

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Octubre 2023

Highlights del mes

Matba Rofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en octubre 23,2 millones de contratos (+94% MoM) y un 62,6% superior a octubre de 2022.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de octubre 2023, se ubicó en 4,1 millones de contratos (+23,4% MoM y +2% YoY).*
- ✓ *En términos notacionales, el volumen agregado del mes fue de 29.378,9 millones de dólares oficiales (+113,4% MoM y +89,2% YoY).*
- ✓ *En el acumulado del 2023, y excluyendo la operatoria de futuros de Letras del Tesoro, el volumen operado fue de 170,3 millones de contratos (16% por encima del mismo período del año anterior), mientras que el interés abierto promedio diario alcanzó 3,5 millones de contratos (-24% vs. el mismo periodo del año anterior).*

Visión General

Octubre | 2023: Volumen en Contratos

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	23,0M	97,1%	64,2%	4,1M	23,5%	2,0%
Índices Accionarios	151,7K	-34,8%	-23,5%	12,7K	-4,4%	14,3%
Acciones Individuales	36,9K	-21,5%	-17,5%	5,4K	29,6%	46,4%
Energía	18,3K	41,0%	8,8%	1,2K	10,1%	-31,7%
Metales	4,1K	15,2%	12,4%	827,0	3,6%	-31,4%
Criptomonedas	369,0	-50,5%	N/C	119,7	-36,6%	N/C
Total	23,2M	94,0%	62,6%	4,1M	23,4%	2,0%

Nota 1: En el mes de octubre de ambos años no hubo operatoria de LEDES.

Nota 2: Debido al cambio de base del índice ROFEX20 que entró en vigencia el 9/10, los valores previos se multiplicaron por 10 para mantener la comparación homogénea en este producto

Fuente: MtR

Visión General

Octubre | 2023: Volumen Nocial en USD

Matba Rofex

	Volumen Nocial en USD			IA Prom. Diario Nocial en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	29.284,3M	114,5%	89,4%	5.071,1M	28,4%	14,4%
Índices Accionarios	39,4M	-34,7%	51,9%	3,6M	4,6%	147,4%
Acciones Individuales	31,5M	0,9%	45,4%	5,1M	19,8%	173,3%
Energía	15,4M	34,3%	6,5%	995,2K	4,5%	-33,1%
Metales	8,0M	16,0%	30,0%	1,6M	4,6%	-20,1%
Criptomonedas	354,6K	-20,4%	N/C	104,2K	-8,5%	N/C
Total	29.378,9M	113,4%	89,2%	5.082,4M	28,4%	14,4%

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Fuente: MtR

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2023: Volumen en Contratos

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2023	2022	Var%	2023	2022	Var%
Monedas	167,3M	143,0M	17%	3,5M	4,6M	-24%
Acciones Individuales	424,4K	502,4K	-16%	3,4K	5,2K	-34%
Índices Accionarios	2,3M	3,7M	-36%	14,3K	20,5K	-30%
Energía	154,2K	189,7K	-19%	1,2K	1,6K	-29%
Metales	41,8K	46,1K	-9%	1,1K	1,4K	-17%
Criptomonedas	2,9K	0,0	N/C	147,1	0,0	N/C
Letras del Tesoro	119,2M	78,7M	51%	3,3M	3,6M	-7%
Subtotal (sin LEDES)	170,3M	147,4M	16%	3,5M	4,6M	-24%
Total	289,5M	226,1M	28%	6,8M	8,2M	-16%

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

Nota 1: Debido al cambio de base del índice ROFEX20 que entró en vigencia el 9/10, los valores previos se multiplicaron por 10 para mantener la comparación homogénea en este producto

