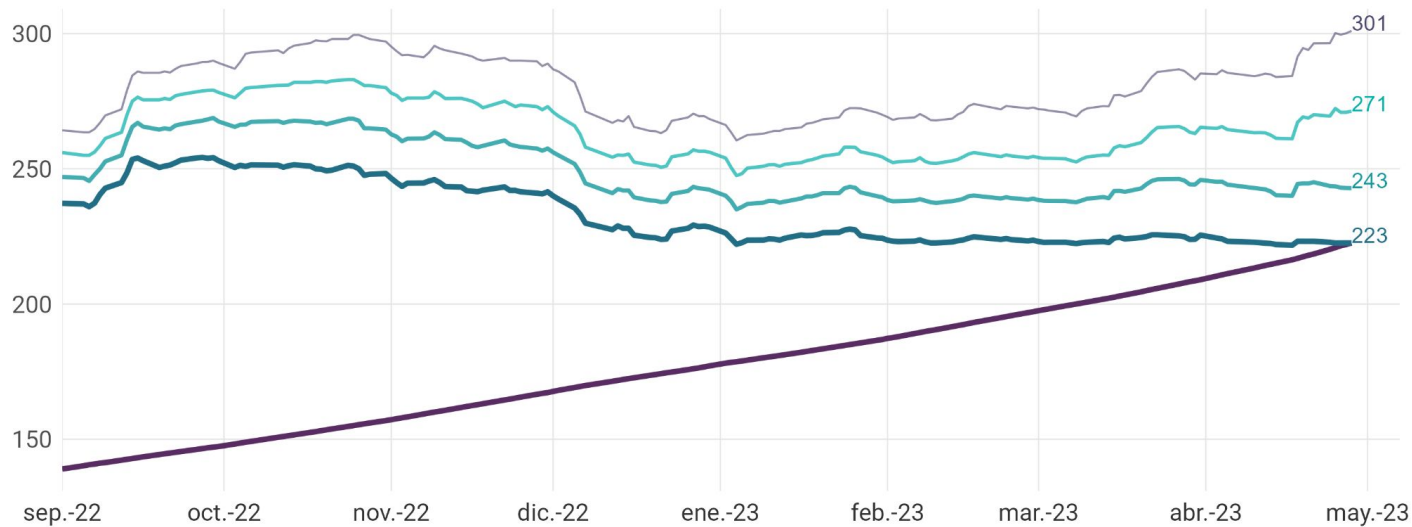
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR042023 DLR052023 DLR062023 DLR072023



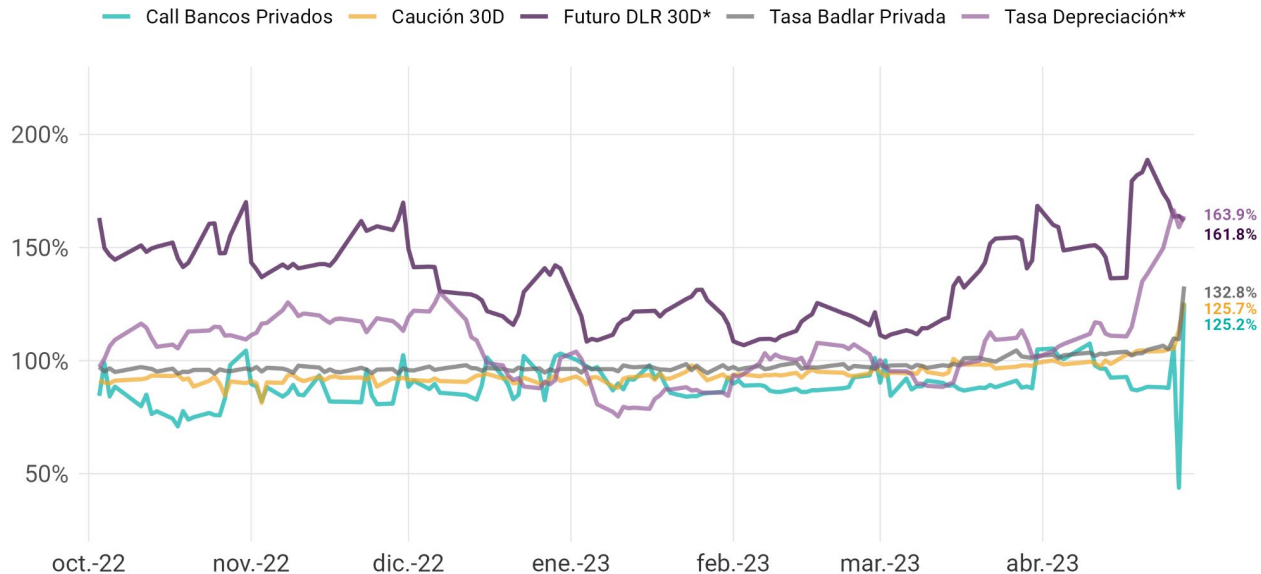
Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

