

Matba Rofex

Informe Mensual de Derivados Financieros Junio 2021

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en junio 7,9 millones de contratos (+9,6% MoM y similar al mismo mes del año anterior).*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de todos los productos disminuyó un 10,5% en el mes, ubicándose en 2,5 millones de contratos.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario del 2021 de todos los productos alcanzó 3,1 millones de contratos, un 58,5% por encima del mismo período del año anterior.*
- ✓ *En el primer semestre del 2021, el volumen operado ascendió a 52 millones de contratos, un 19% superior con respecto al mismo período del 2020.*
- ✓ *En el sexto mes del año, la operatoria de futuros y opciones sobre monedas se ubicó en 7,7 millones de contratos (+8,4% MoM y +2,4% YoY).*

Visión General

Junio | 2021

Matba Rofex

	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Contratos	MoM	YoY	Contratos	MoM	YoY
Monedas	7,7M	8,4%	2,4%	2,5M	-10,5%	-36,1%
Índices Accionarios	132,7K	118,5%	-50,4%	4,1K	12,5%	-63,5%
Acciones Individuales	68,3K	50,9%	-14,1%	5,3K	14,7%	-36,8%
Energía	5,7K	16,5%	-76,7%	1,3K	-57,7%	-70,6%
Metales	2,4K	-15,4%	-76,8%	386,5	30,8%	-91,8%
Total	7,9M	9,6%	-0,0%	2,5M	-10,5%	-36,4%

Fuente: MtR

Visión General

Acumulado | 2021

Matba Rofex

	Volumen*			Interés Abierto Promedio Diario*		
	2021	2020	Var%	2021	2020	Var%
Monedas	51,0M	41,8M	22,1%	3,1M	1,9M	59,2%
Índices Accionarios	504,8K	1,3M	-60,2%	6,2K	5,6K	11,5%
Acciones Individuales	338,6K	195,3K	73,4%	5,3K	3,0K	77,6%
Energía	41,8K	312,0K	-86,6%	2,5K	4,4K	-43,2%
Metales	18,7K	88,3K	-78,8%	769,1	4,2K	-81,6%
Total	51,9M	43,7M	18,9%	3,1M	2,0M	58,5%

