

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Mayo 2022

Highlights del mes

MatbaRofex

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en mayo 23,6 millones de contratos (-14,1% MoM). En términos interanuales, este volumen fue un 227,7% superior al mismo mes de 2021.*
- ✓ *La operatoria de futuros y opciones de dólar alcanzó en el quinto mes del año 13,5 millones de contratos, un 9,3% superior a abril y un 90,4% por encima de mayo de 2021.*
- ✓ *En términos nocionales, el volumen agregado del mes fue de 14.592 millones de dólares (+10,1% MoM y +91,1% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del mes para todos los productos se ubicó en 7,2 millones de contratos (-36,1% MoM y +161,5% YoY).*
- ✓ *En los primeros cinco meses del año, el volumen operado, excluyendo LEDES, acumuló 57,8 millones de contratos (31,3% por encima del mismo período del año anterior) y el interés abierto promedio diario alcanzó 4,2 millones de contratos (+29,1% vs. los primeros cinco meses del 2021).*

Visión General

Mayo | 2022: Volumen en Contratos

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	13,5M	9,3%	90,4%	4,0M	16,6%	44,0%
Letras del Tesoro	10,0M	-33,3%	NA	3,2M	-58,8%	NA
Acciones Individuales	43,8K	-16,6%	-3,1%	5,6K	-31,5%	23,0%
Índices Accionarios	35,0K	3,5%	-42,3%	1,6K	-43,9%	-57,5%
Energía	15,2K	2,2%	210,9%	879,9	-19,5%	-70,3%
Metales	5,0K	46,7%	74,1%	1,8K	36,7%	497,4%
Subtotal (sin LEDES)	13,6M	9,2%	88,8%	4,0M	16,5%	43,7%
Total	23,6M	-14,1%	227,7%	7,2M	-36,1%	161,5%

Fuente: MtR

Visión General

Mayo | 2022: Volumen Nacional

Matba Rofex

	Volumen Nacional en USD			IA Prom. Diario Nacional en USD		
	Volumen	MoM	YoY	IA Prom. Diario	MoM	YoY
Monedas	14.437,2M	10,6%	90,6%	4.219,5M	16,7%	42,7%
Letras del Tesoro	82,4M	-33,0%	NA	26,9M	-58,8%	Inf%
Índices Accionarios	37,0M	1,2%	-23,7%	1,6M	-46,1%	-42,3%
Energía	16,4M	9,8%	415,2%	954,2K	-13,3%	-50,6%
Acciones Individuales	9,6M	-17,0%	24,2%	1,3M	-32,1%	56,8%
Metales	9,3M	39,5%	73,8%	3,3M	30,7%	498,8%
Total	14.591,8M	10,1%	91,1%	4.253,6M	15,3%	43,6%

Fuente: MtR

Nota: Cifras expresadas en USD oficial.

Visión General

Matba Rofex

Acumulado | 2022: Volumen en Contratos

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2022	2021	Var%	2022	2021	Var%
Monedas	57,2M	43,3M	32,0%	4,2M	3,2M	29,3%
Letras del Tesoro	35,0M	0,0	NA	3,5M	0,0	NA
Acciones Individuales	301,1K	270,4K	11,4%	6,2K	5,3K	17,1%
Índices Accionarios	193,0K	372,1K	-48,1%	2,8K	6,7K	-58,5%
Energía	90,1K	36,1K	149,6%	2,0K	2,8K	-27,5%
Metales	23,6K	16,3K	44,5%	1,3K	850,3	54,7%
Subtotal (sin LEDES)	57,8M	44,0M	31,3%	4,2M	3,3M	29,1%
Total	92,8M	44,0M	110,8%	7,7M	3,3M	135,3%