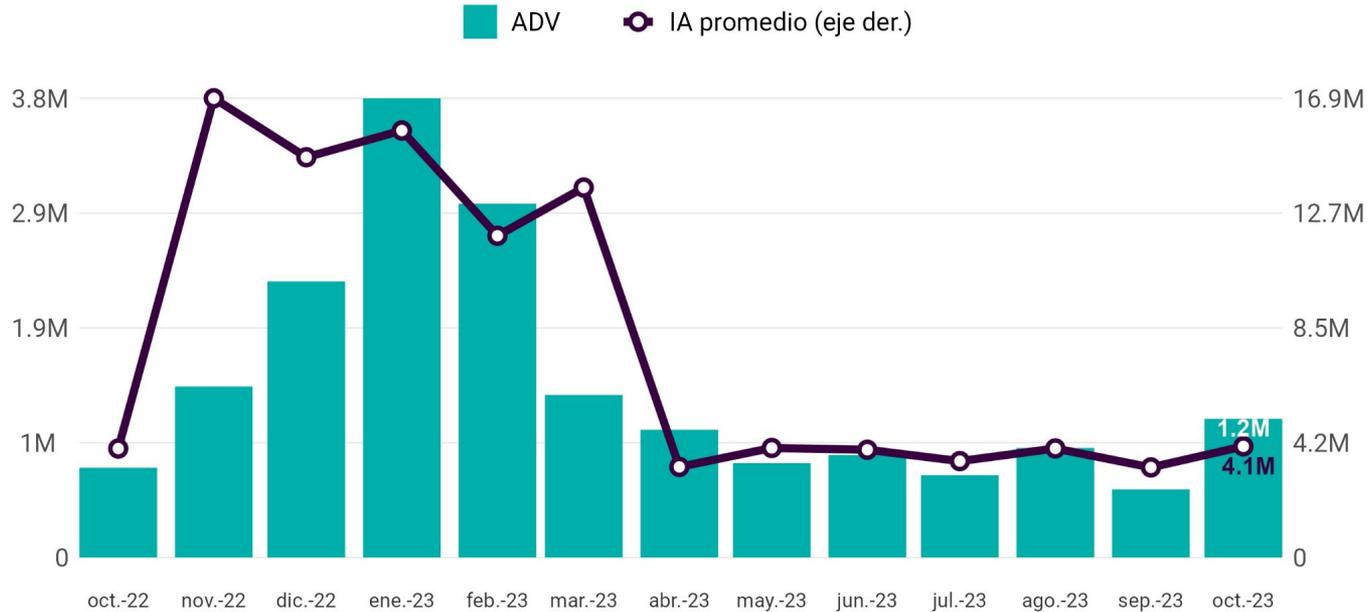
Fuente: MtR

Visión General

Volumen Histórico de FyO

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

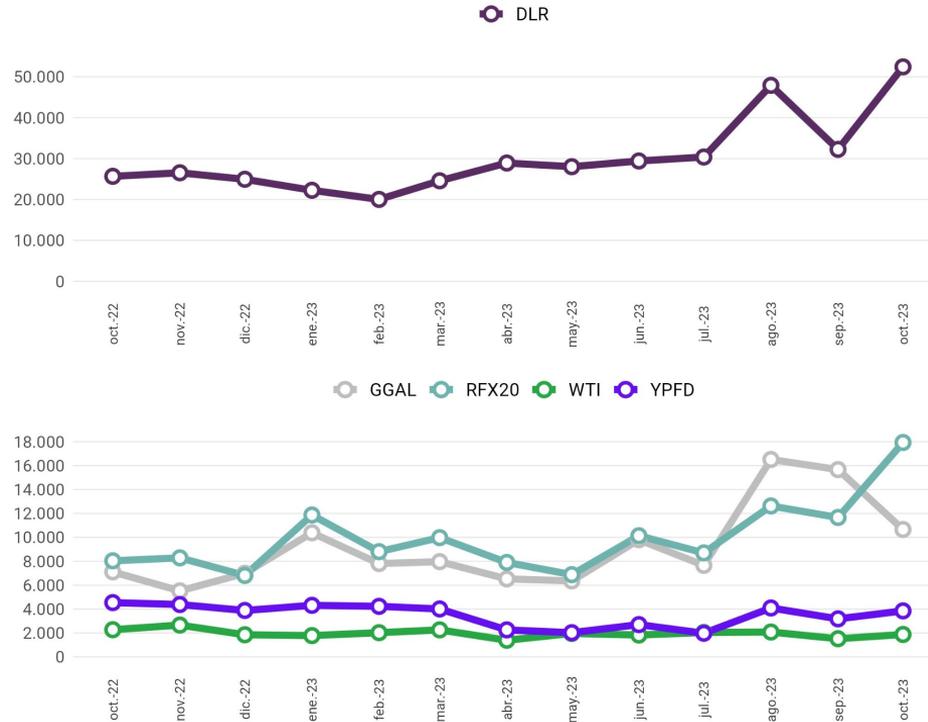


Nota: Se incluye la operatoria de Letras del Tesoro
Fuente: MTR

Visión General

Cantidad de Trades

Cantidad de trades por producto
De los 5 productos con mayor cantidad de trades en el último mes

