

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros

Julio 2021

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en julio 7,3 millones de contratos (-6,9% MoM y -9,2% YoY).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de todos los productos se ubicó en 2,5 millones de contratos, similar al mes anterior.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del 2021 de todos los productos alcanzó 3 millones de contratos, un 31,8% por encima del mismo período del año anterior.*
- ✓ *En los primeros 7 meses del 2021, el volumen operado ascendió a 59,3 millones de contratos, un 14,5% superior con respecto al mismo período del 2020.*

Visión General

Julio | 2021

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	7,2M	-6,0%	-7,3%	2,5M	0,4%	-41,3%
Índices Accionarios	81,2K	-38,8%	-57,8%	5,5K	34,3%	-49,7%
Acciones Individuales	37,4K	-45,2%	-55,6%	4,9K	-6,5%	-35,3%
Energía	5,0K	-13,0%	-66,9%	1,2K	-1,8%	-79,4%
Metales	3,6K	49,5%	-64,8%	1,0K	168,1%	-73,6%
Total	7,3M	-6,9%	-9,2%	2,5M	0,4%	-41,4%

Fuente: MtR

Visión General

Acumulado | 2021

Matba Rofex

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2021	2020	Var%	2021	2020	Var%
Monedas	58,2M	49,6M	17,5%	3,0M	2,3M	32,3%
Índices Accionarios	586,0K	1,5M	-59,9%	6,1K	6,4K	-3,7%
Acciones Individuales	376,1K	279,6K	34,5%	5,3K	3,7K	43,8%
Energía	46,7K	327,0K	-85,7%	2,3K	4,6K	-50,1%
Metales	22,4K	98,7K	-77,3%	808,9	4,1K	-80,5%
Total	59,3M	51,7M	14,5%	3,0M	2,3M	31,8%