*En contratos, datos acumulados al 31/05 de cada año

Fuente: MtR

Visión General

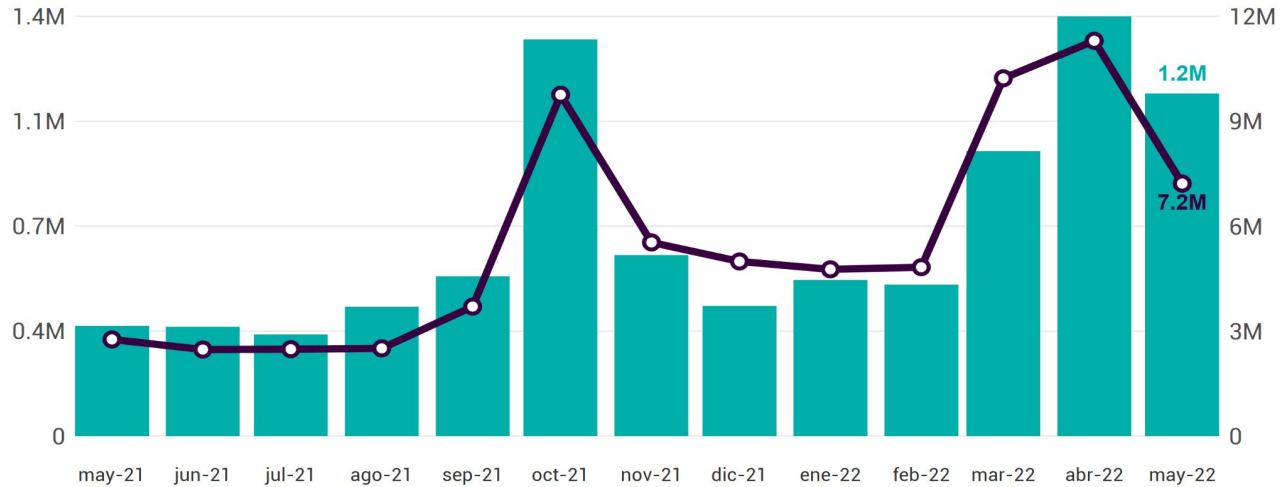
Volumen Histórico de FyO

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



Fuente: MTR

Dólar: Operatoria

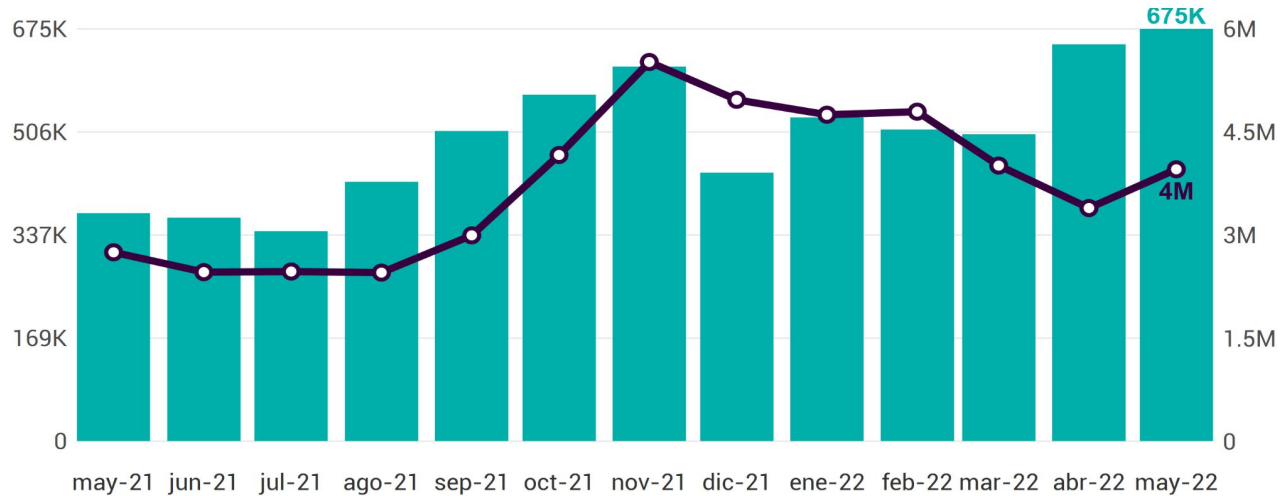
Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