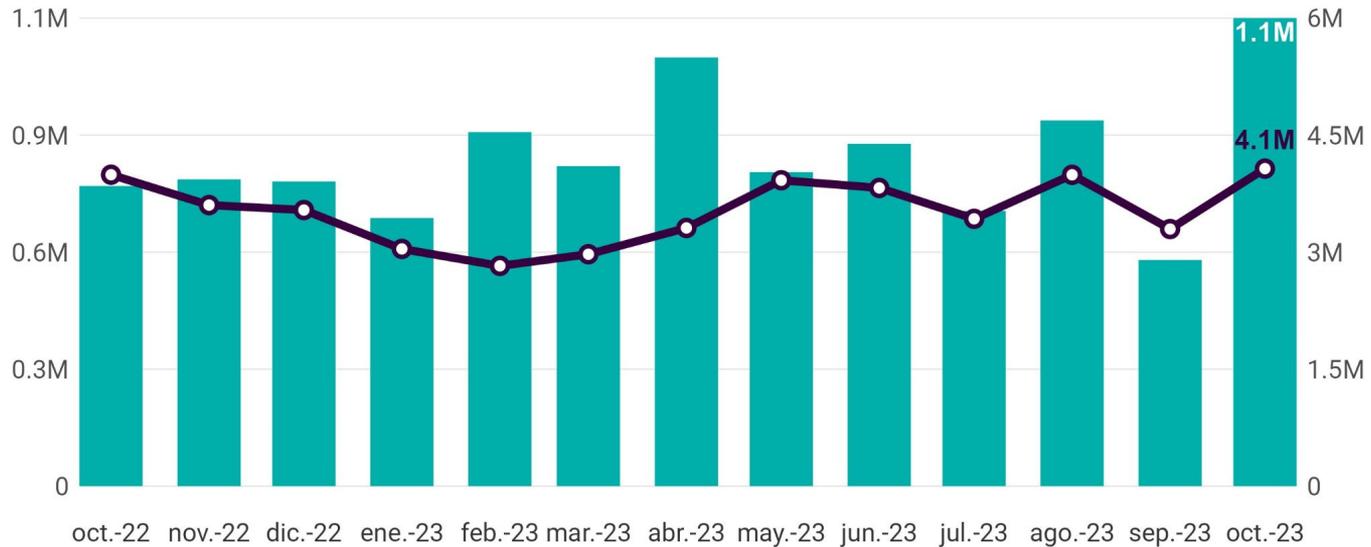


Fuente: Matba Rofex

Futuros y Opciones de Dólar

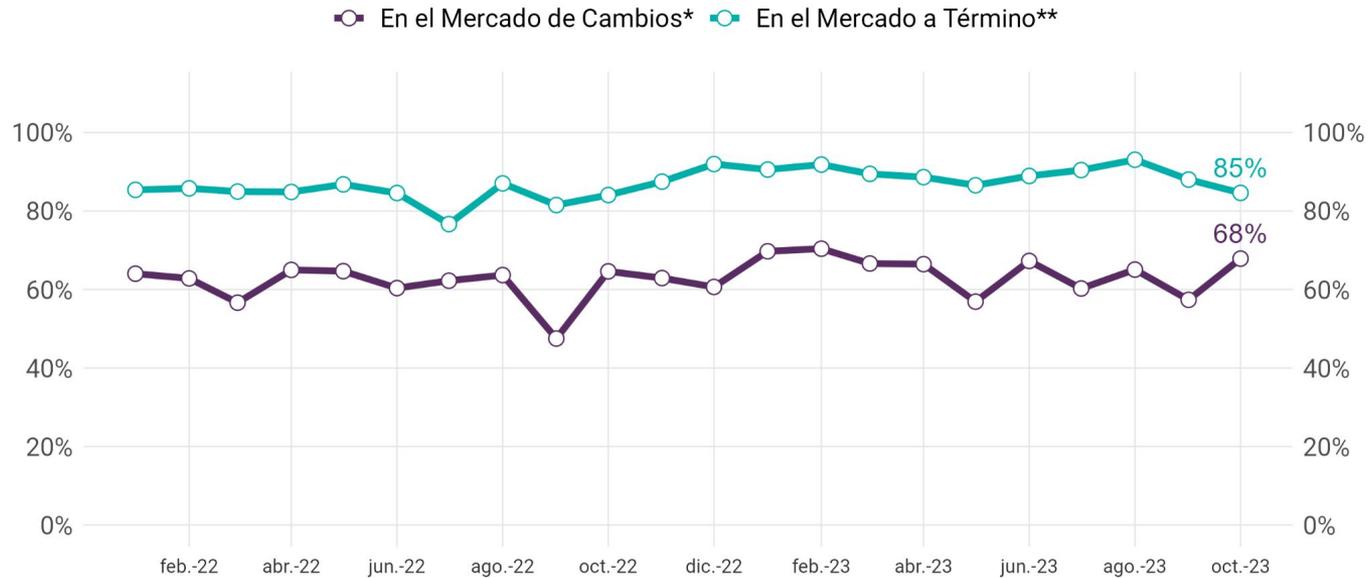
Evolución por mes, en contratos

■ ADV ○ IA promedio (eje der.)



Fuente: MtR

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.%
DLR102023	350,01	-35,99	-9,3% ▼	10.762.371	212% ▲	0	-100% ▼
DLR112023	407,30	-103,70	-20,3% ▼	9.309.976	606% ▲	2.079.973	441% ▲
DLR122023	617,00	-65,00	-9,5% ▼	2.029.834	301% ▲	321.815	41% ▲
DLR012024	720,00	-70,00	-8,9% ▼	392.195	78% ▲	67.098	23% ▲
DLR022024	824,00	-49,00	-5,6% ▼	313.468	258% ▲	31.674	-31% ▼
DLR032024	900,00	-50,00	-5,3% ▼	67.243	286% ▲	27.258	23% ▲
DLR042024	984,00	-36,00	-3,5% ▼	70.943	201% ▲	27.828	-25% ▼
DLR052024	1.070,00	13,00	1,2% ▲	17.931	26% ▲	24.900	-5% ▼
DLR062024	1.130,00	43,00	4,0% ▲	10.322	14% ▲	7.649	-13% ▼
DLR072024	1.215,00	97,20	8,7% ▲	5.530	29% ▲	5.655	-1% ▼
DLR082024	1.265,00	115,00	10,0% ▲	1.770	256% ▲	917	169% ▲
DLR092024	1.315,00	N/C	N/C	11	N/C	11	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	-12,86	-3,5% ▼	22.981.594	97% ▲	2.594.778	8% ▲

Fuente: MtR

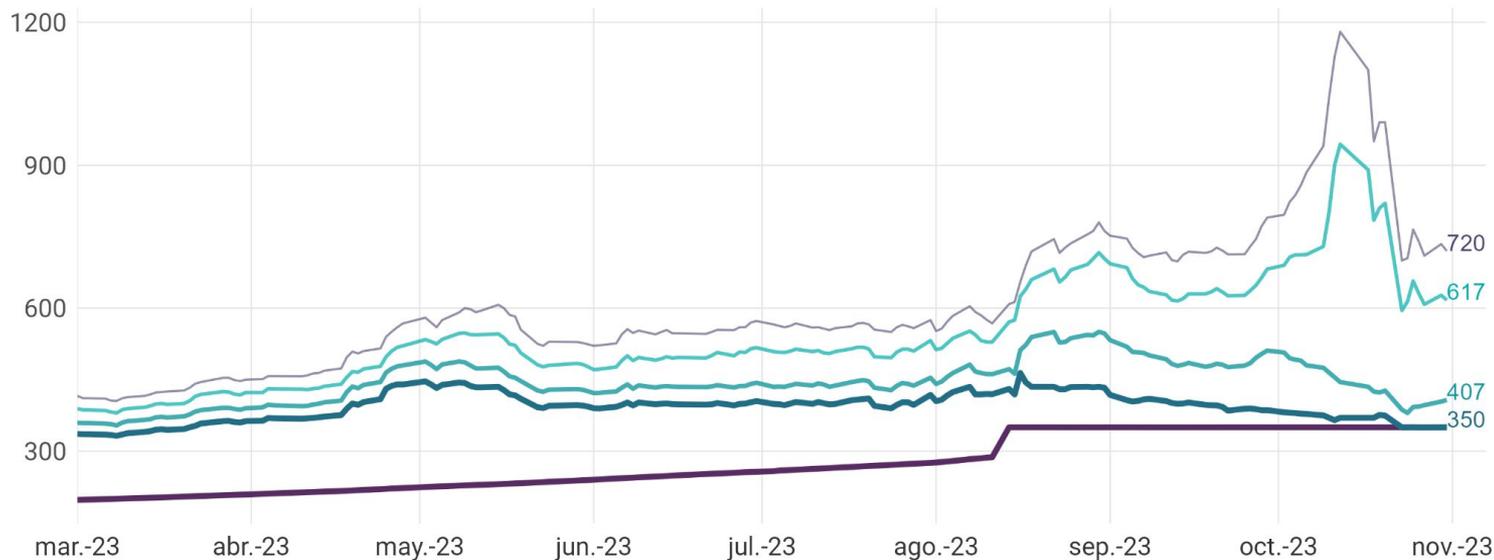
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