MatbaRofex

Tasas Efectivas Anuales (TEA)



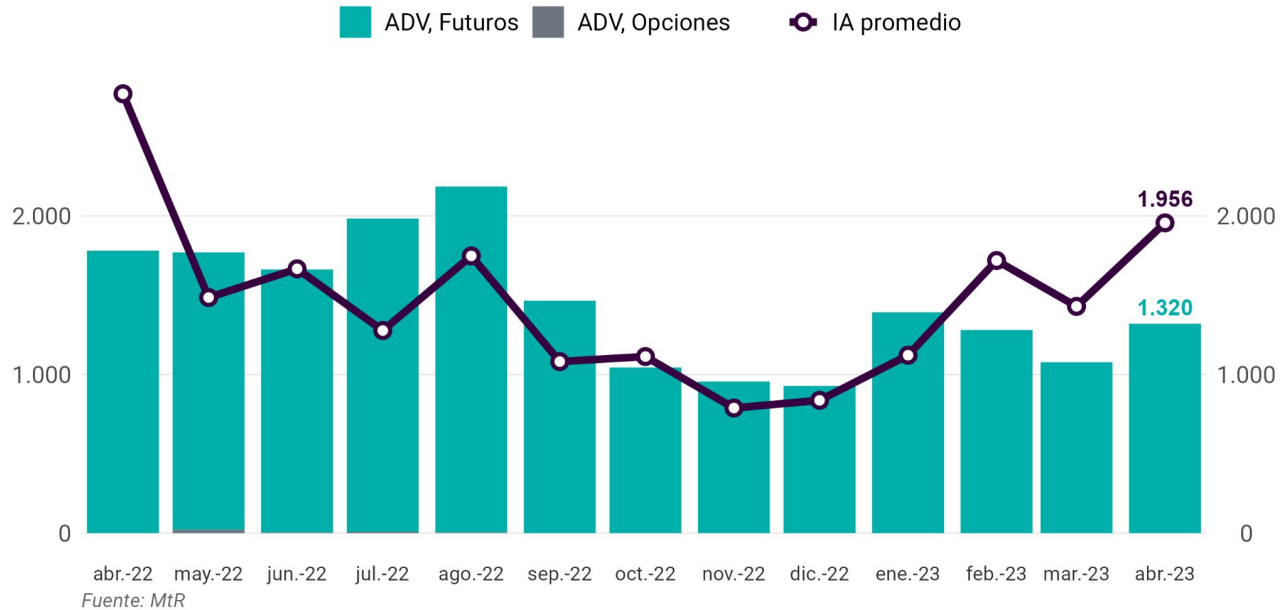
*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días