○ IA promedio (eje der.) ■ ADV



Fuente: MtR

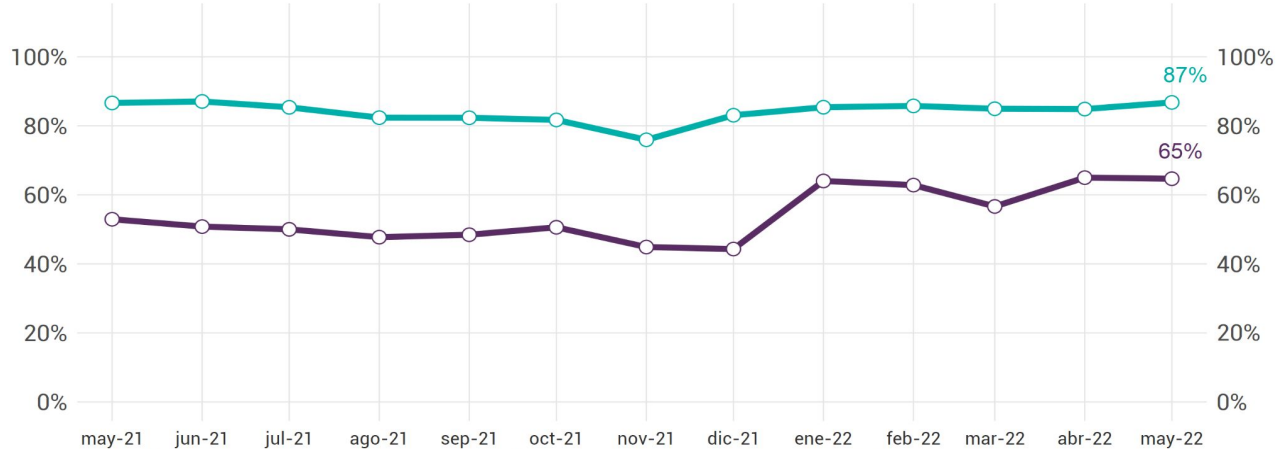
Dólar: Market Share

Mercado de Cambios

Matba Rofex

Mercado de Cambios Market Share MtR Mensual

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.%
DLR052022	120,16	-0,57	-0,5% ▼	5.112.084	6% ▲	0	-100% ▼
DLR062022	125,47	-1,58	-1,2% ▼	5.258.627	536% ▲	2.276.169	529% ▲
DLR072022	131,31	-2,39	-1,8% ▼	1.329.221	143% ▲	528.817	117% ▲
DLR082022	137,96	-3,34	-2,4% ▼	806.371	496% ▲	153.407	143% ▲
DLR092022	144,25	-3,30	-2,2% ▼	402.977	145% ▲	98.609	57% ▲
DLR102022	150,70	-3,80	-2,5% ▼	251.909	257% ▲	80.327	152% ▲
DLR112022	156,80	-3,30	-2,1% ▼	153.535	558% ▲	100.646	27% ▲
DLR122022	163,50	-3,30	-2,0% ▼	102.482	85% ▲	28.291	50% ▲
DLR012023	170,35	-1,85	-1,1% ▼	54.322	84% ▲	23.987	126% ▲
DLR022023	176,50	-1,00	-0,6% ▼	10.009	-53% ▼	15.009	69% ▲
DLR032023	182,85	-0,10	-0,1% ▼	8.825	-72% ▼	6.618	-10% ▼
DLR042023	189,00	N/C	N/C	3.549	N/C	3.221	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	-2,23	-1,5% ▼	13.493.911	9% ▲	3.315.101	-1% ▼

Fuente: MtR

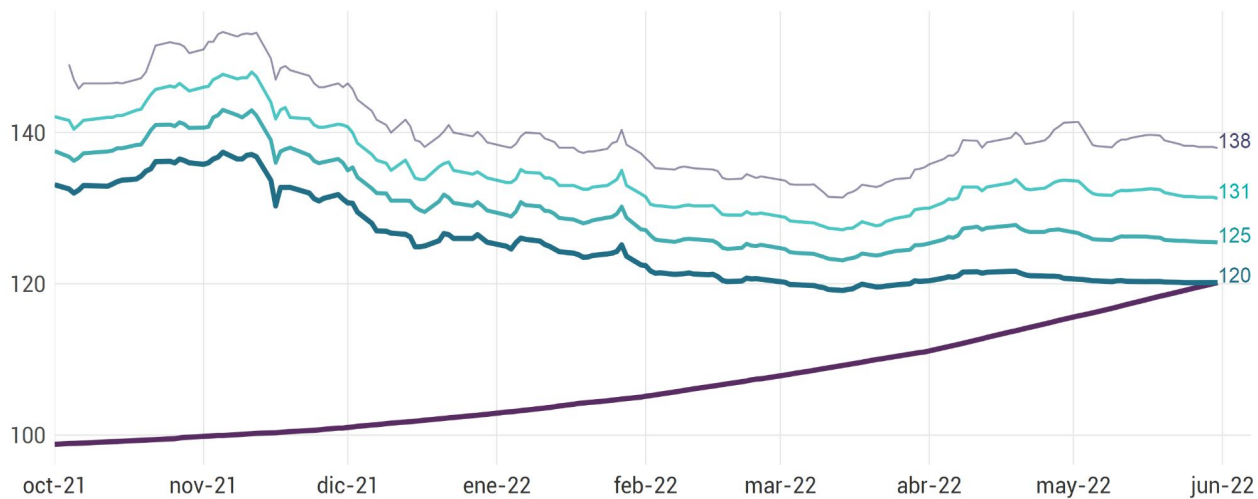
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR052022 DLR062022 DLR072022 DLR082022