*En contratos, datos acumulados al 30/6 de cada año

Fuente: Mtr

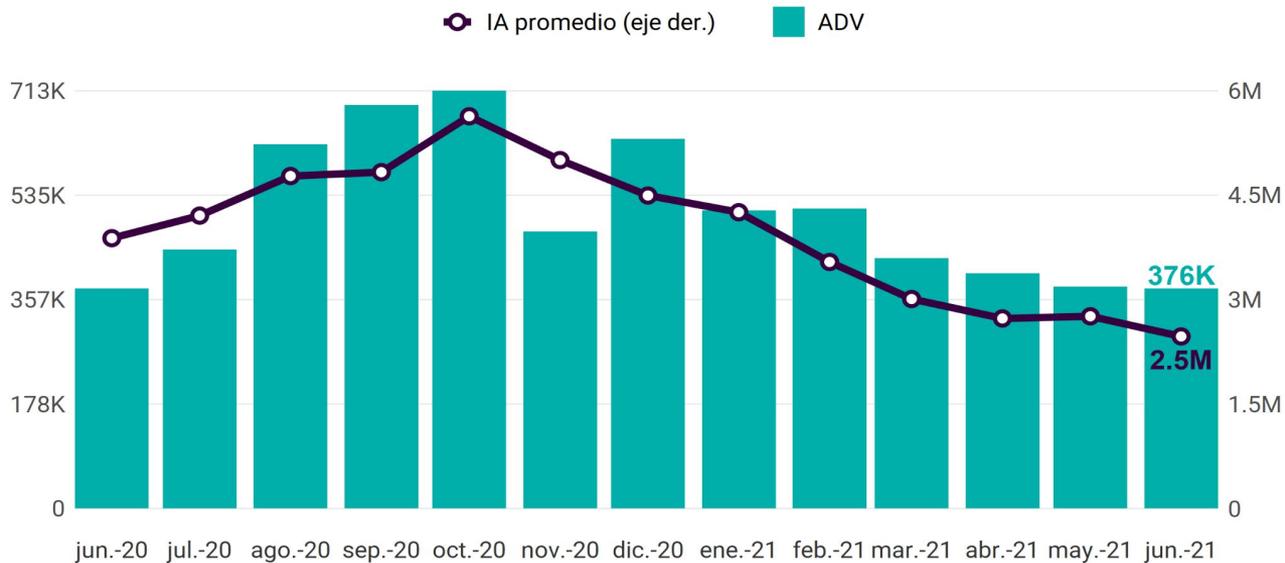
Visión General

Volumen Histórico de FyO

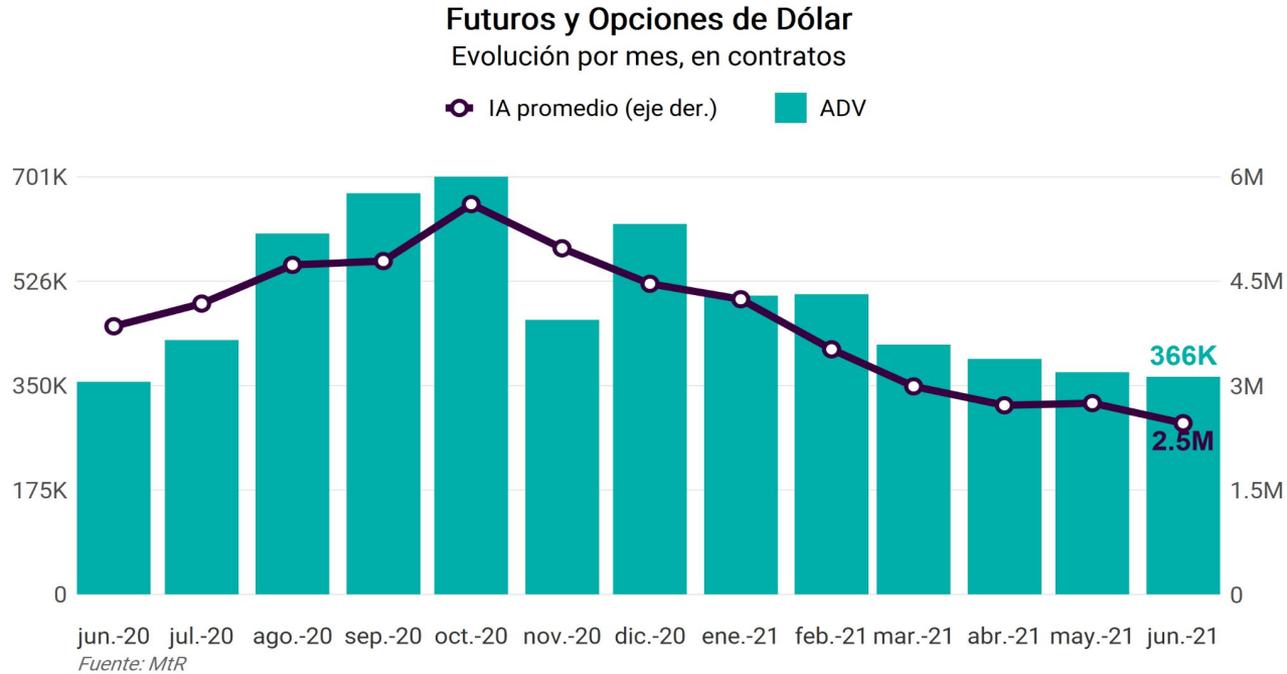
MatbaRofex

Futuros y Opciones de Derivados Financieros

Evolución por mes en contratos



Fuente: Mtr



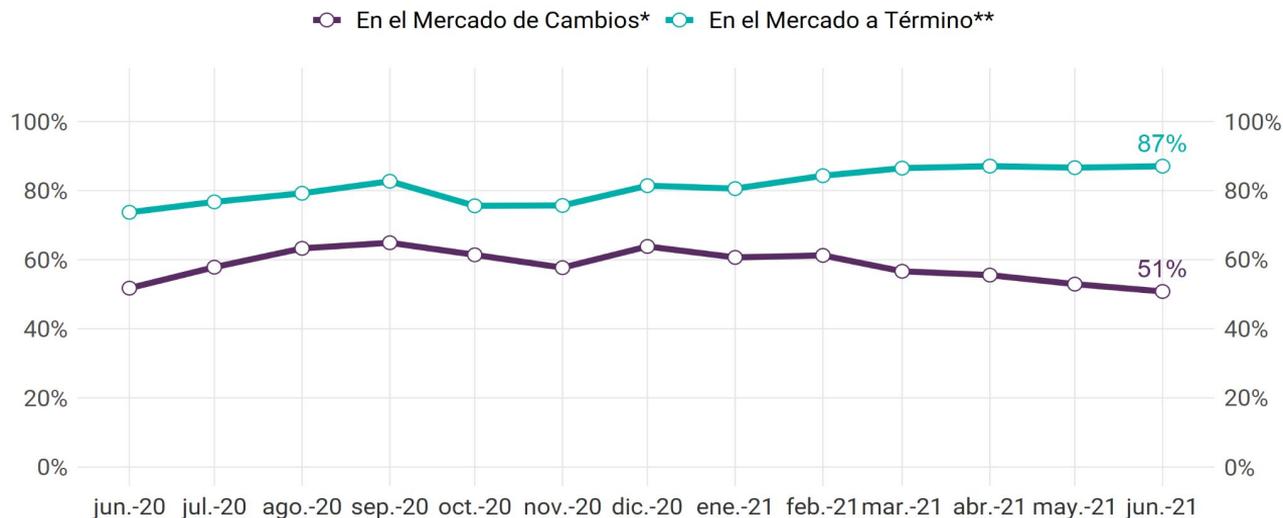
Dólar: Market Share

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 30/06			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR062021	95,73	-1,61	-1,7% ▼	2.803.833	39% ▲	0	-100% ▼
DLR072021	98,04	-1,76	-1,8% ▼	2.209.640	161% ▲	907.289	155% ▲
DLR082021	100,55	-2,10	-2,0% ▼	715.256	32% ▲	337.099	59% ▲
DLR092021	103,50	-2,05	-1,9% ▼	464.544	-4% ▼	264.916	21% ▲
DLR102021	106,80	-2,00	-1,8% ▼	556.978	92% ▲	238.483	30% ▲
DLR112021	110,75	-2,25	-2,0% ▼	543.371	62% ▲	323.962	53% ▲
DLR122021	115,00	-2,46	-2,1% ▼	171.667	33% ▲	138.010	9% ▲
DLR012022	119,00	-3,00	-2,5% ▼	94.097	-41% ▼	39.860	6% ▲
DLR022022	123,50	-3,71	-2,9% ▼	52.562	174% ▲	19.425	110% ▲
DLR052022	135,30	-6,70	-4,7% ▼	53.570	Inf% ▲	5.398	Inf% ▲
DLR062022	139,20	N/C	N/C	0	N/C	0	N/C
PROMEDIO/TOTAL	N/C	-2,97	-2,5% ▼	7.676.967	8% ▲	2.276.576	0% ▲