**Tasa de depreciación del tipo de cambio A3500 spot, media móvil de 5 periodos

Fuente: MtR y Reuters

Futuros y Opciones de RFX20

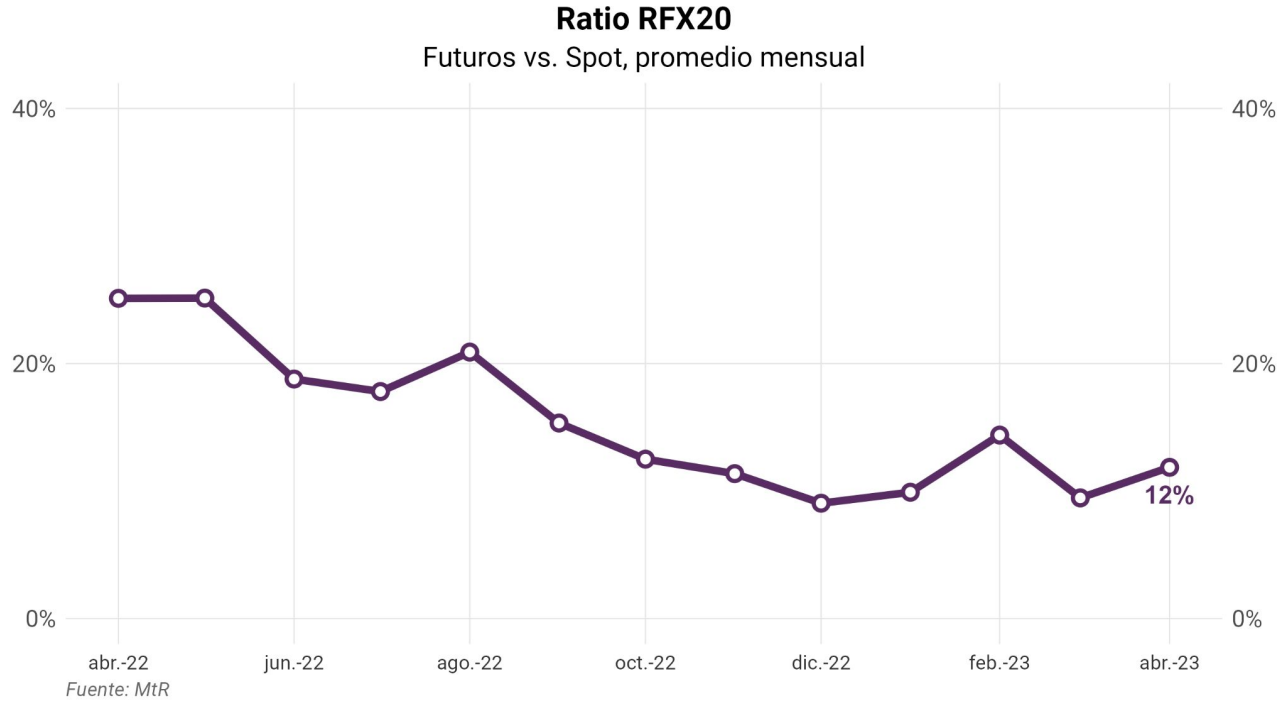
Evolución por mes, en contratos



RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex

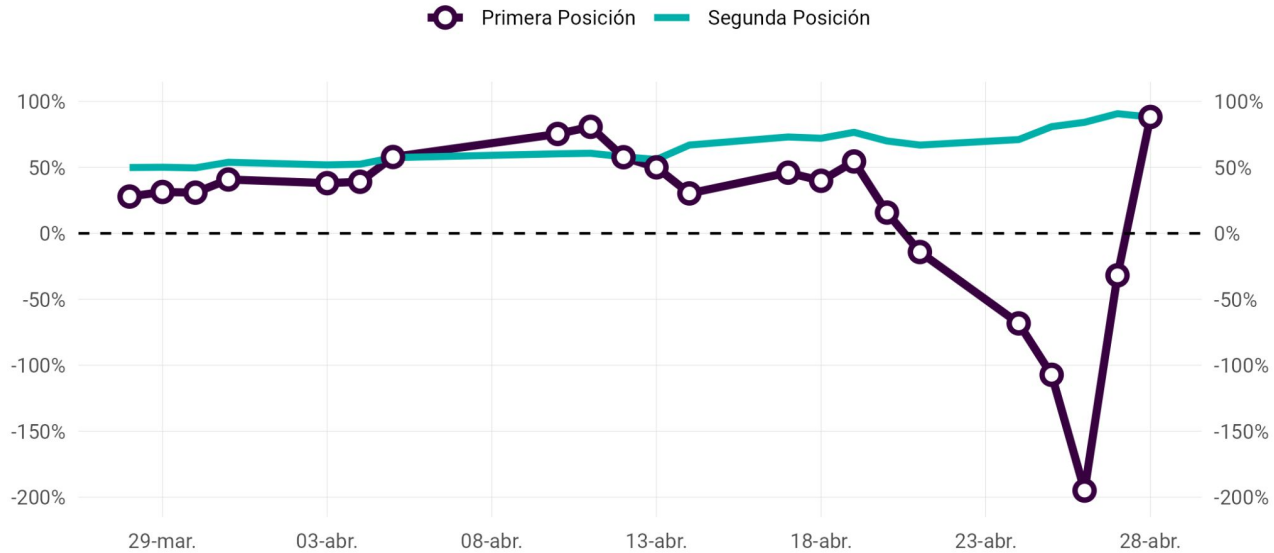


RFX20: Tasas implícitas

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

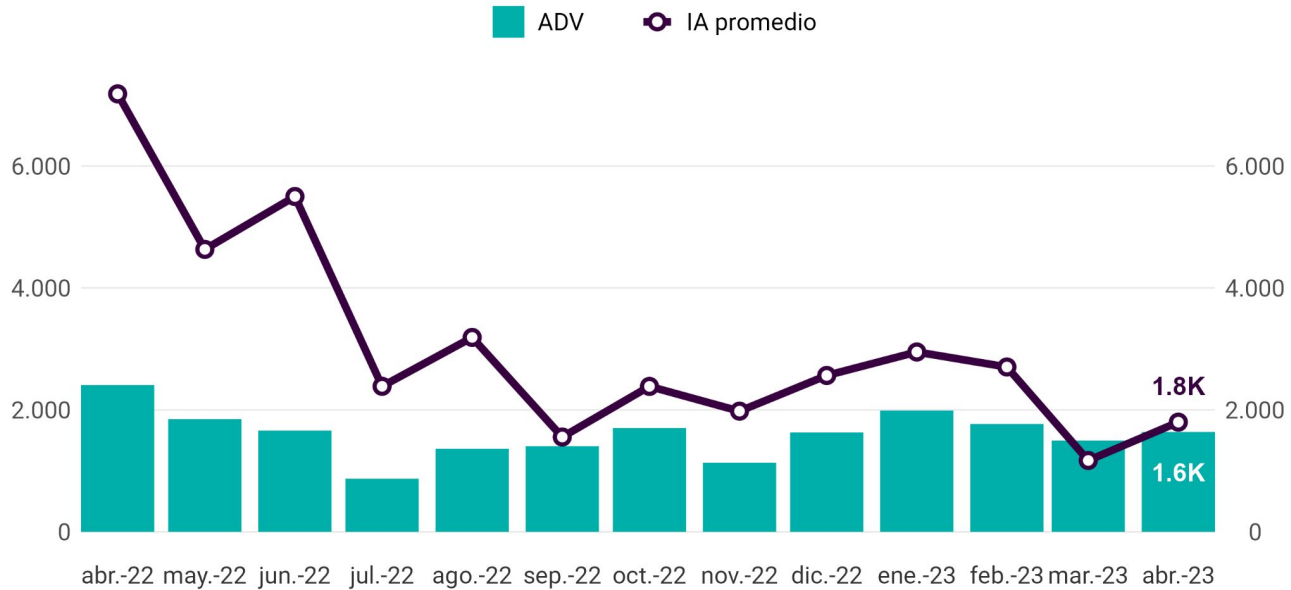


Fuente: MtR y Reuters

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