*En contratos, datos acumulados al 31/7 de cada año

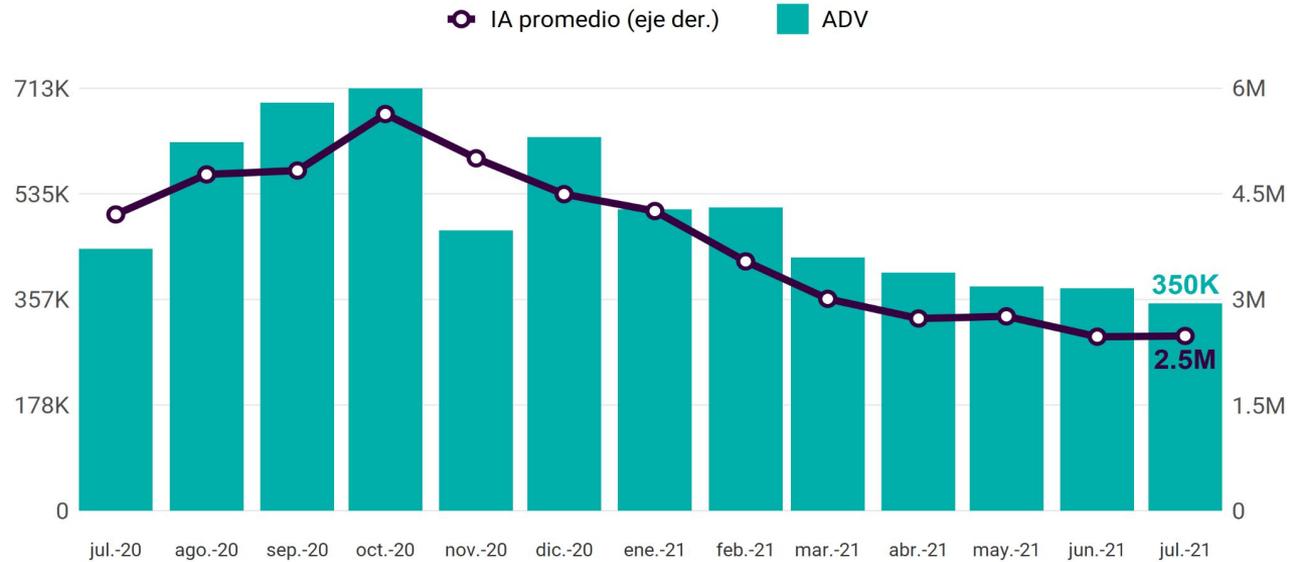
Fuente: MtR

Visión General

Volumen Histórico de FyO

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos



Fuente: MtR

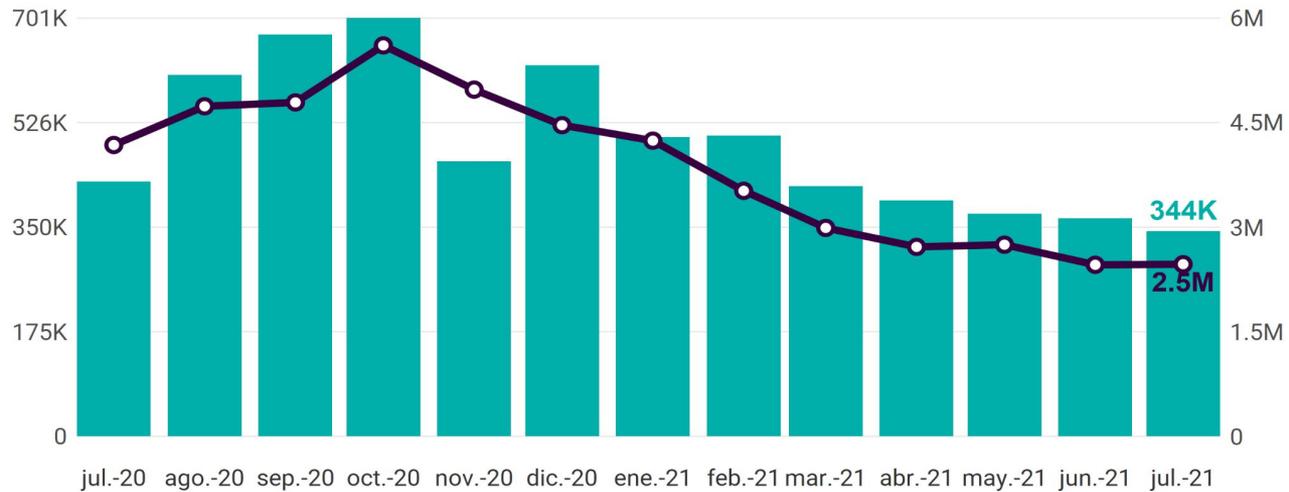
Dólar: Operatoria

Futuros y Opciones

Futuros y Opciones de Dólar

Evolución por mes, en contratos

IA promedio (eje der.) ADV



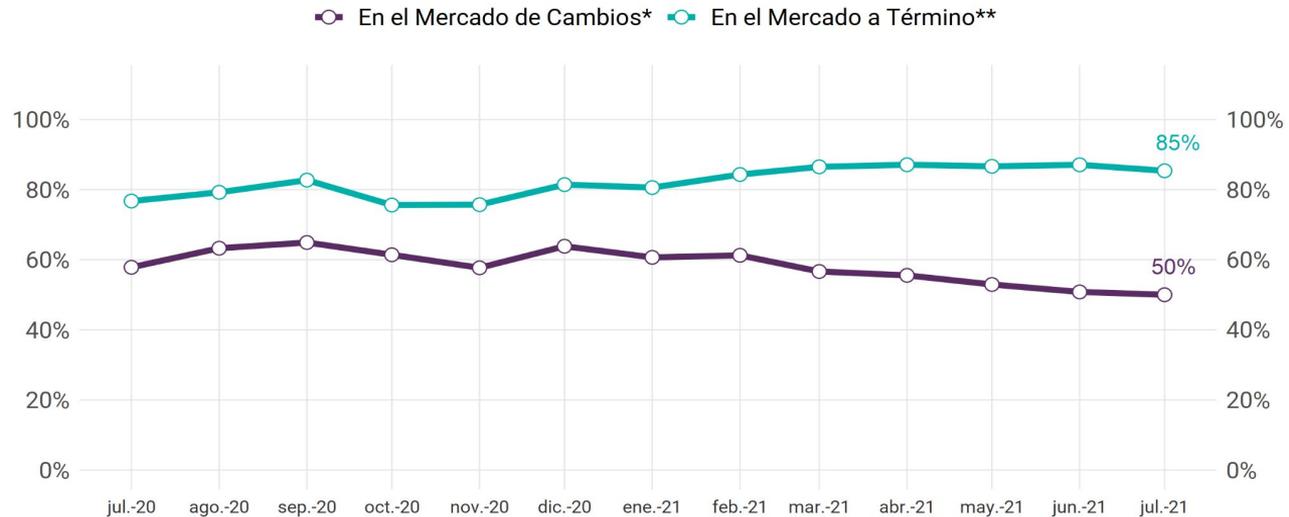
Fuente: MtR

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 31/07			