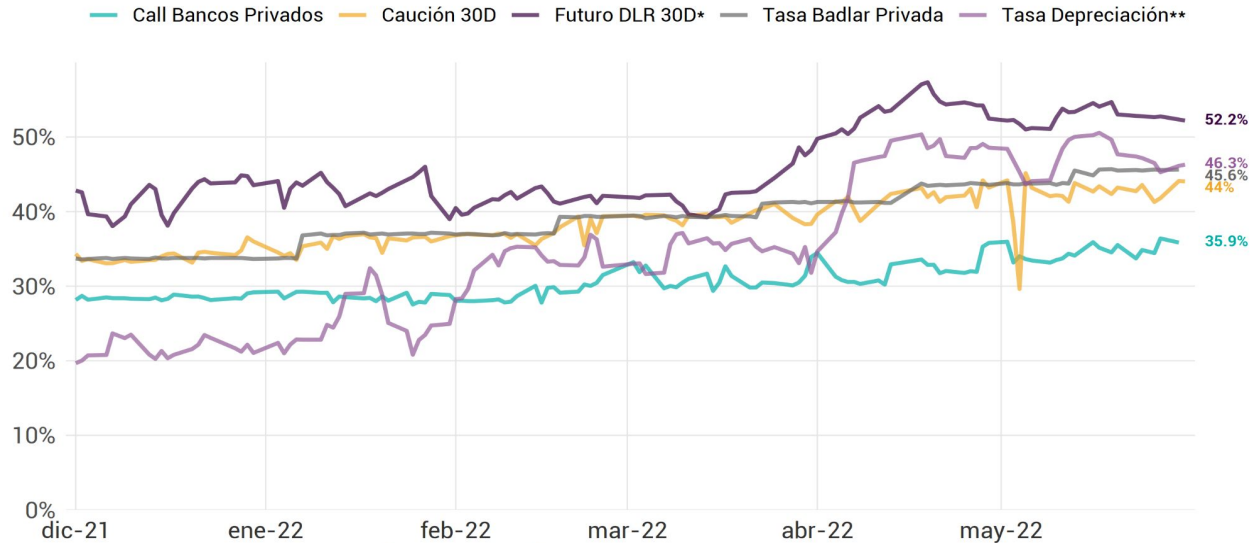
Fuente: MTR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Matba Rofex

Evolución de Tasas Nominales Anuales (TNA) con composición continua



*Tasa implícita teórica con vencimiento constante de 30 días

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

Fuente: MtR y Reuters

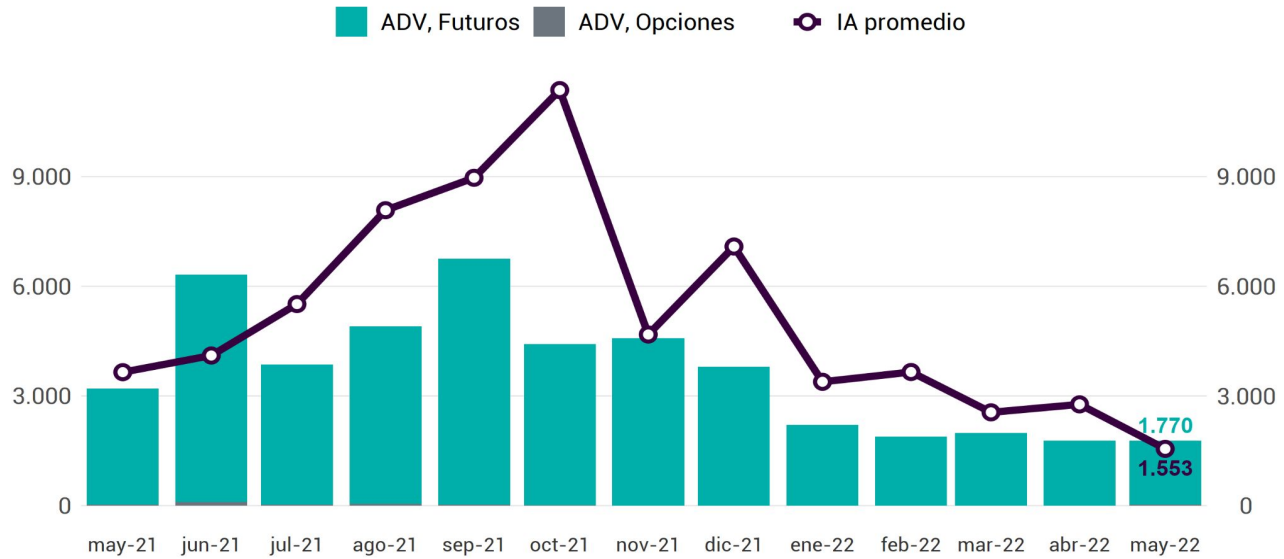
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