— Spot — DLR102023 — DLR112023 — DLR122023 — DLR012024

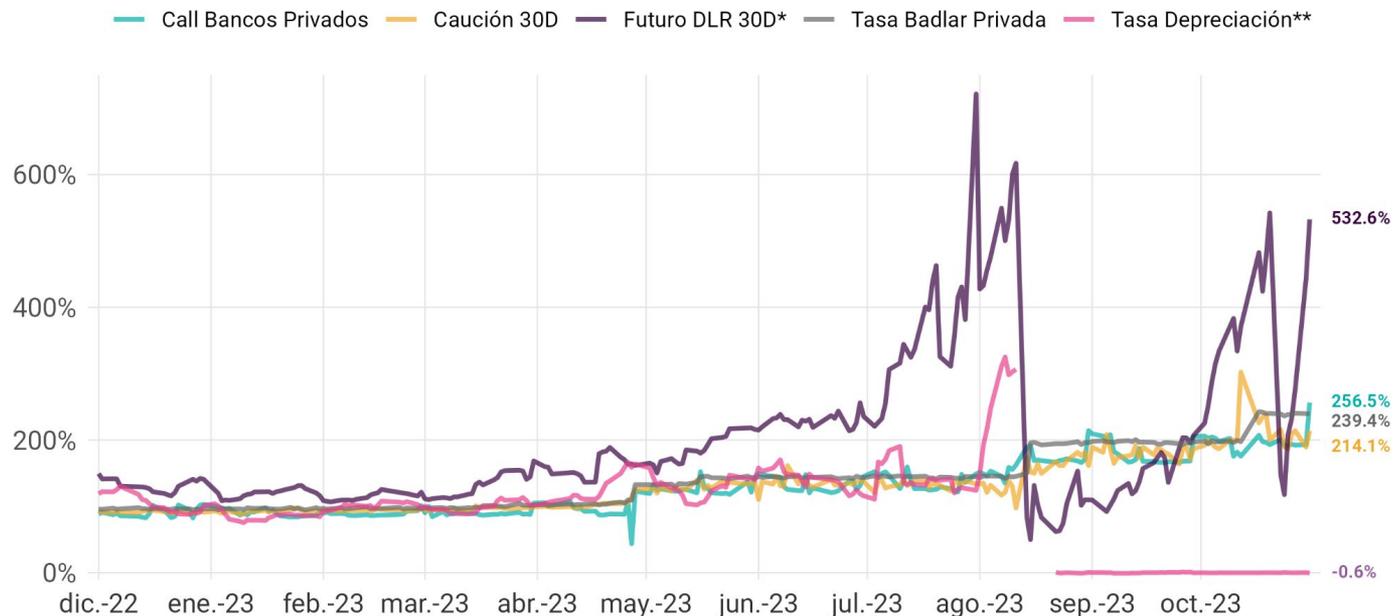


Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Tasas Efectivas Anuales (TEA)



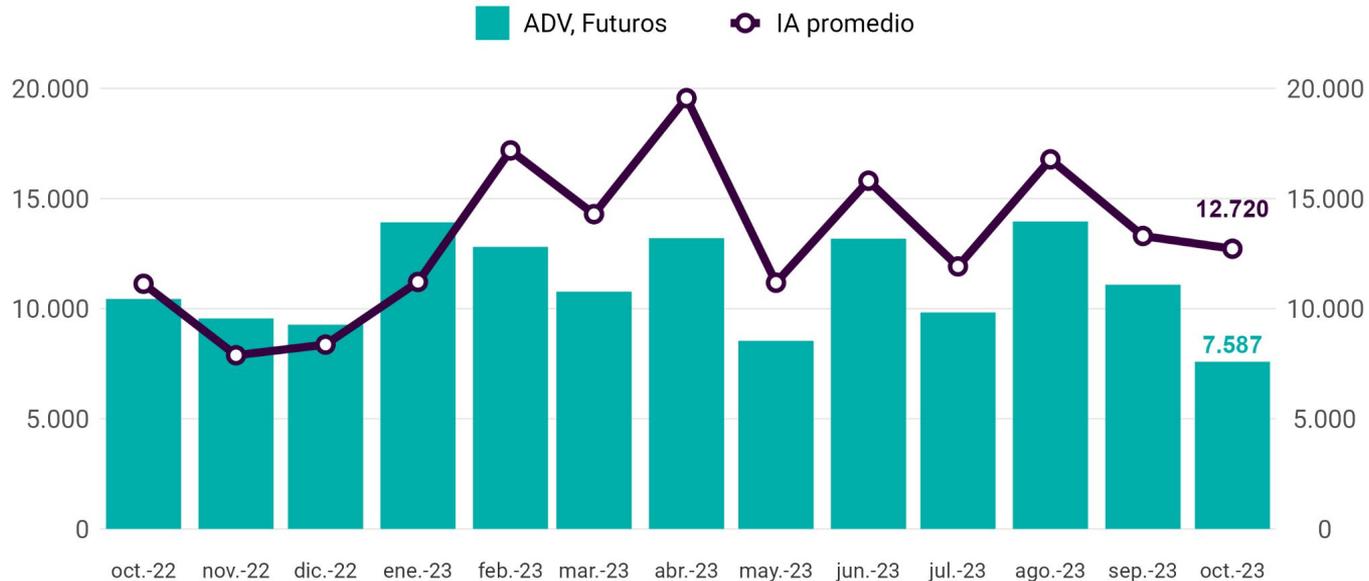
*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días

**Tasa de depreciación del tipo de cambio A3500 spot, media móvil de 5 períodos. Se excluyó el dato de la TEA entre 14/08 y 18/08 dado de la devaluación del 22% en un día eleva la TEA a tal punto de distorsionar el gráfico