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR072021	96,69	-1,36	-1,4% ▼	2.879.684	30% ▲	0	-100% ▼
DLR082021	99,14	-1,41	-1,4% ▼	2.182.039	205% ▲	786.170	133% ▲
DLR092021	101,69	-1,81	-1,7% ▼	750.729	62% ▲	368.251	39% ▲
DLR102021	104,70	-2,10	-2,0% ▼	590.816	6% ▲	375.151	57% ▲
DLR112021	108,65	-2,10	-1,9% ▼	396.738	-27% ▼	403.431	25% ▲
DLR122021	113,15	-1,85	-1,6% ▼	210.125	22% ▲	176.592	28% ▲
DLR012022	118,30	-0,70	-0,6% ▼	120.152	28% ▲	73.006	83% ▲
DLR022022	123,30	-0,20	-0,2% ▼	46.649	-11% ▼	45.748	136% ▲
DLR032022	128,00	0,45	0,4% ▲	12.989	37% ▲	9.370	3.409% ▲
DLR042022	131,50	0,10	0,1% ▲	13.035	566% ▲	6.496	248% ▲
DLR052022	136,50	1,20	0,9% ▲	10.933	-80% ▼	5.538	3% ▲
DLR062022	140,60	1,40	1,0% ▲	31	Inf% ▲	31	Inf% ▲
PROMEDIO/TOTAL	N/C	-0,70	-0,7% ▼	7.213.920	-6% ▼	2.249.784	-1% ▼

Fuente: Mtr

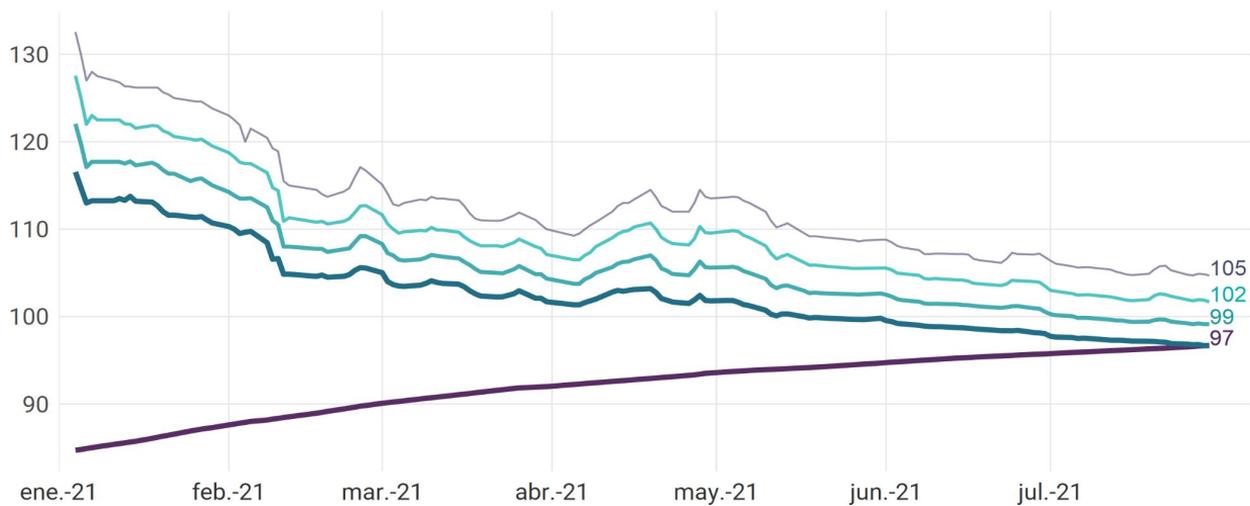
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR072021 DLR082021 DLR092021 DLR102021

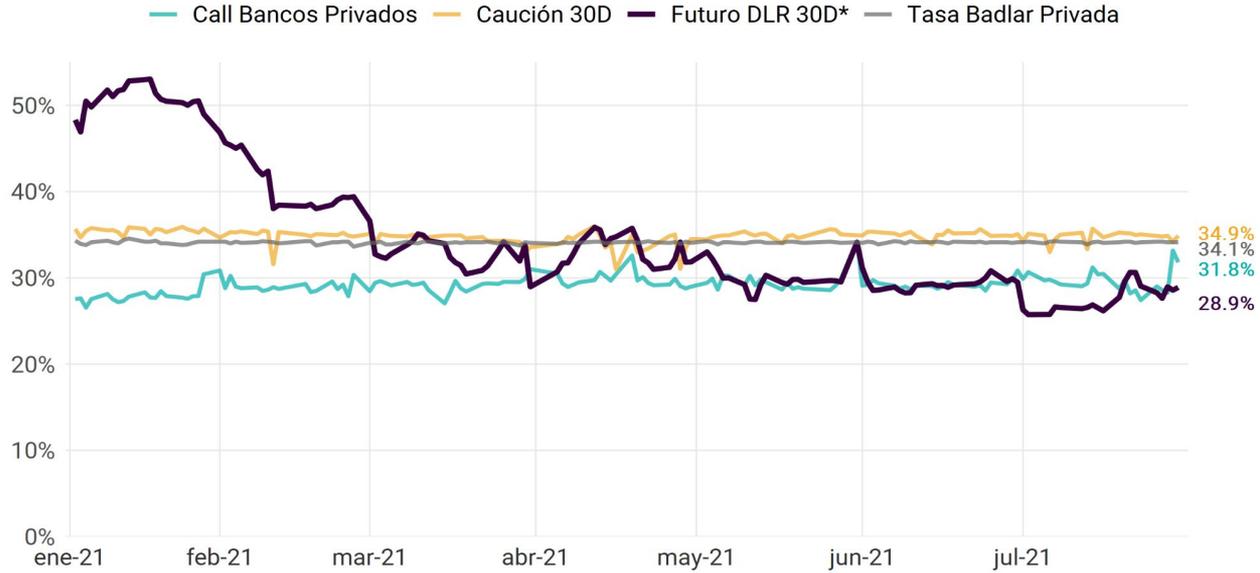


Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Evolución de Tasas Seleccionadas (TNA)