Fuente: MtR

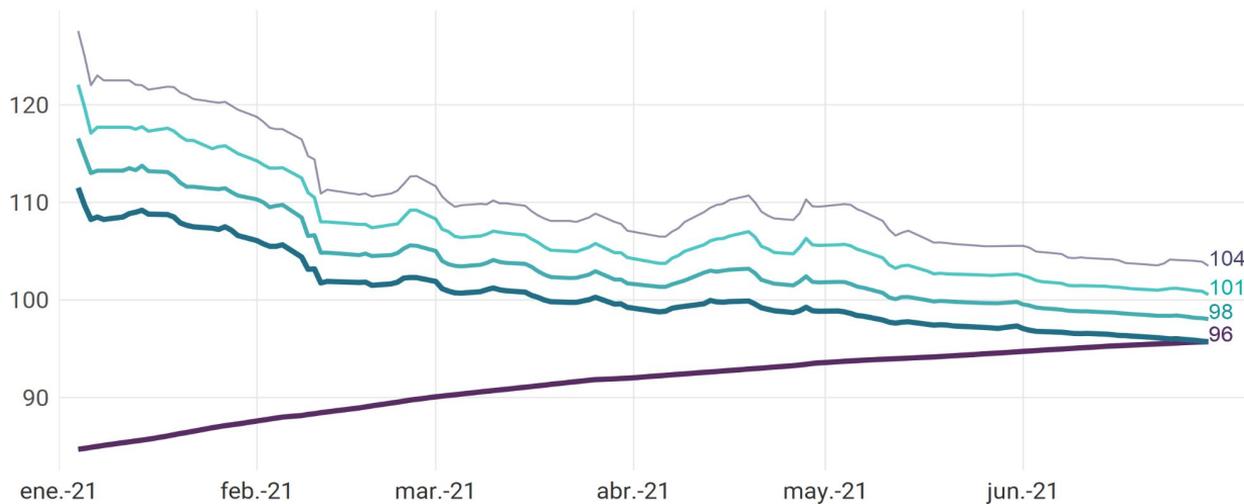
Dólar: Cotizaciones

Futuros

Cotizaciones de Futuros de Dólar

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

Spot DLR062021 DLR072021 DLR082021 DLR092021

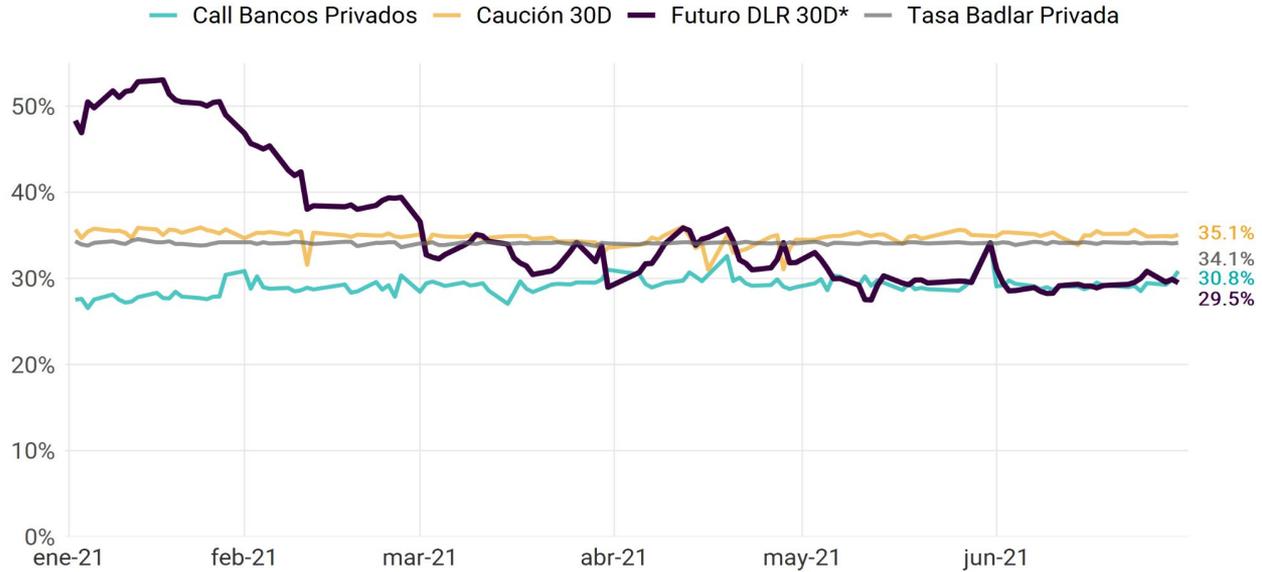


Fuente: MtR

Dólar: Evolución de tasas

Futuros

Evolución de Tasas Seleccionadas (TNA)



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

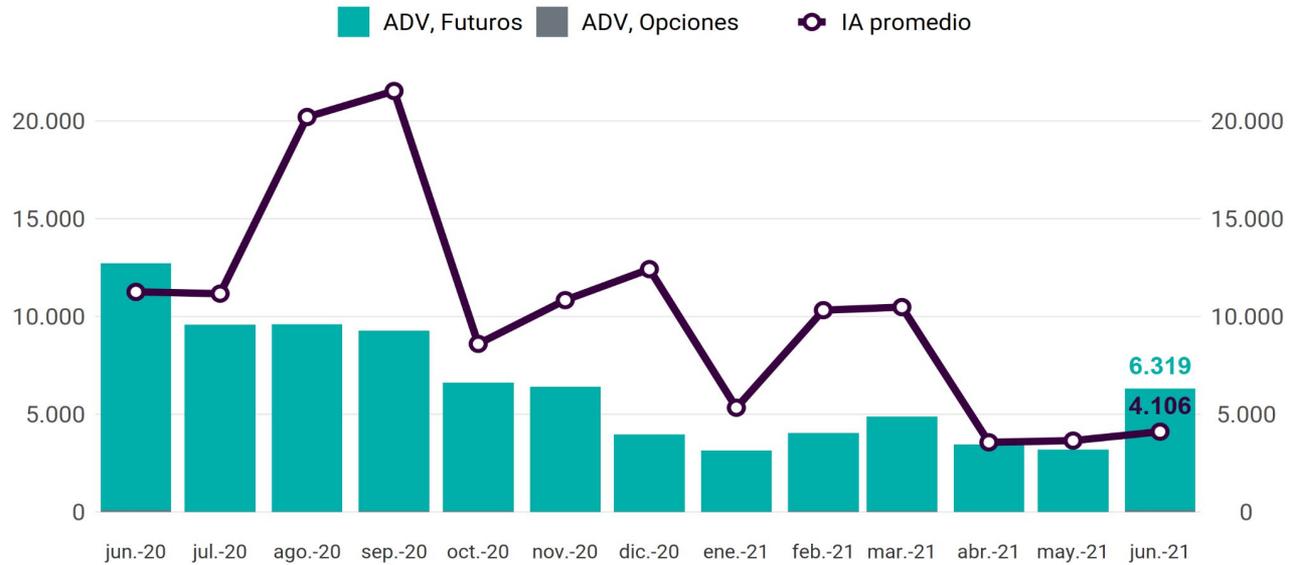
RFX20: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

