

août 2020

Produits dérivés sur taux d'intérêt

Produits dérivés sur indices

Produits dérivés sur actions

	Volume mensuel					Volume - année en cours				Intérêt en cours de fin de mois					Transactions	
	Août 2020	Août 2019	% VAR	Juillet 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019	Août 2020	Août 2019	% VAR	Juillet 2020	% VAR	Août 2020	A-à-D 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 272 762	2 430 770	-47,64%	948 567	34,18%	16 838 543	19 883 502	-15,31%	29 816 722	1 045 645	1 071 043	-2,37%	983 494	6,32%	84 555	1 549 374
CRA	1 392	0	N/D	216	544,44%	4 200	0	N/D	0	3 274	0	N/D	2 595	26,17%	45	138
Total	1 274 154	2 430 770	-47,58%	948 783	34,29%	16 842 743	19 883 502	-15,29%	29 816 722	1 048 919	1 071 043	-2,07%	986 089	6,37%	84 600	1 549 512
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	16 628	88 486	-81,21%	18 052	-7,89%	610 348	525 415	16,17%	1 034 240	109 832	298 989	-63,27%	112 025	-1,96%	20	799
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
CGF	440 451	513 679	-14,26%	291 088	51,31%	3 758 319	2 386 216	57,5%	4 130 134	56 116	47 209	18,87%	59 656	-5,93%	70 060	679 527
CGB	3 427 524	3 890 251	-11,9%	1 789 936	91,49%	22 093 478	22 156 880	-0,29%	31 684 621	573 366	567 041	1,12%	606 637	-5,48%	940 193	8 214 093
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	3 867 975	4 403 930	-12,17%	2 081 034	85,87%	25 851 797	24 543 096	5,33%	35 814 755	629 482	614 250	2,48%	666 293	-5,53%	1 010 253	8 893 620
Options sur obligations - OGB	3 222	1 525	111,28%	1 318	144,46%	25 958	11 614	123,51%	16 876	3 222	1 960	64,39%	3 585	-10,13%	5	48
Contrats à terme sur indices																
SXF	289 677	509 871	-43,19%	372 897	-22,32%	5 294 627	4 691 438	12,86%	7 805 301	299 595	307 563	-2,59%	294 185	1,84%	251 702	3 609 412
SXM	326	5 432	-94%	277	17,69%	10 658	37 903	-72,24%	51 559	563	704	-20,03%	567	-0,71%	165	3 369
SMJ	0	0	N/D	0	N/D	19	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	16
SCF	0	1	-100%	0	N/D	21	4	425%	16	0	0	N/D	0	N/D	0	13
SXA	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXH	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXY	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXK	0	0	N/D	0	N/D	10 000	2 980	-100%	3 266	10 143	1 490	580,74%	10 143	0%	0	0
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	3 716	-100%	3 716	0	1 404	-100%	0	N/D	0	0
Total	290 003	515 304	-43,72%	373 174	-22,29%	5 315 235	4 736 041	12,23%	7 863 858	310 301	311 161	-0,28%	304 895	1,77%	251 867	3 612 826
Options sur indices																
SXJ	340	0	N/D	0	N/D	340	0	N/D	0	340	0	N/D	0	N/D	1	1
SXO	0	7 546	-100%	0	N/D	4 836	50 192	-90,37%	62 055	0	5 549	-100%	0	N/D	0	17
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	9 700	-100%	9 700	0	68 447	-100%	0	N/D	0	0
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	5	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	340	7 546	-95,49%	0	N/D	5 176	59 892	-91,36%	71 760	340	73 996	-99,54%	0	N/D	1	18
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	5 545	-100%	6 045	0	360	-100%	0	N/D	0	0
Options sur FNB	529 267	716 737	-26,16%	795 094	-33,43%	6 290 787	5 530 920	13,74%	7 986 880	1 549 887	1 096 240	41,38%	1 562 806	-0,83%	4 616	48 337
Contrats à terme sur actions	365 552	266 729	37,05%	857 223	-57,36%	9 643 329	2 500 062	285,72%	4 413 772	242 230	181 670	33,34%	352 221	-31,23%	93	1 320
Options sur actions	1 574 856	2 338 826	-32,67%	1 741 029	-9,55%	16 397 020	19 565 148	-16,19%	29 142 959	3 739 394	4 040 741	-7,46%	3 710 553	0,78%	114 705	1 056 759
Options sur devises - USX	619	117	429,06%	245	152,65%	14 160	1 366	936,6%	2 184	1 794	1 178	52,29%	1 813	-1,05%	22	284
Total contrats à terme	5 797 684	7 616 733	-23,88%	4 260 214	36,09%	57 653 104	51 668 246	11,58%	77 915 152	2 230 932	2 178 484	2,41%	2 309 498	-3,4%	1 346 813	14 057 278
Total options	2 124 932	3 153 237	-32,61%	2 555 738	-16,86%	23 343 449	25 694 355	-9,15%	38 254 899	5 404 469	5 513 104	-1,97%	5 390 782	0,25%	119 369	1 106 245
Grand total	7 922 616	10 769 970	-26,44%	6 815 952	16,24%	80 996 553	77 362 601	4,7%	116 170 051	7 635 401	7 691 588	-0,73%	7 700 280	-0,84%	1 466 182	15 163 523