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

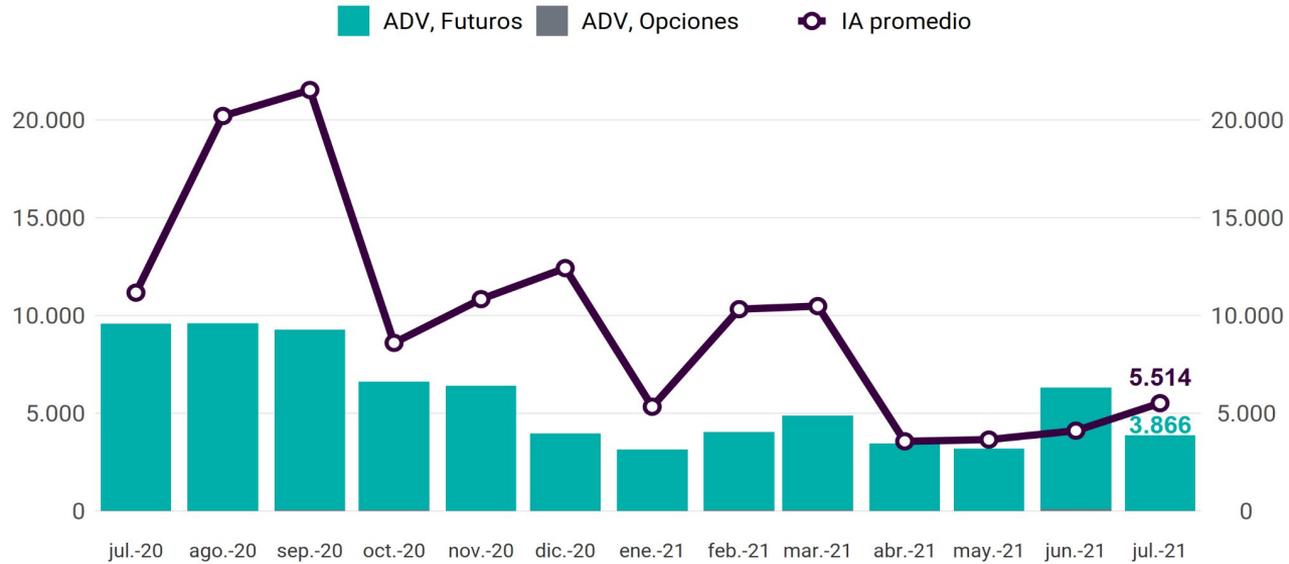
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