Futuros de Galicia

Evolución de la operatoria, en contratos

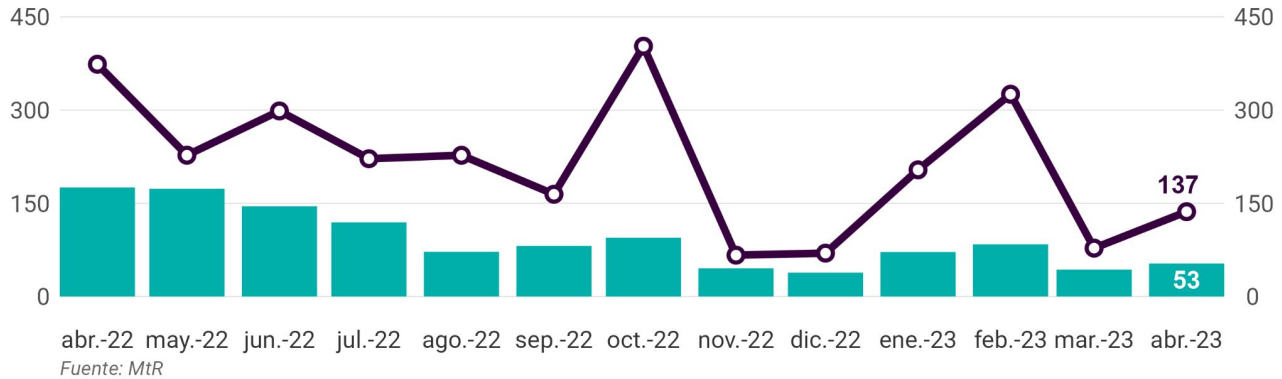


Fuente: MtR

Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos

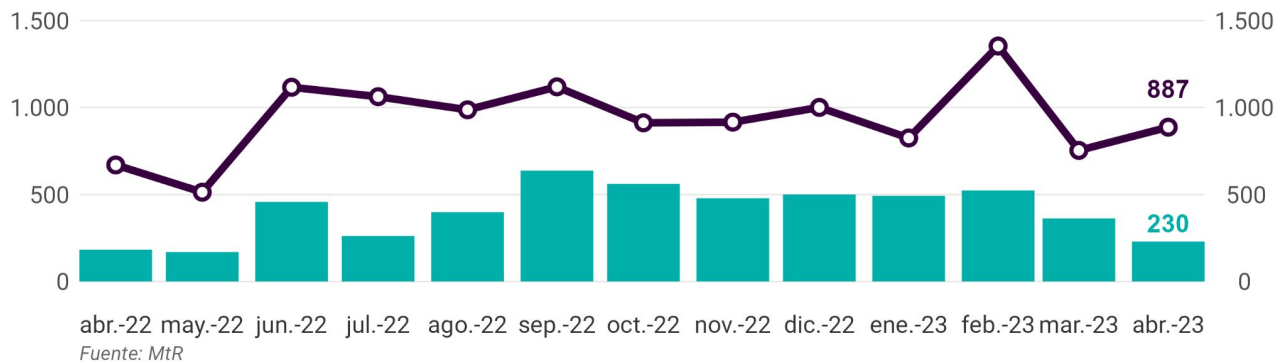
■ ADV ○ IA promedio

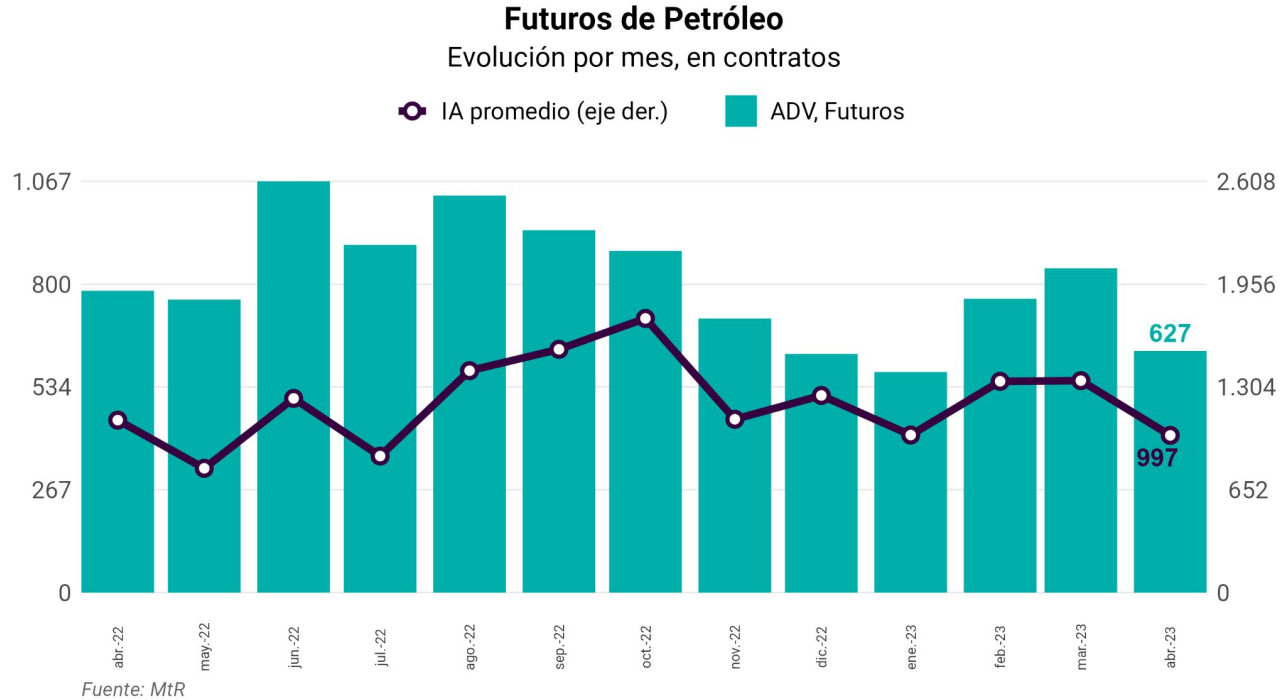