Fuente: MTR y Reuters

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos



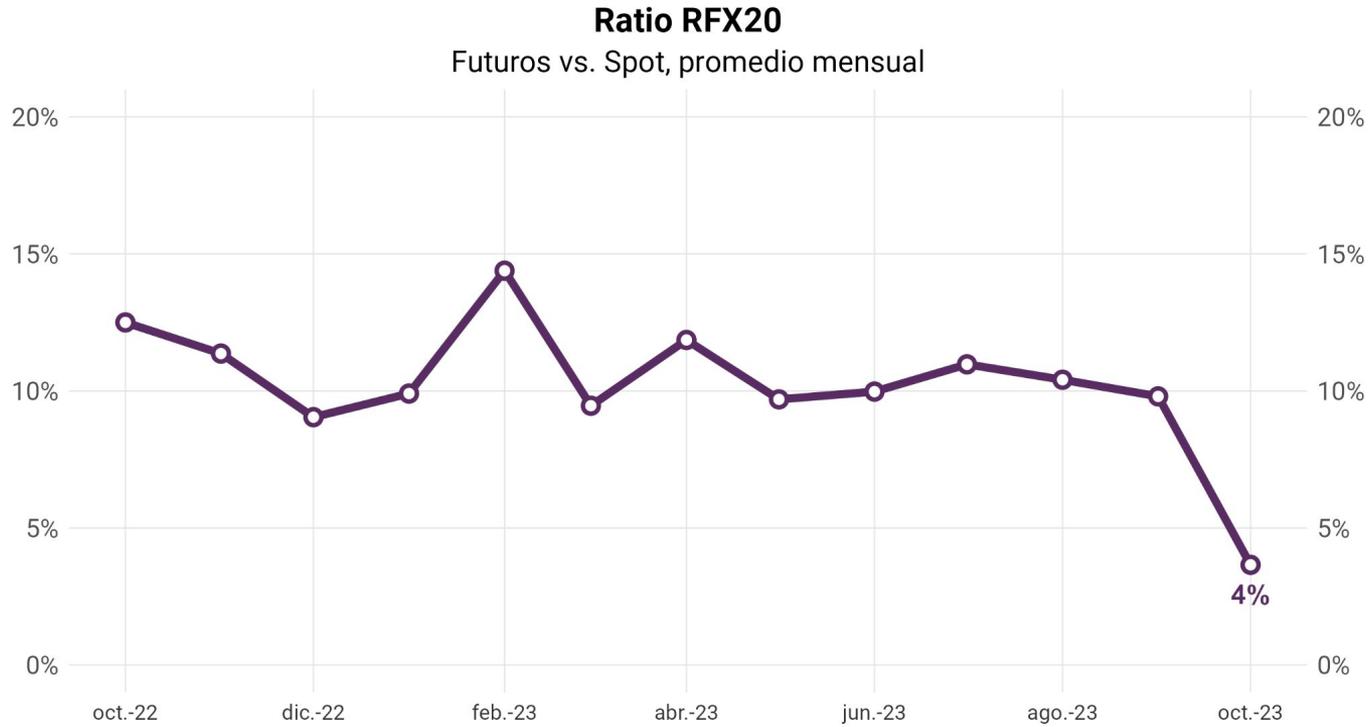
Fuente: MtR

Nota: Debido al cambio de base del Índice ROFEX20 que entró en vigencia el 9/10 los valores anteriores se multiplicaron por 10 para mantener la comparación homogénea en este producto

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



Fuente: MtR

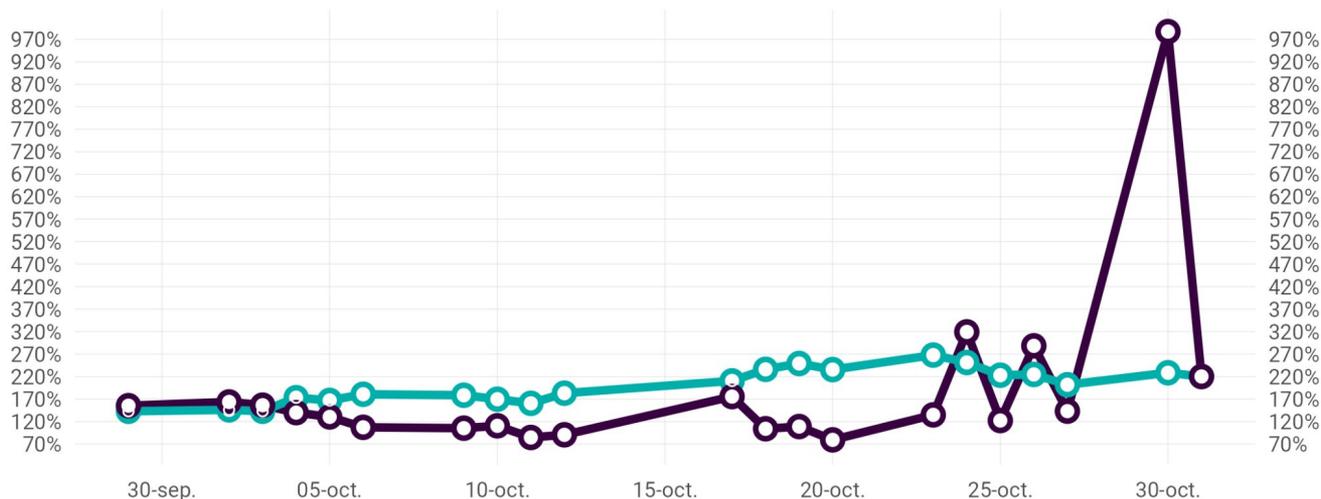
RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