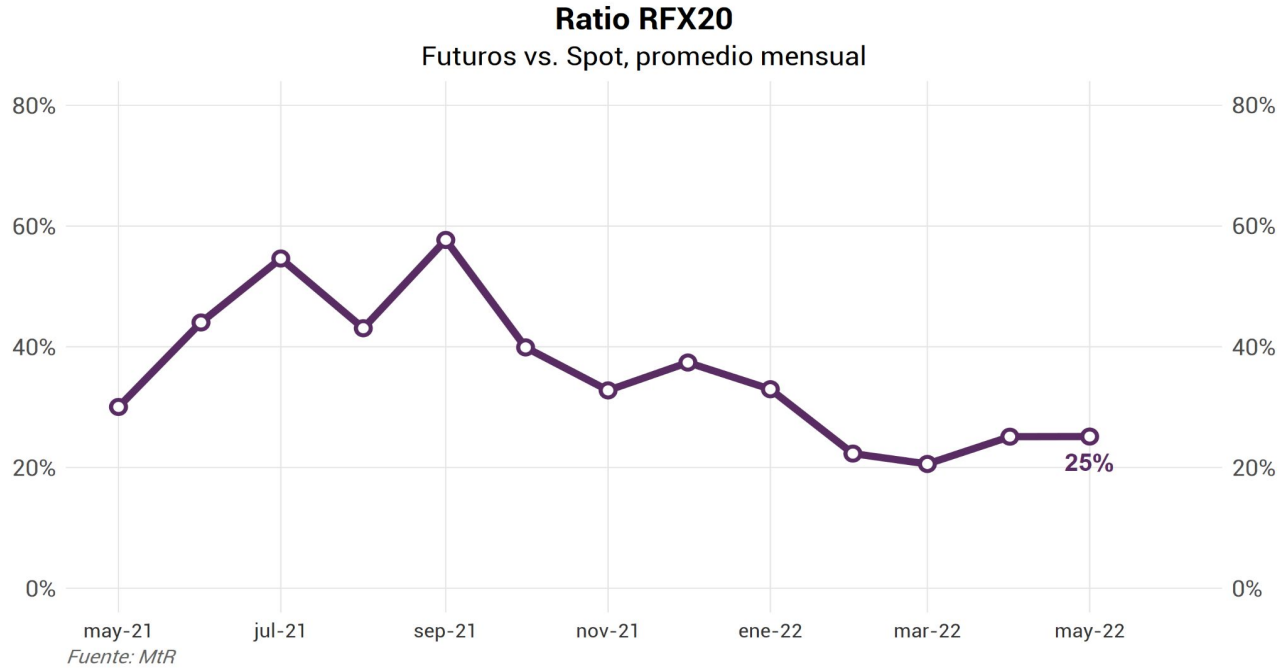


Fuente: Mtr

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex

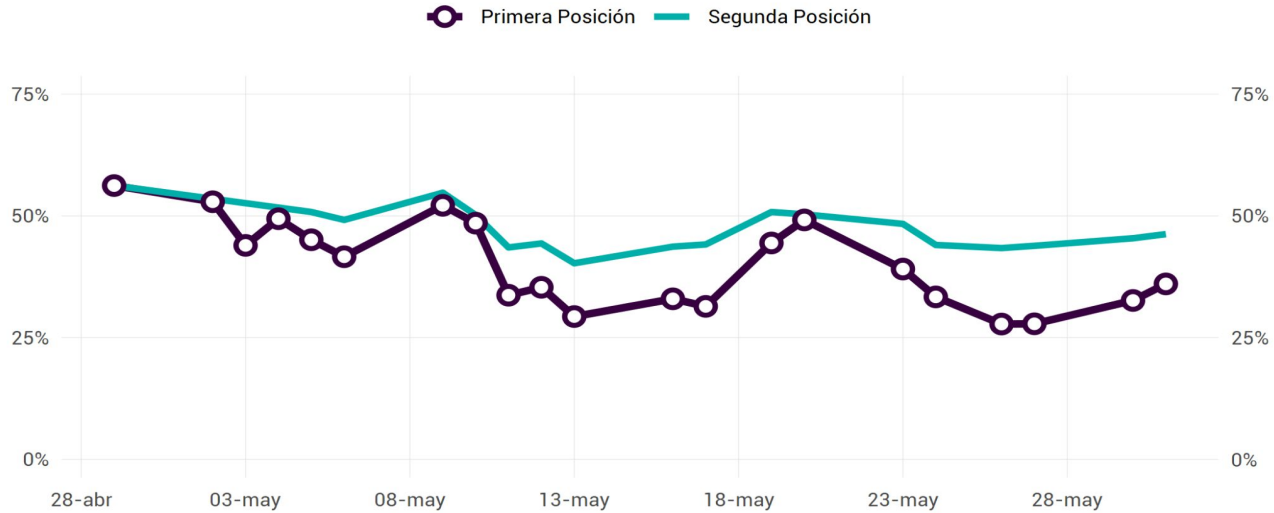


RFX20: Tasas implícitas

Futuros

Tasas Implícitas de Futuro RFX20