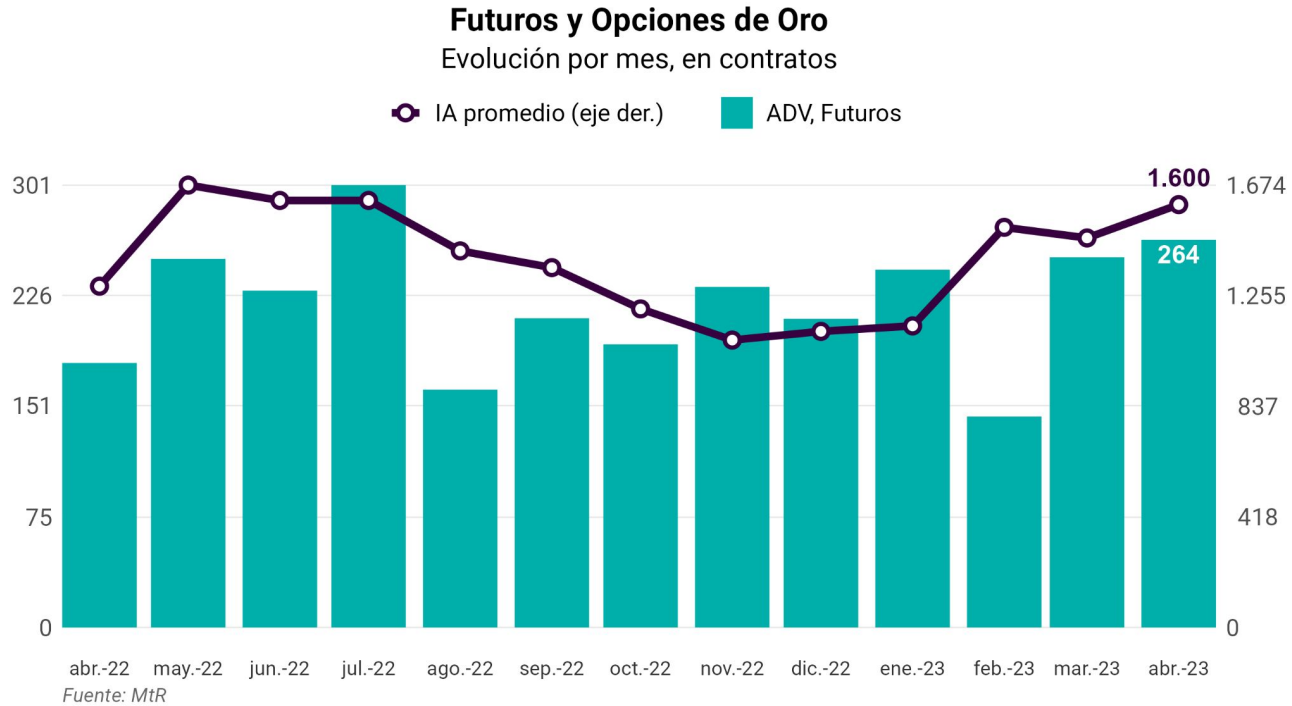
Futuros de YFPD

Evolución de la operatoria, en contratos

■ ADV ○ IA promedio







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 Najjar
Analista

Lucía Madoery
Analista

Aarón Hierrezuelo
Analista