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

● Primera Posición ● Segunda Posición



Fuente: Matba Rofex

Evolución de Índices Accionarios Seleccionados

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



Fuente: MtR y Reuters

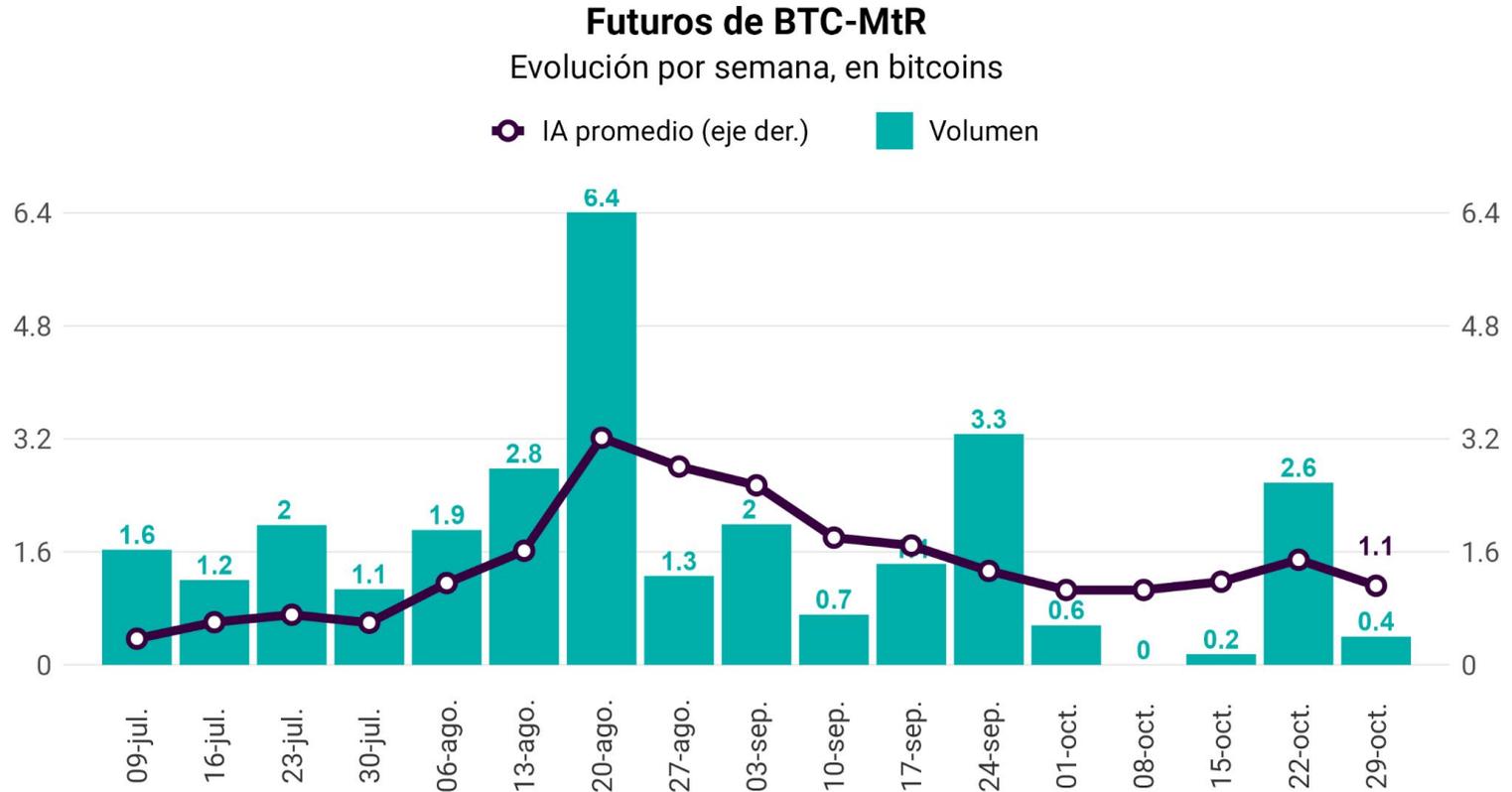
*Para el RFX20 y S&P MERVAL se utilizó el dólar CCL.

**Nota: debido al cambio de base del índice ROFEX20 que entró en vigencia el 9/10, los valores se multiplicaron por 10 para mantener una comparación homogénea en este índice.

