

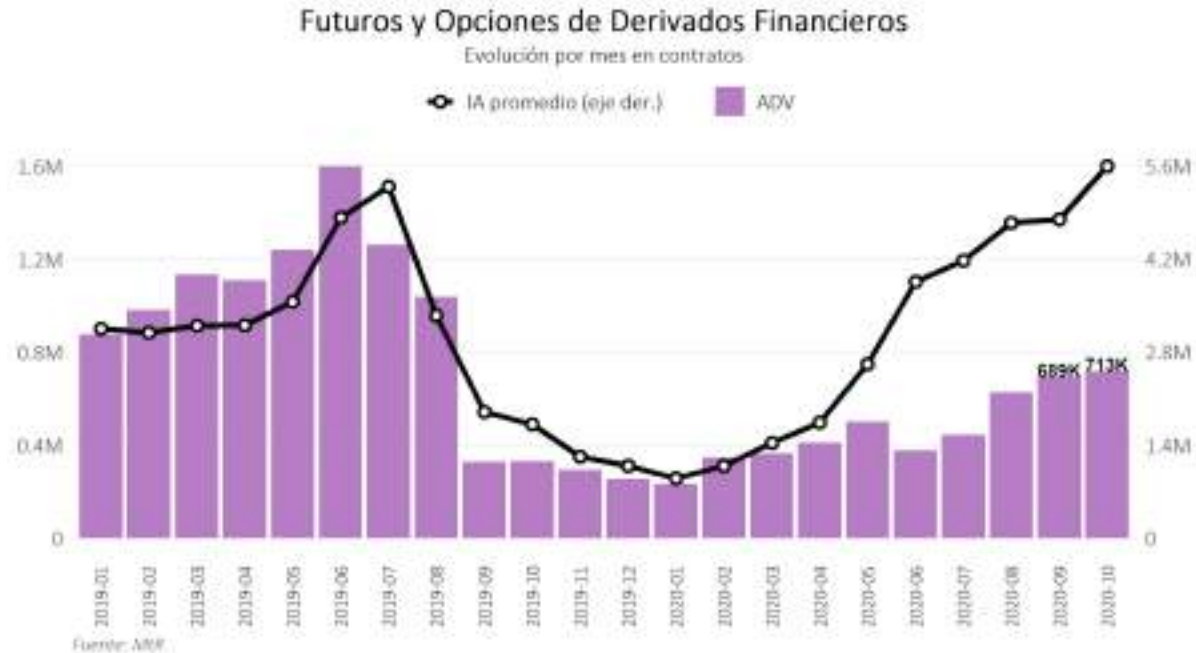


Informe Mensual Derivados Financieros Octubre 2020

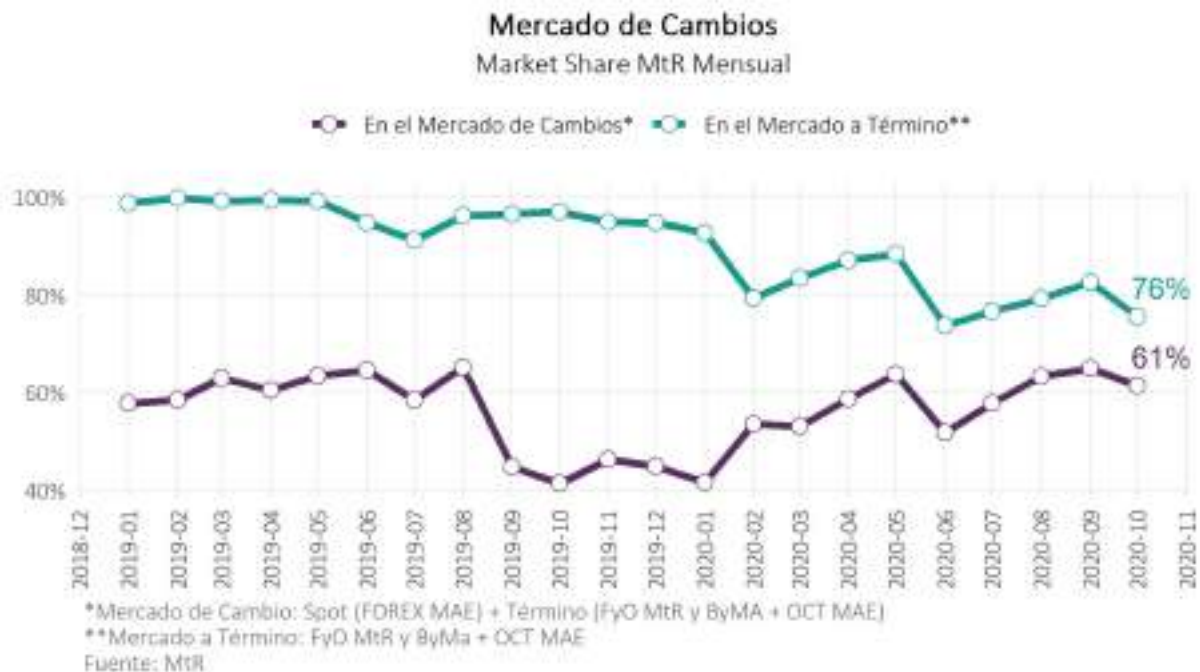
HIGHLIGHTS DEL MES

- ✓ *El volumen total de Derivados Financieros alcanzó en octubre 15 millones de contratos, un 1,2% inferior al mes anterior y un 108% superior a octubre 2019.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de los futuros y opciones de dólar alcanzó 5,6 millones de contratos, un 17,7% superior al mes anterior y un 226,4% superior al mismo período del año anterior.*
- ✓ *El interés abierto promedio diario de los futuros de acciones individuales alcanzó 10.342 contratos en el mes (+16% MoM y +2.625% YoY).*
- ✓ *El 19/10 se listaron los futuros de Yuan Renminbi (CNH).*

Visión General de la División Financiera						
En contratos						
	Volumen			Interés Abierto Promedio Diario		
	Oct 2020	MoM	YoY	Oct 2020	MoM	YoY
Monedas	14,7M	-0,6%	111,0%	5,6M	17,1%	226,4%
Índices Accionarios	138,9K	-31,8%	-2,3%	8,6K	-60,1%	279,1%
Acciones Individuales	106,1K	-10,5%	948,7%	10,3K	16,1%	2.625,7%
Metales	5,1K	-39,0%	-57,8%	3,7K	-40,3%	70,1%
Energía	4,5K	-60,1%	-91,4%	3,9K	-20,8%	-13,5%
Total	15,0M	-1,2%	108,1%	5,6M	16,6%	226,2%
Fuente: MtR						



El Volumen Promedio Diario (“ADV” por su siglas en inglés) de los Futuros y Opciones financieras alcanzó 713 mil contratos en el mes (+3,5% MoM y +118% YoY), con un interés abierto promedio de 5,6 millones de contratos por día (+16,6% MoM y +226% YoY).



La operatoria del conjunto de mercados a término de dólar (MtR, MAE y ByMA) alcanzó US\$ 19.477 millones (+8,7% MoM y +170,8% YoY). MtR representó el 76% de los negocios a término y un 61% del total operado de la divisa en el mercado de contado y a término.



El volumen operado de futuros y opciones de dólar promedió 701 mil contratos (+4,1% MoM), con un IA promedio de 5,6 millones de contratos por día (+17,1% MoM).

Futuros de Dólar al 30/10/2020
Evolución Mensual por Posición, Precio, Volumen e Interés Abierto.