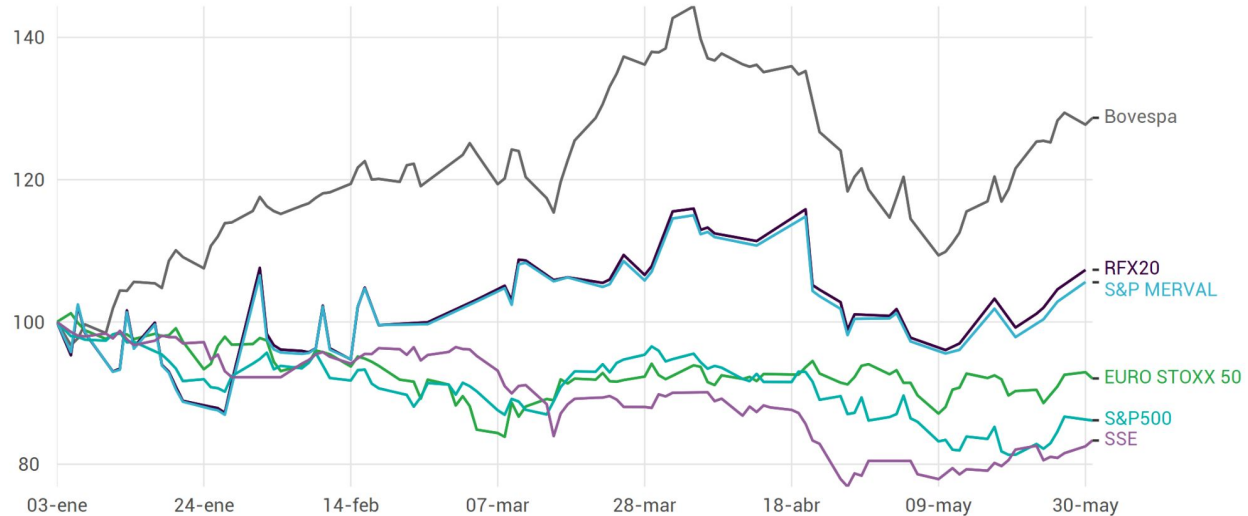
TNA en base a precios de ajuste de cada día y el cierre del spot del último mes



Fuente: Matba Rofex

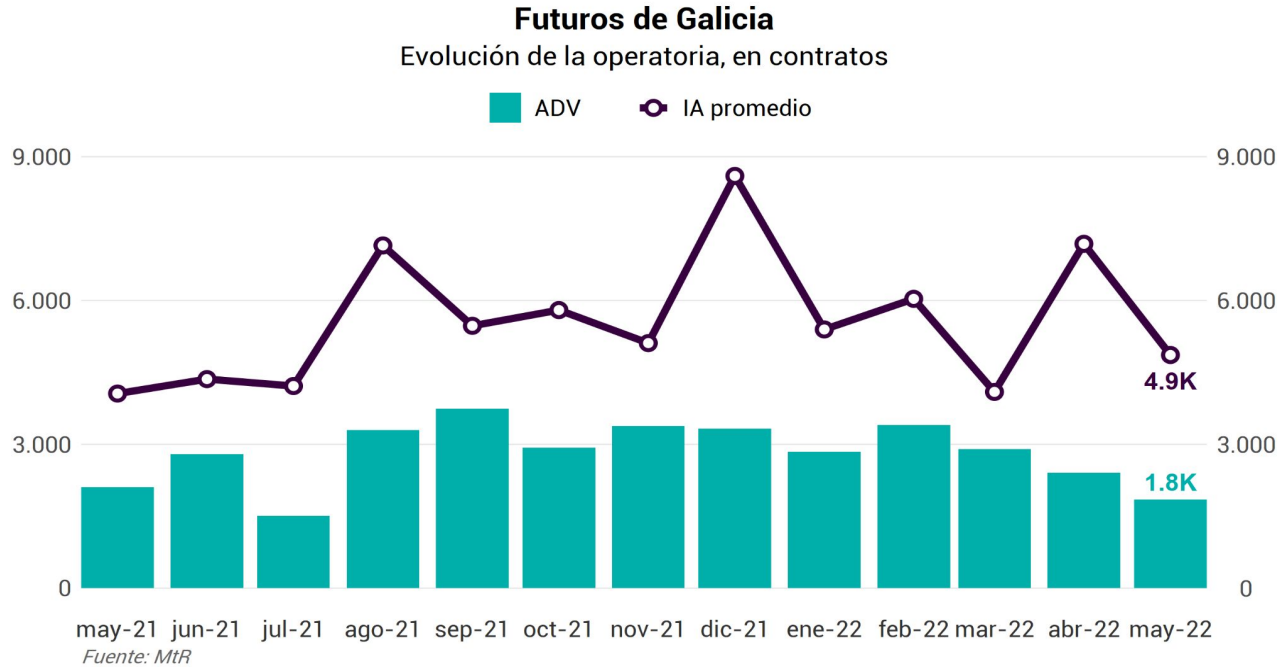
Evolución de Índices Accionarios Seleccionados