BTC-MtR: Operatoria

Futuros

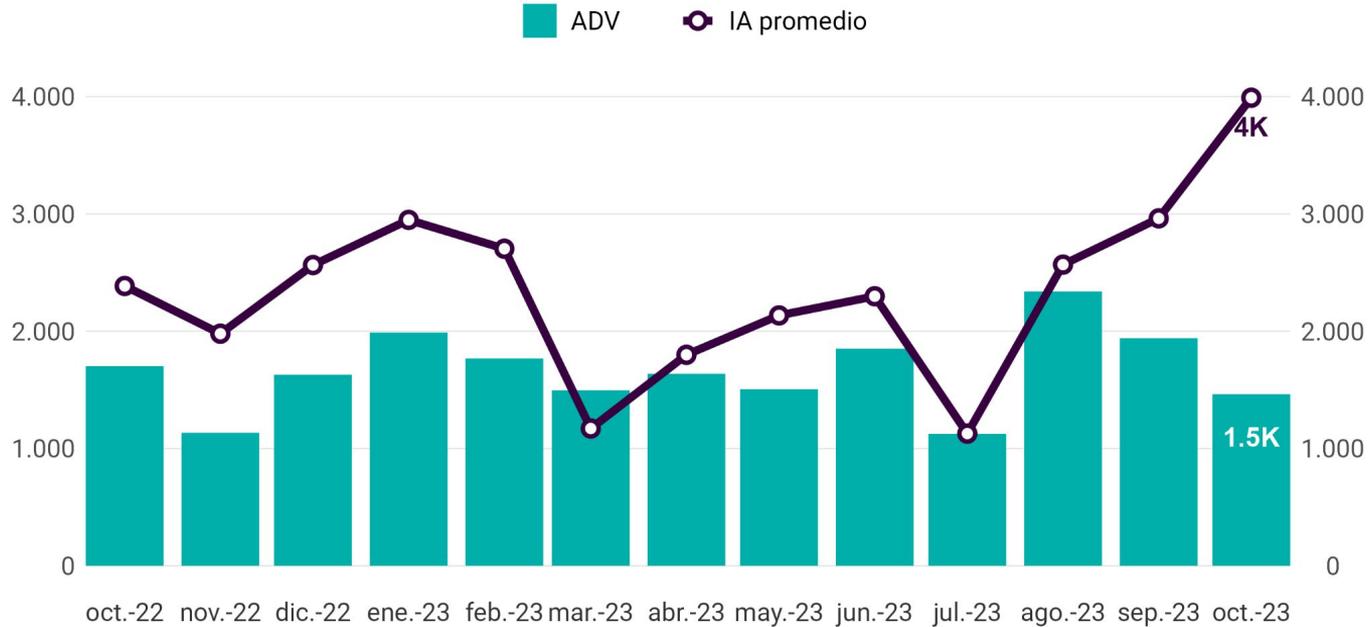
MatbaRofex



Fuente: MtR

Futuros de Galicia

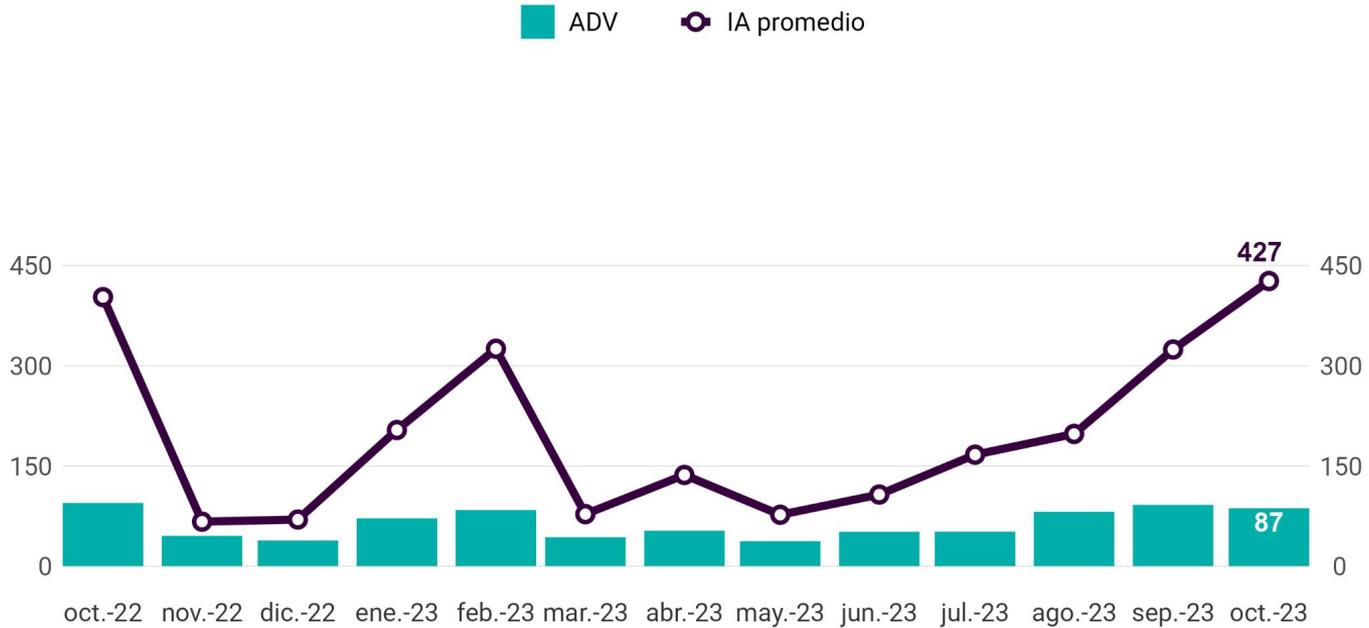
Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: Mtr

Futuros de Pampa Energía

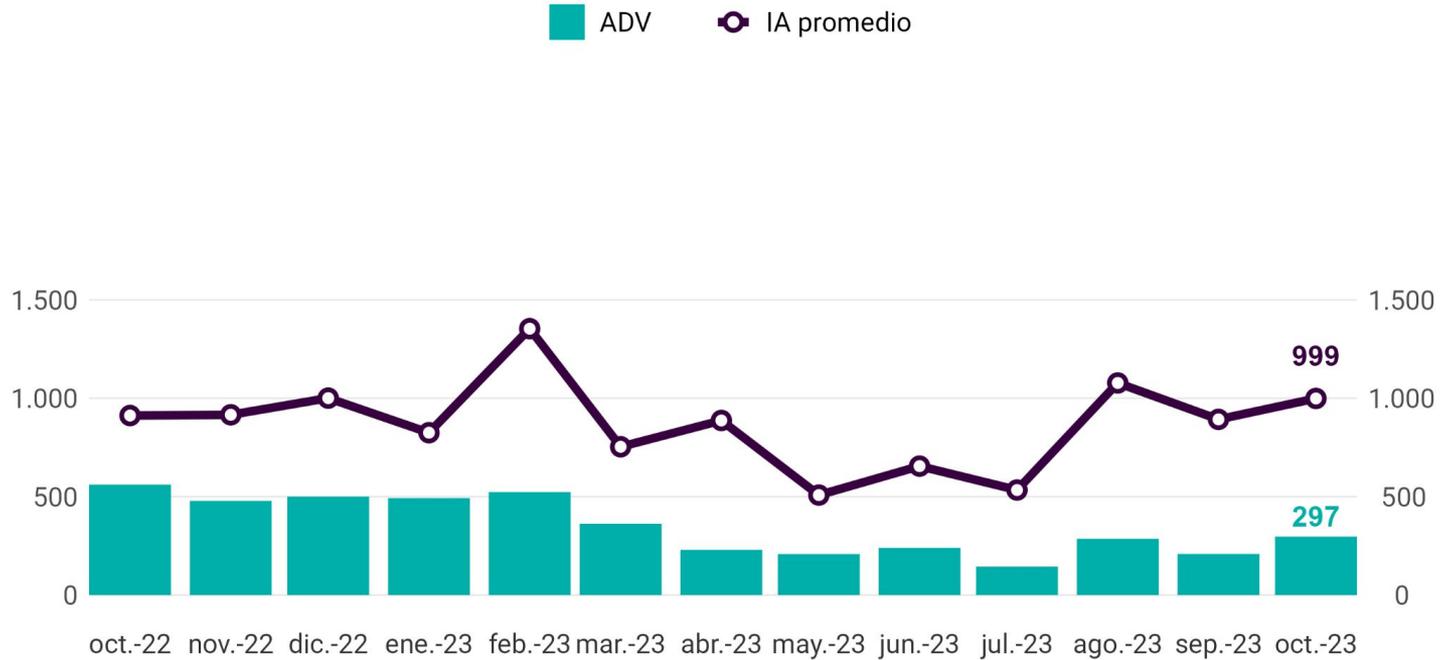
Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: MtR