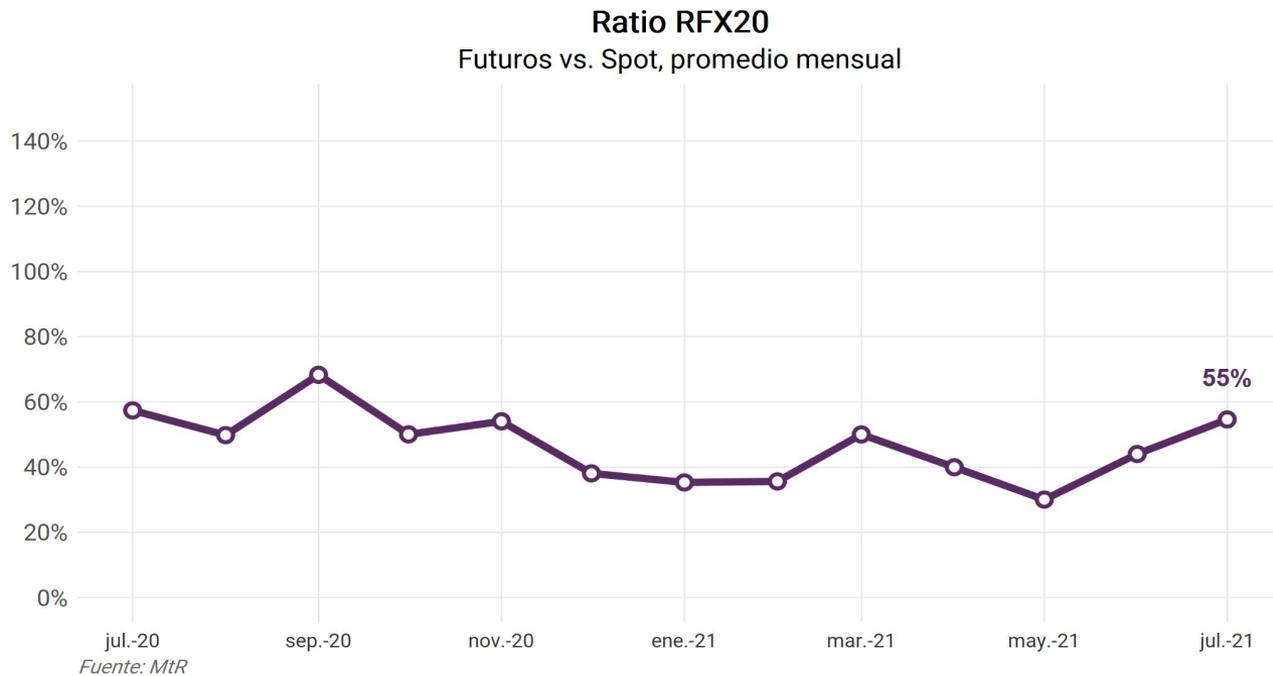


Fuente: MtR

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



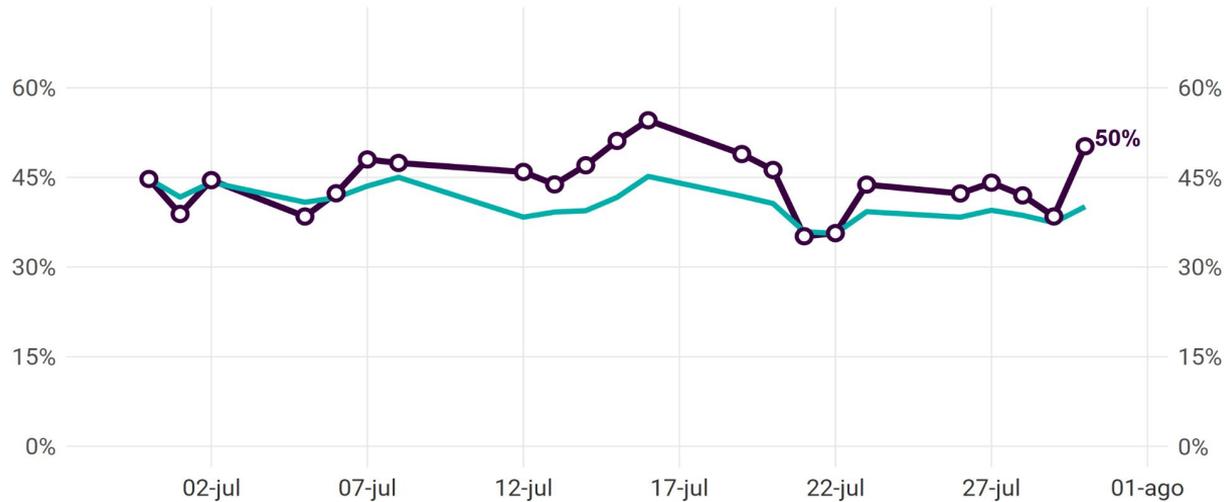
RFX20: Tasas implícitas

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

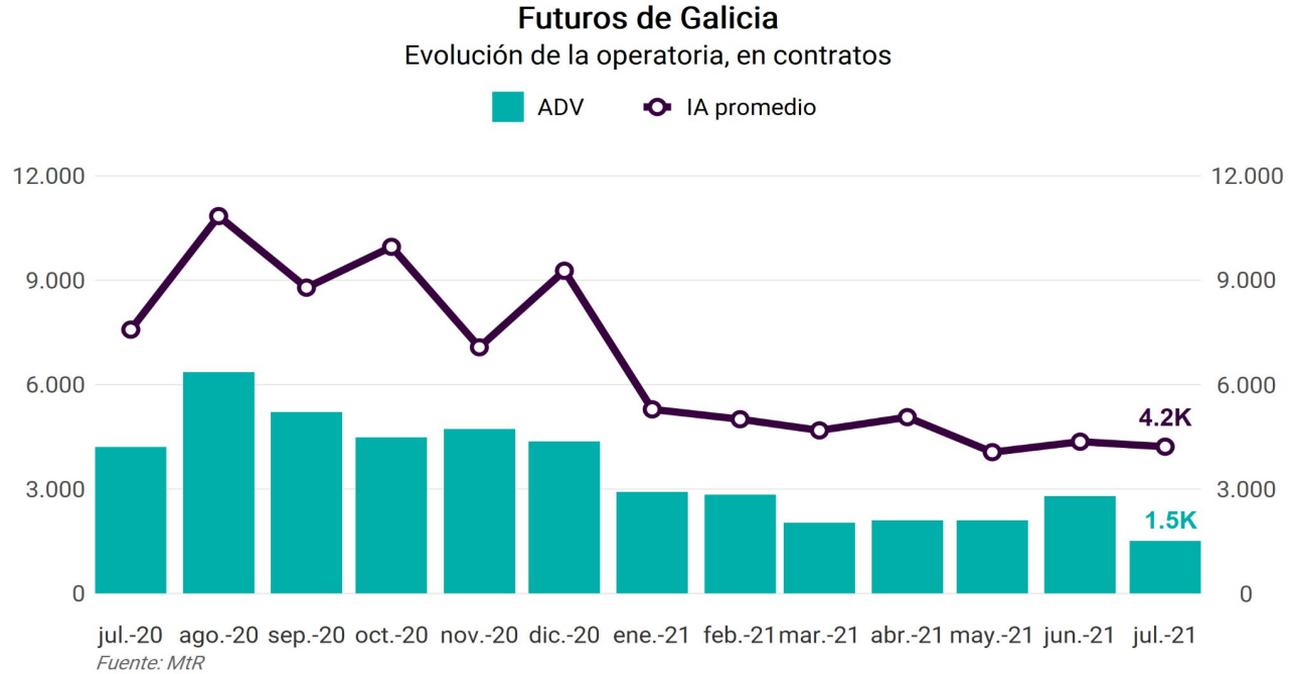
Principales Índices Accionarios Mundiales

Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



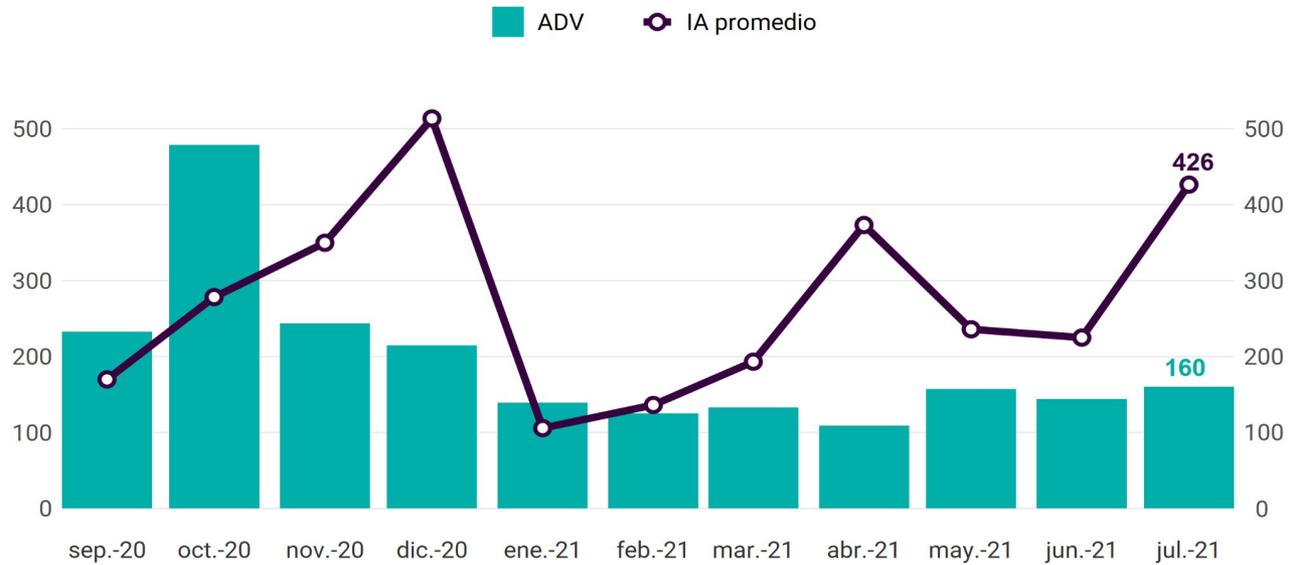
Fuente: MTR y Reuters

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

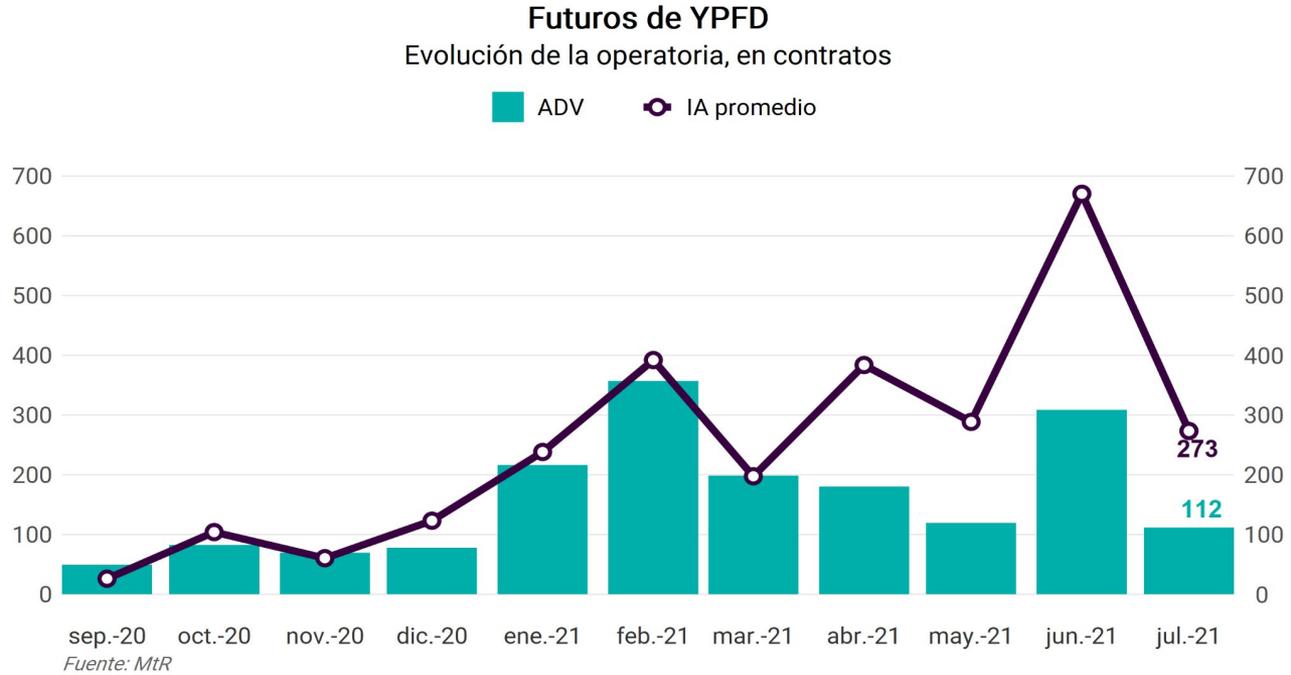


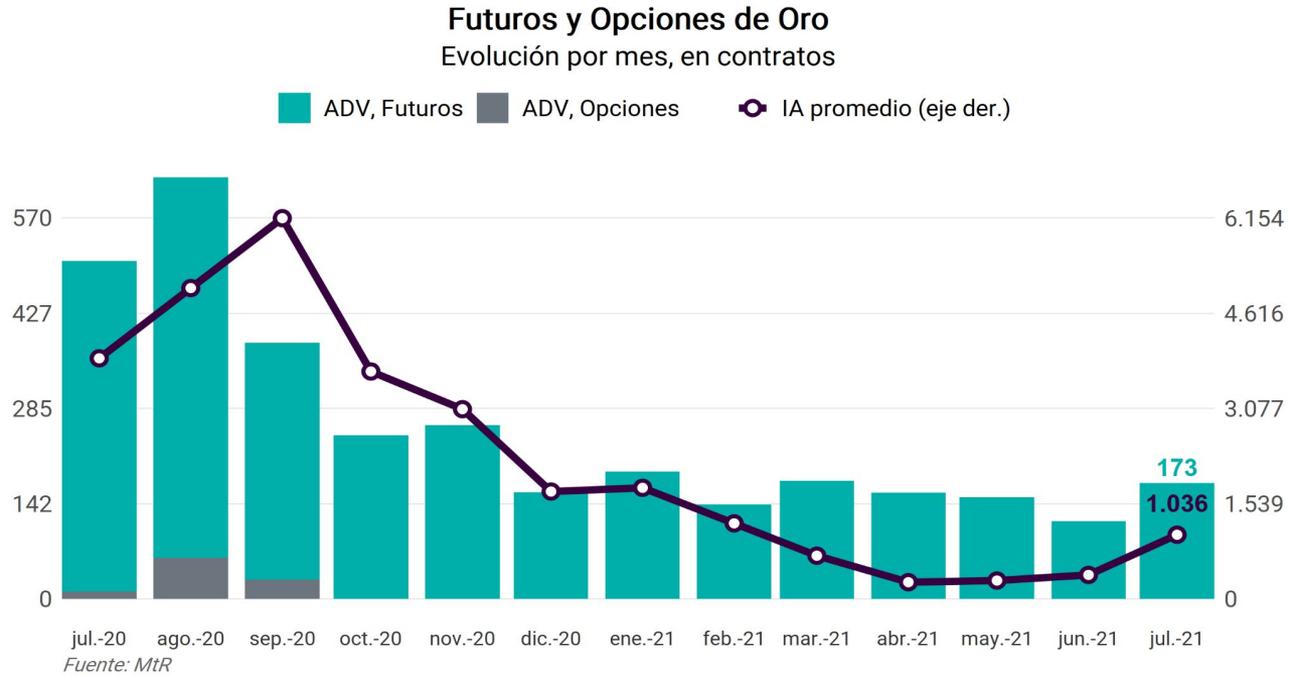
Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos



Fuente: MTR





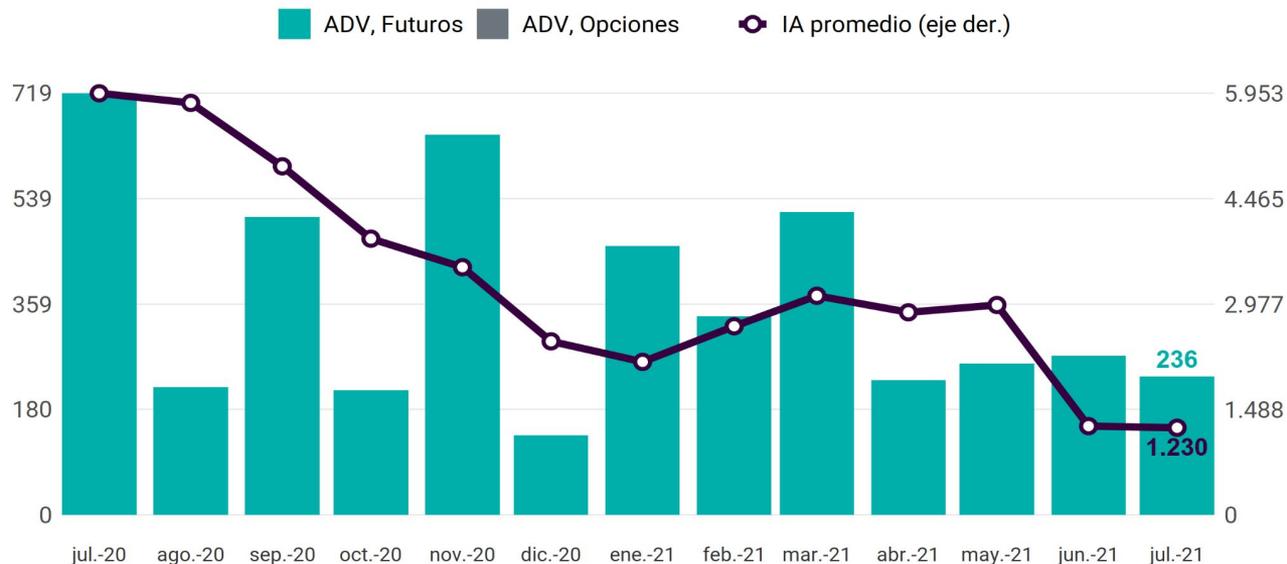
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos

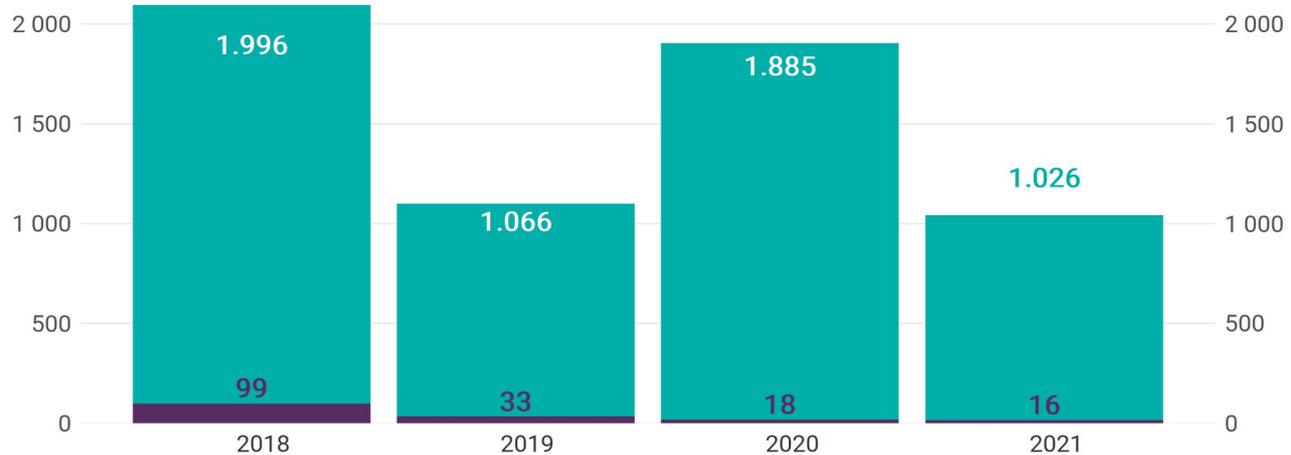


Fuente: Mtr

Volumen acumulado anual UFEX

Datos hasta julio 2021, en contratos

Dolar Novillo



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

Valentín Bruzzoni
Analista

Jacqueline Najjar
Analista