Futuros y Opciones de RFX20

Evolución por mes, en contratos

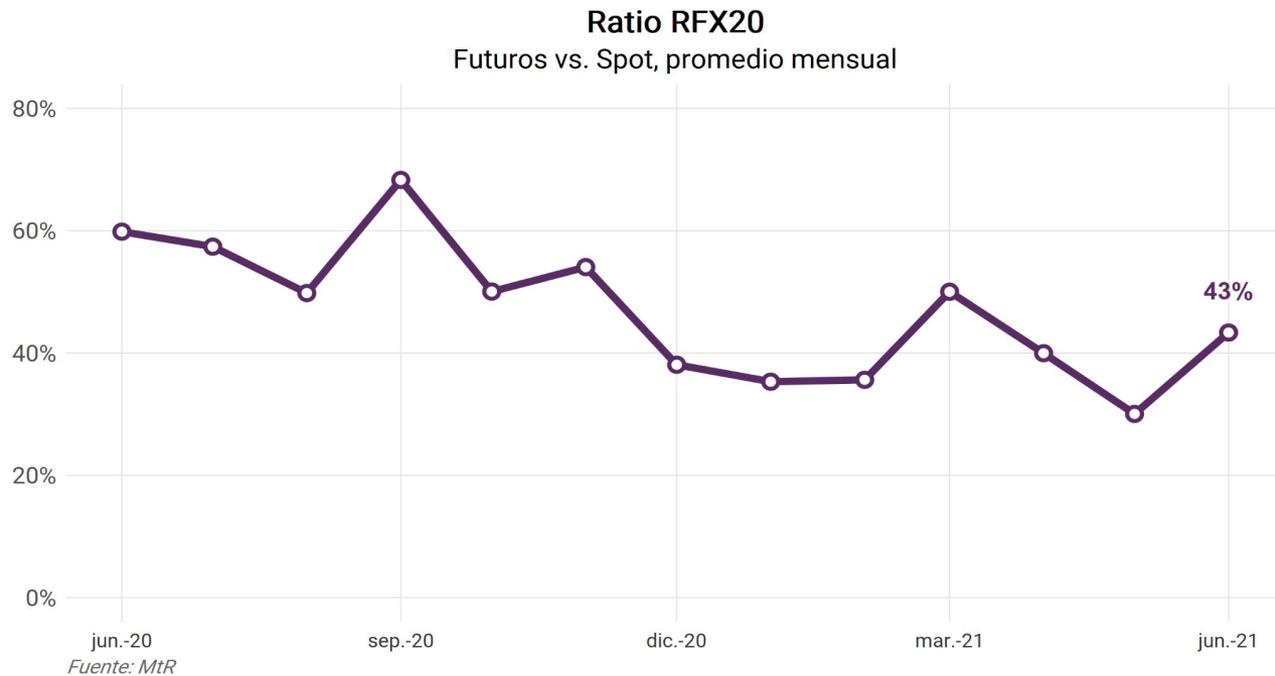


Fuente: MtR

RFX20: Ratio

Futuros

Matba Rofex



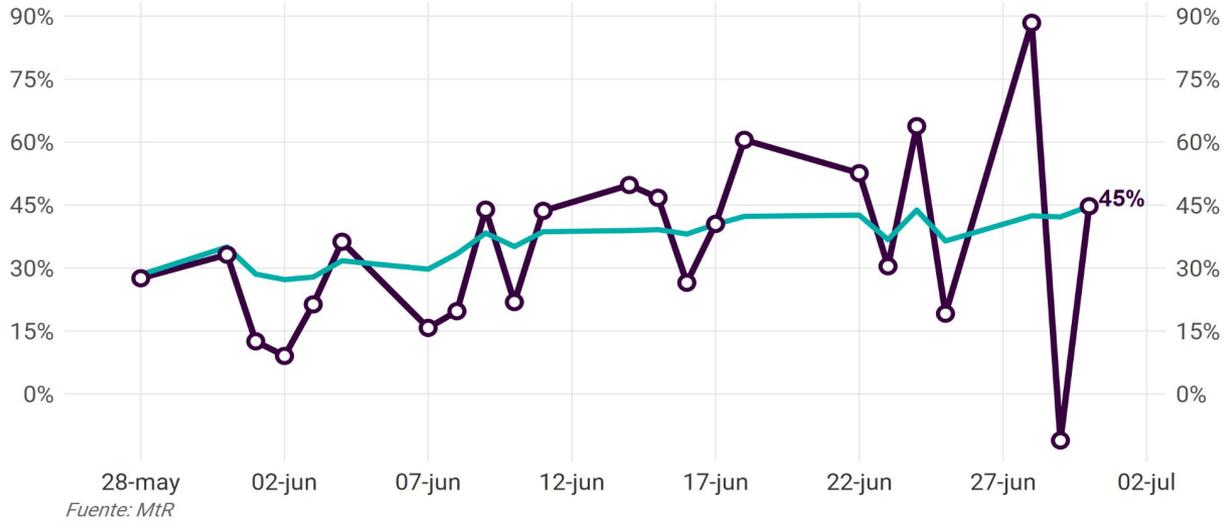
RFX20: Tasas implícitas

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

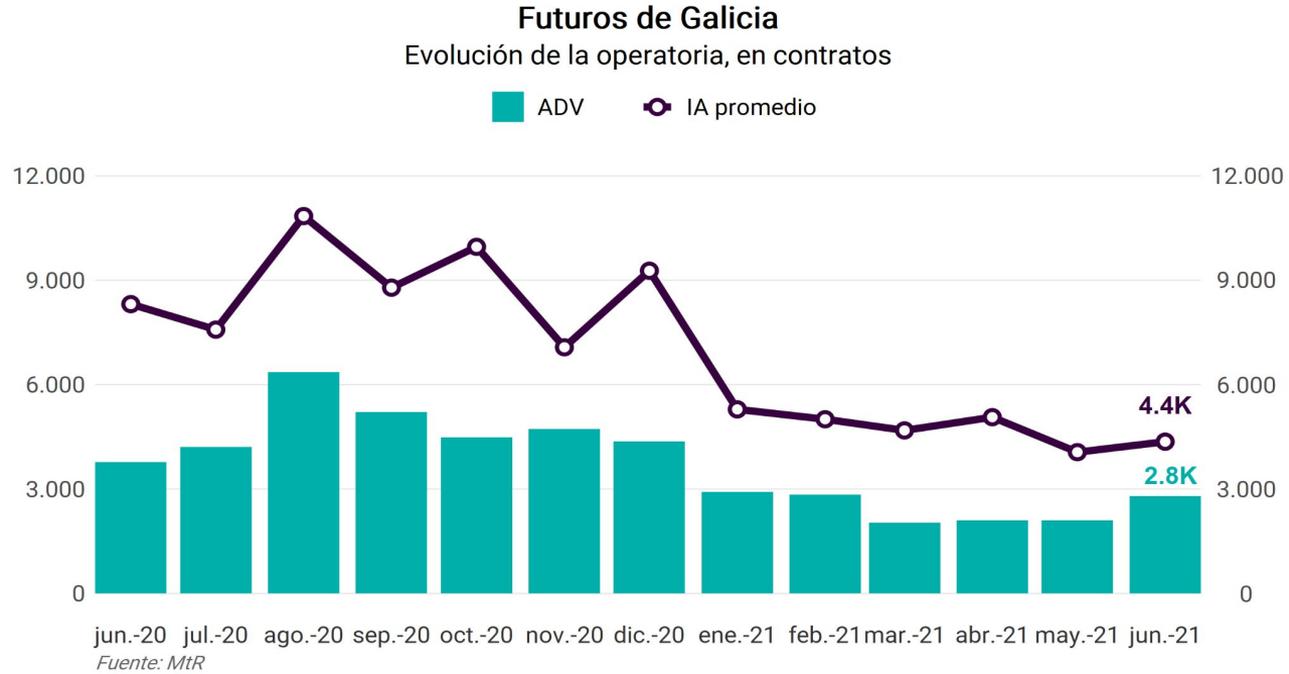


Principales Índices Accionarios Mundiales
Medido en Dólares*, base 100 desde inicio del año