Futuros de YFPD

Evolución de la operatoria, en contratos

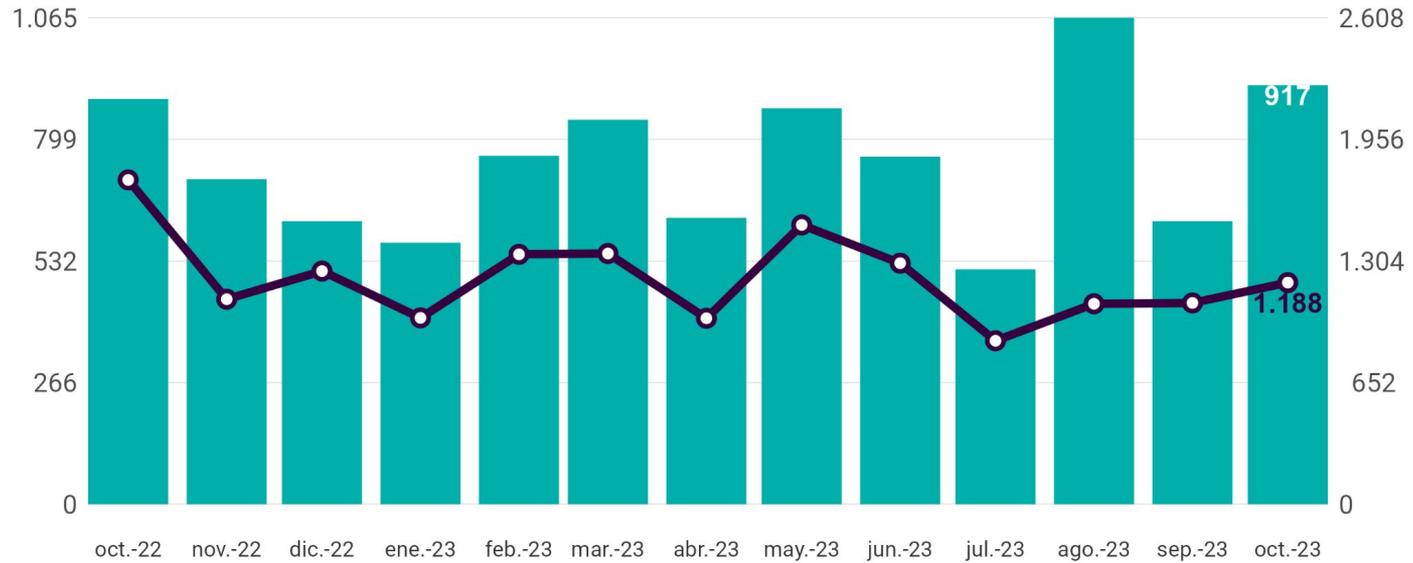


Fuente: Mtr

Futuros de Petróleo

Evolución por mes, en contratos

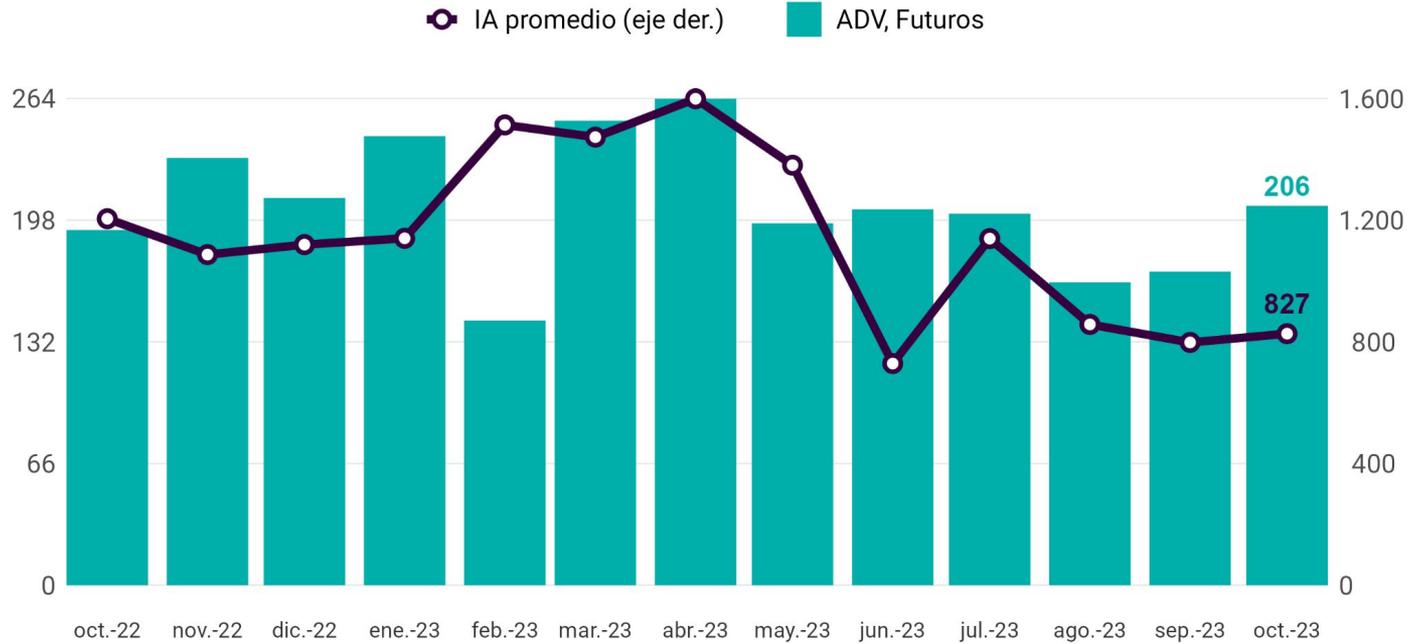
IA promedio (eje der.) ADV, Futuros



Fuente: MtR

Futuros y Opciones de Oro

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 Najjar
Analista

Lucía Madoery
Analista

Aarón Hierrezuelo
Analista