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



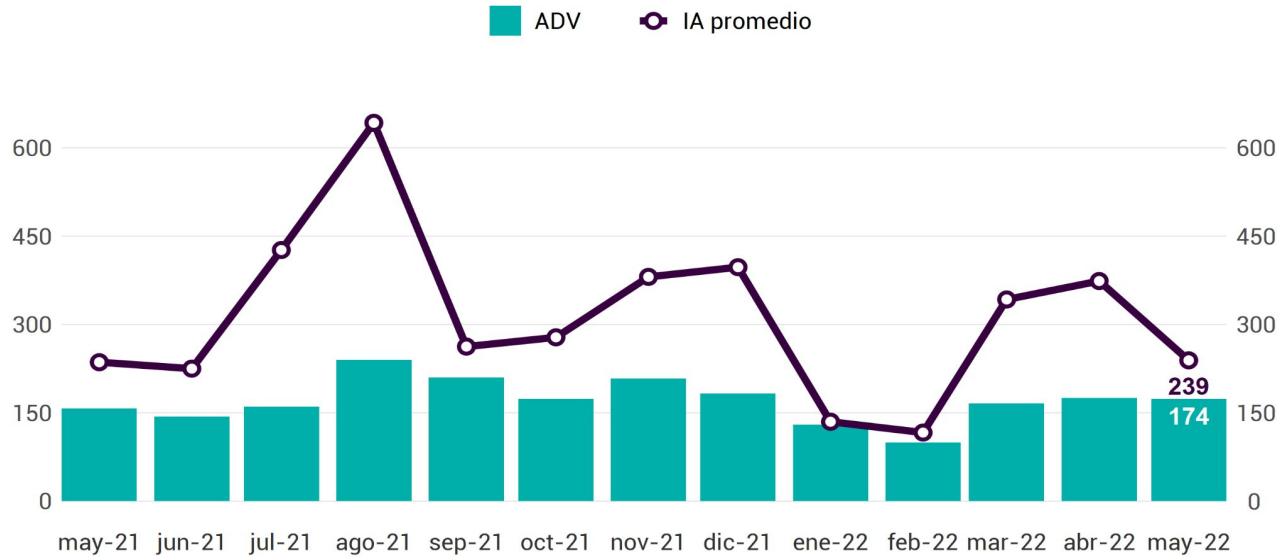
Fuente: Mtr y Reuters

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

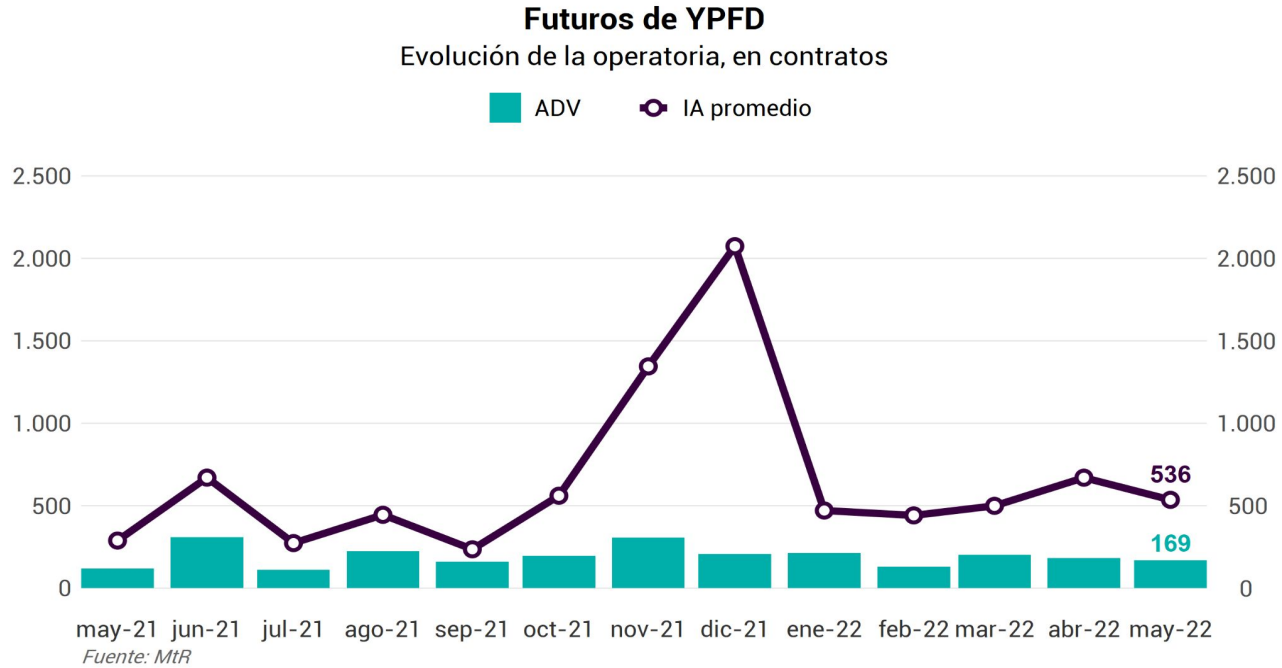


Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos

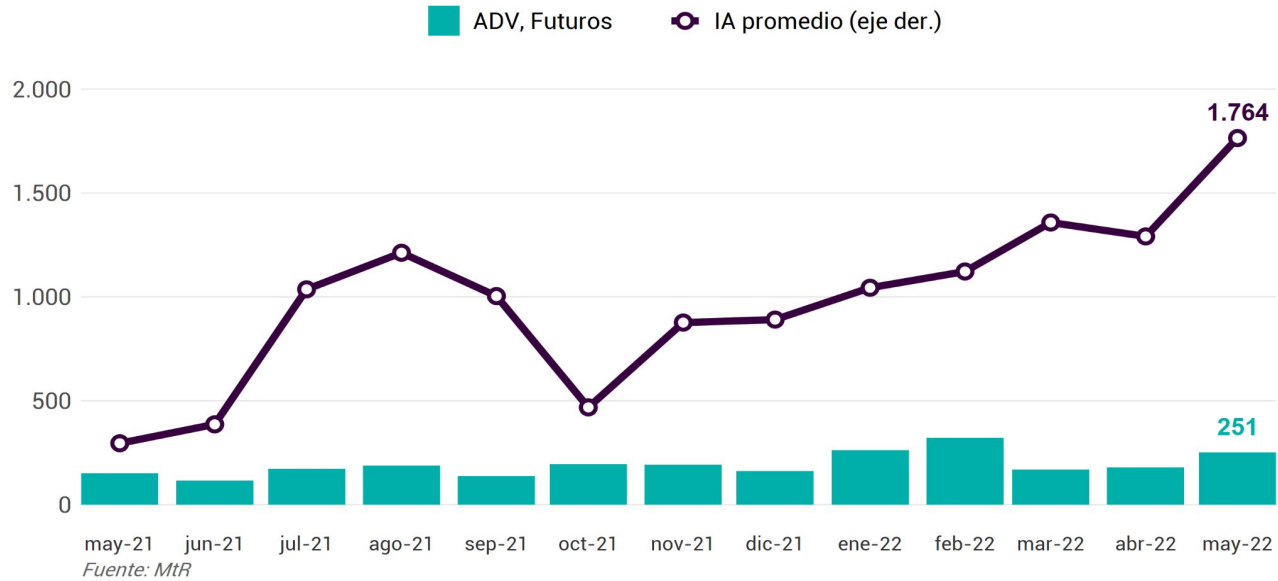