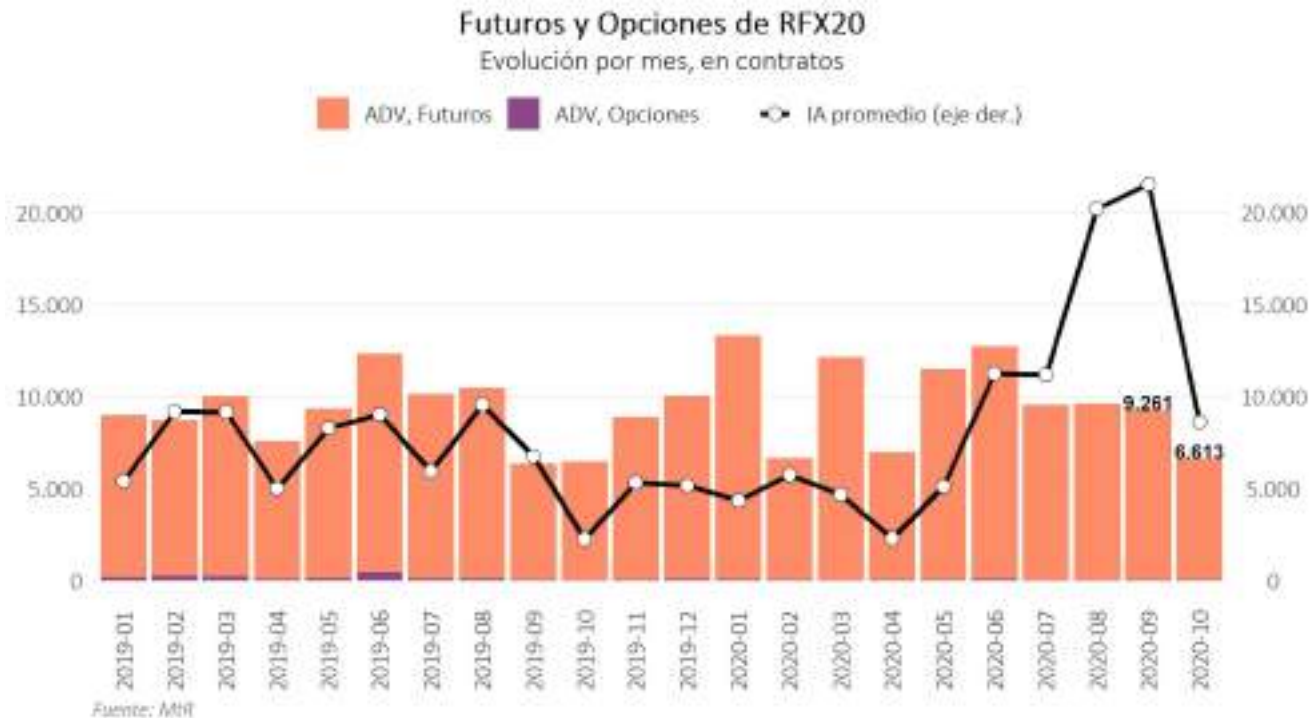
POSICIÓN	Último Ajuste			Volumen Mensual		IA al Cierre	
	Ajuste	Var.Men.\$	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%	Contratos	Var.Men.%
DLR102020	78.328	▼ -0,282	▼ -0,4%	5.097.979	▼ -11,7%	0	▼ -100,0%
DLR112020	83.300	▲ 1,480	▲ 1,8%	4.046.369	▲ 225,2%	2.061.770	▲ 278,6%
DLR122020	87.430	▲ 2,240	▲ 2,6%	2.720.578	▲ 102,0%	1.484.928	▲ 123,3%
DLR012021	92.440	▲ 3,770	▲ 4,3%	1.336.397	▲ 62,4%	627.203	▲ 201,0%
DLR022021	97.500	▲ 5,350	▲ 5,8%	784.745	▲ 51,3%	346.800	▲ 199,3%
DLR032021	102.600	▲ 6,300	▲ 6,5%	376.429	▲ 46,0%	123.413	▲ 184,7%
DLR042021	110.300	▲ 10,740	▲ 10,8%	171.690	▲ 47,3%	38.399	▲ 114,6%
DLR052021	117.500	▲ 13,650	▲ 13,1%	50.560	▲ 25,8%	21.241	▲ 73,7%
DLR062021	125.000	▲ 18,040	▲ 16,9%	35.899	▼ -58,8%	7.413	▼ -43,3%
DLR072021	132.300	▲ 22,100	▲ 20,1%	55.038	▲ 82,6%	2.066	▼ -84,3%
DLR082021	138.850	▲ 25,850	▲ 22,9%	20.586	▲ 1.797,3%	978	▲ 10,5%
DLR092021	144.000			22.530		2.289	
PROMEDIO/TOTAL		▲ 9,931	▲ 9,5%	14.718.800	▼ -11,8%	4.736.490	▲ 4,2%

Fuente: MIR

El promedio de las cotizaciones de las posiciones de dólar futuro aumentó un 9,5%.



En un escenario de reducida volatilidad, el tipo de cambio de referencia mayorista relevado por el BCRA (Com. A 3500) aumentó 2,8% en el mes hasta 78,33 pesos por dólar.



El ADV del los FyO de ROFEX 20 se ubicó en 6.613 contratos (-28,6% MoM), con un interés abierto promedio de 8.598 contratos por día (-60% MoM).