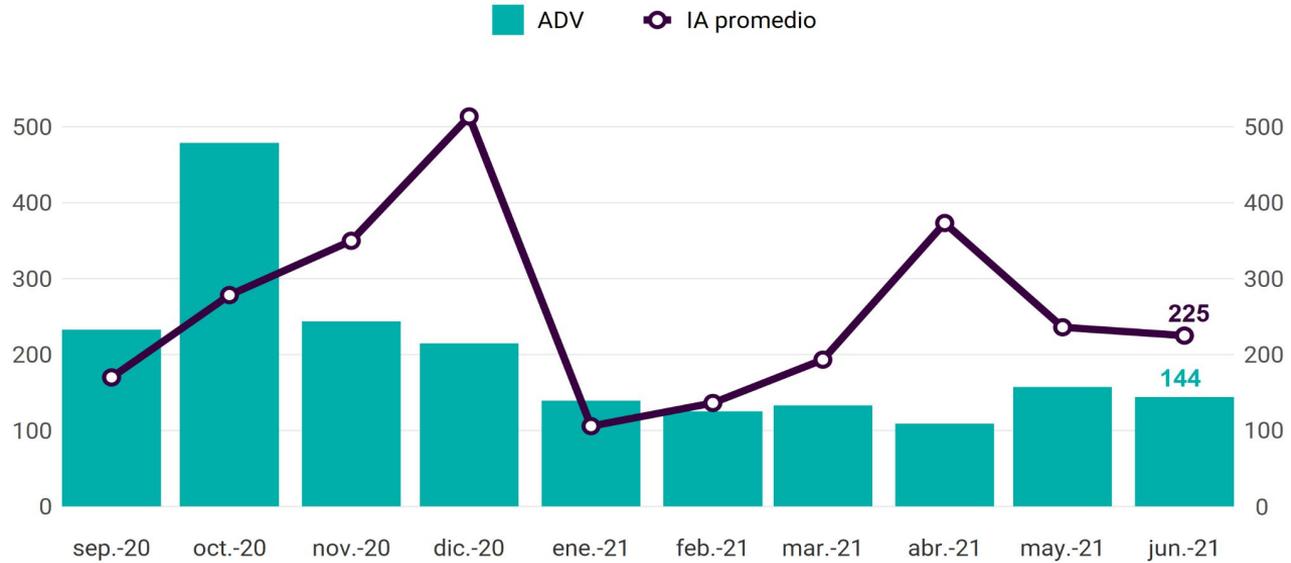
Fuente: MTR y Reuters

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

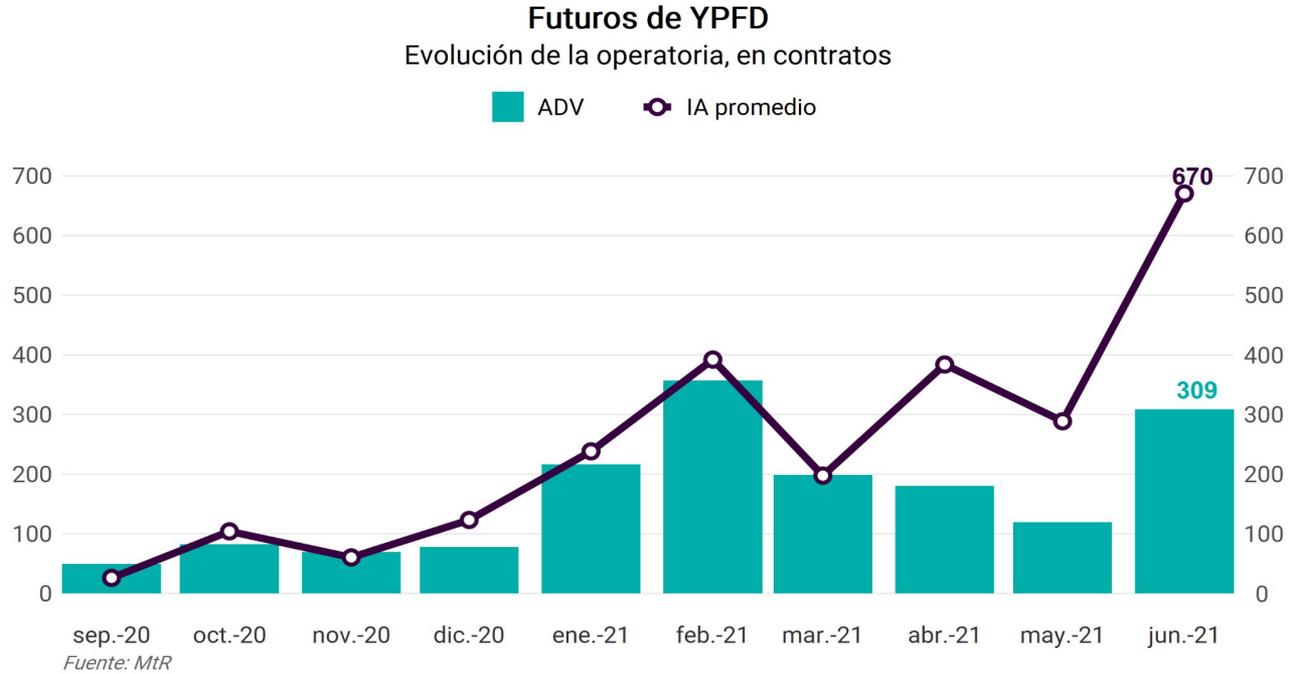


Futuros de Pampa Energía

Evolución de la operatoria, en contratos

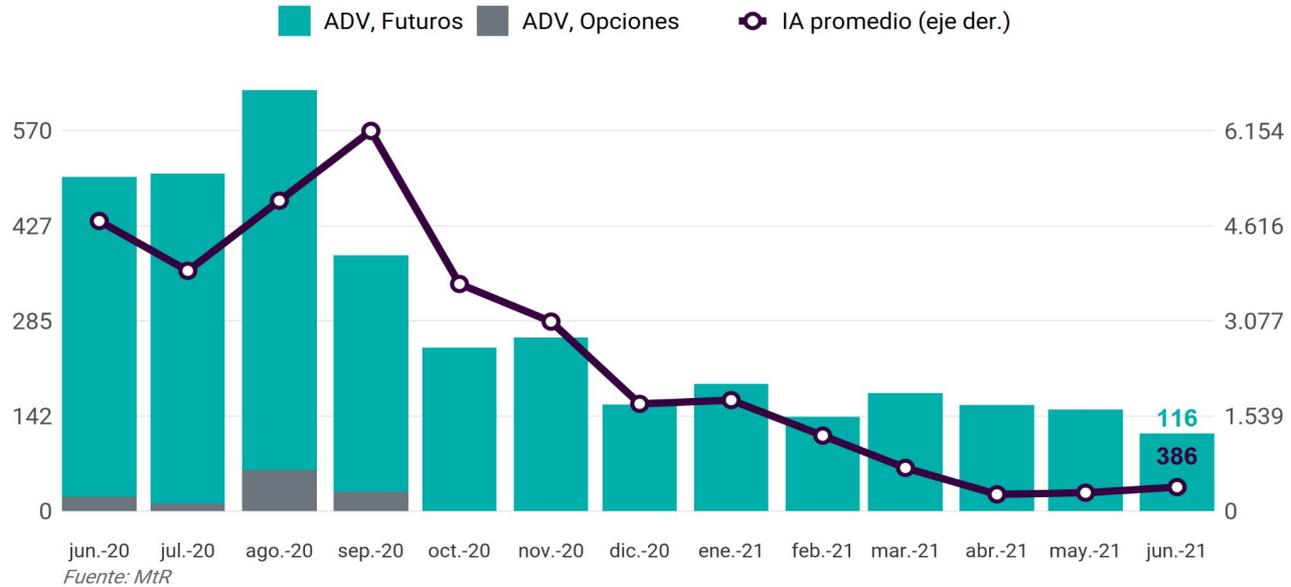