Fuente: MtR



Futuros y Opciones de Oro

Evolución por mes, en contratos



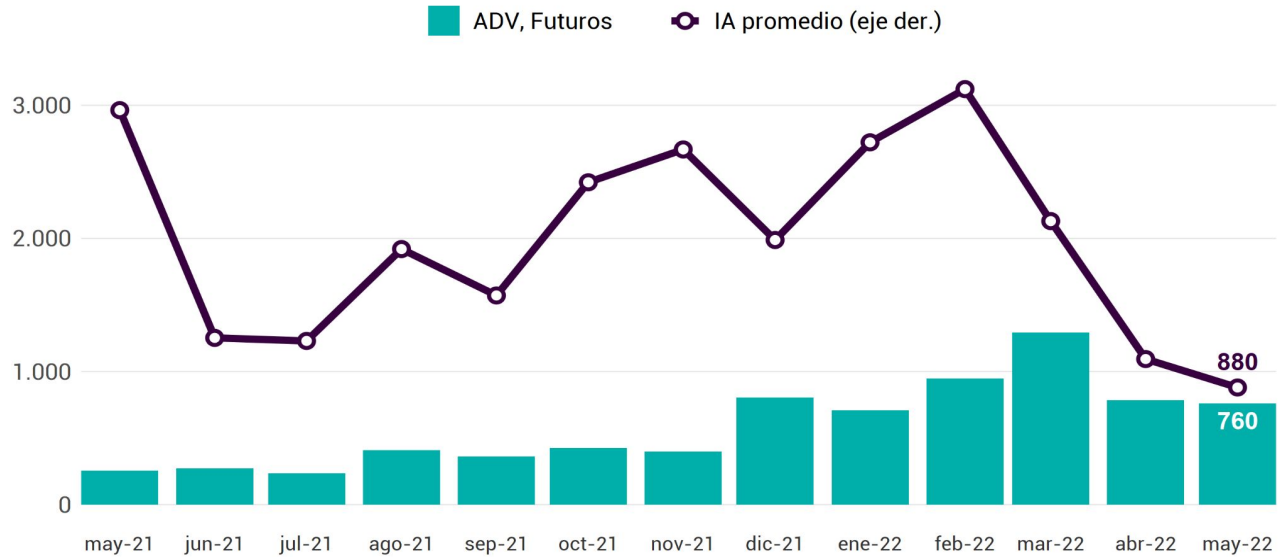
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Fuente: MTR

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 Najar
Analista

Francisco Scognamillo
Analista

Lucía Madoery
Analista