Fuente: MTR



Futuros y Opciones de Oro

Evolución por mes, en contratos



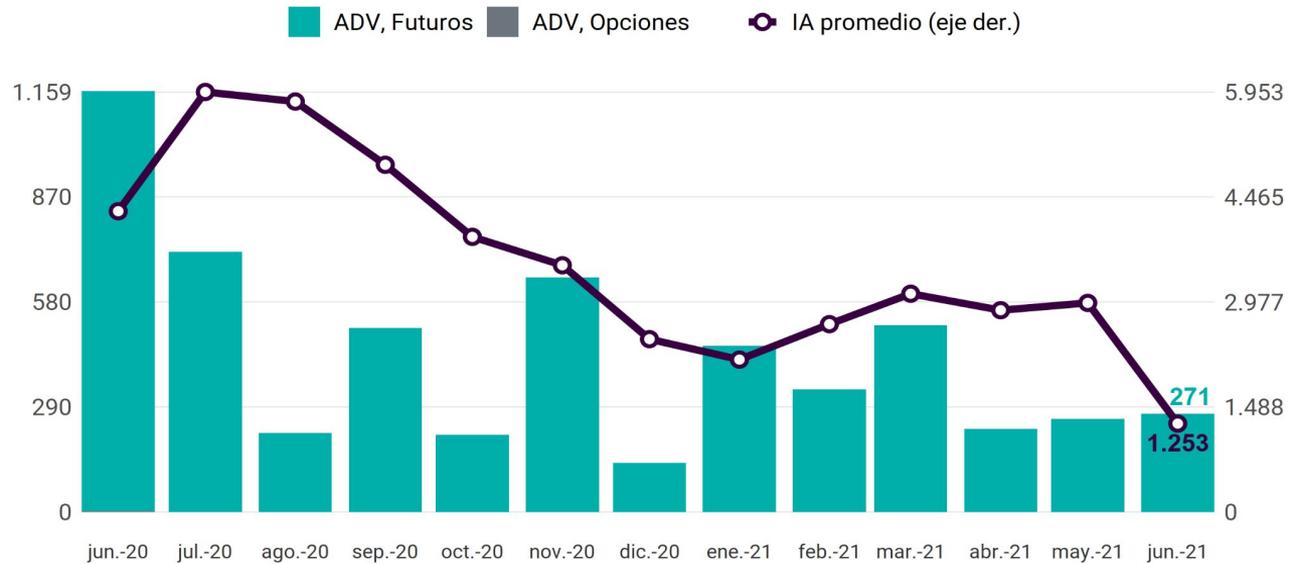
Petróleo: Operatoria

Futuros y Opciones

MatbaRofex

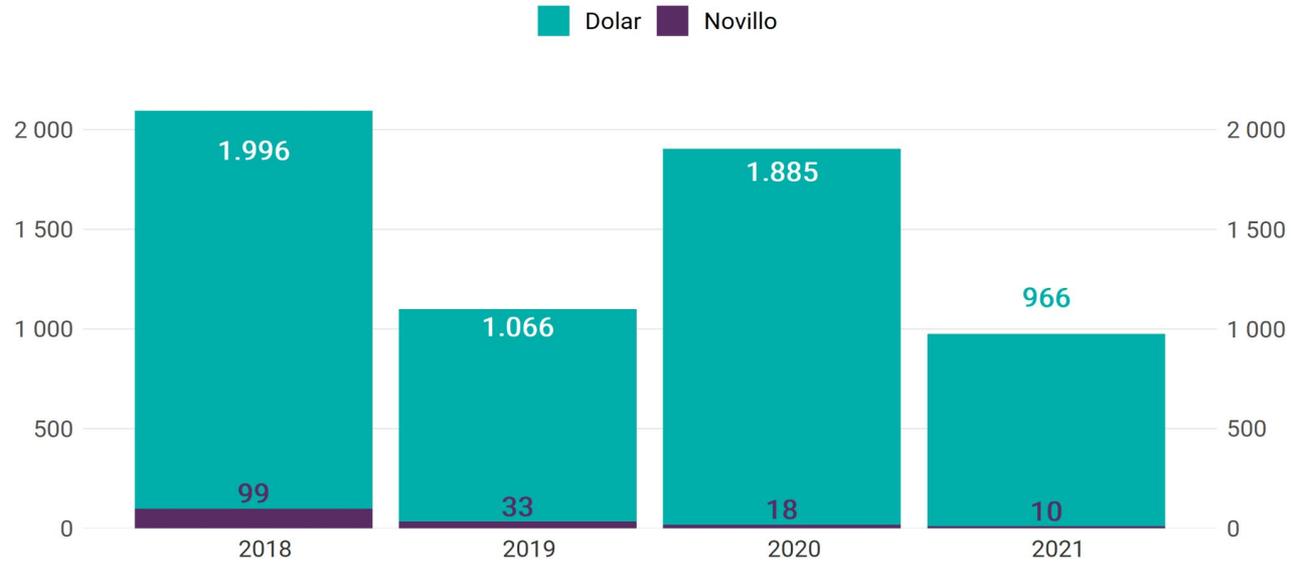
Futuros y Opciones de Petróleo

Evolución por mes, en contratos



Fuente: Mtr

Volumen acumulado anual UFEX
Datos hasta junio 2021, 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

Juan Francisco Gómez
Responsable

Camila Ajler
Analista

Valentín Bruzzoni
Analista

Jacqueline Najar
Analista