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Août 2020	Août 2019	% VAR	Juillet 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	63 638	115 750	-45,02%	43 116	47,6%	100 229	118 354	-15,31%	119 266
CRA	69	0	N/D	9	666,67%	76	0	N/D	0
Total	63 707	115 750	-44,96%	43 126	47,72%	100 254	118 354	-15,29%	119 266
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	831	4 213	-80,28%	820	1,34%	3 633	3 127	16,18%	4 136
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
CGF	22 022	24 460	-9,97%	13 231	66,44%	22 370	14 203	57,5%	16 520
CGB	171 376	185 250	-7,49%	81 360	110,64%	131 508	131 886	-0,29%	126 738
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	193 398	209 710	-7,78%	94 592	104,46%	153 879	146 089	5,33%	143 259
Options sur obligations - OGB	161	72	123,61%	59	172,88%	154	69	123,19%	67
Contrats à terme sur indices									
SXF	14 483	24 279	-40,35%	16 949	-14,55%	31 515	27 924	12,86%	31 096
SXM	16	258	-93,8%	12	33,33%	62	225	-72,44%	205
SMJ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SCF	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXA	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXH	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXY	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXK	0	0	N/D	0	N/D	60	17	-100%	13
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	22	-100%	14
Total	14 500	24 538	-40,91%	16 962	-14,52%	31 638	28 190	12,23%	31 330
Options sur indices									
SXJ	17	0	N/D	0	N/D	2	0	N/D	0
SXO	0	359	-100%	0	N/D	28	298	-90,6%	248
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	153	-100%	68
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	17	359	-95,27%	0	N/D	30	356	-91,57%	285
Contrats à terme sur FNB	26 463	34 130	-22,46%	36 140	-26,78%	37 445	32 922	13,74%	31 820
Options sur FNB	36 140	20 616	75,3%	33 231	8,75%	38 929	32 749	18,87%	31 820
Contrats à terme sur actions	18 277	12 701	43,9%	38 964	-53,09%	57 400	14 881	285,73%	17 584
Options sur actions	78 742	111 372	-29,3%	79 137	-0,5%	97 601	116 459	-16,19%	116 107
Options sur devises - USX	30	5	500%	11	172,73%	84	8	950%	8
Total contrats à terme	289 884	362 701	-20,08%	193 646	49,7%	343 173	307 549	11,58%	310 418
Total options	106 246	150 154	-29,24%	116 169	-8,54%	138 949	152 942	-9,15%	152 409
Grand total	396 130	512 855	-22,76%	309 816	27,86%	482 122	460 491	4,7%	462 828

Liste des produits

Dérivés sur taux d'intérêt à court terme

BAX : Contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois

CRA : Contrats à terme de trois mois sur le taux CORRA

OBX : Options sur contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois

Dérivés sur obligations

CGZ : Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de deux ans

CGF : Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de cinq ans

CGB : Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de dix ans

LGB : Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de 30 ans

OGB : Options sur contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada de dix ans

Dérivés sur indices

SXF : Contrats à terme standard sur l'indice S&P/TSX 60

SXM : Contrats à terme mini sur l'indice S&P/TSX 60

SCF : Contrats à terme mini sur l'indice composé S&P/TSX

SMJ : Contrats à terme sur l'indice international S&P/MX du cannabis

SXA : Contrats à terme sur l'indice aurifère global S&P/TSX

SXB : Contrats à terme sur l'indice plafonné des services financiers S&P/TSX

SXH : Contrats à terme sur l'indice plafonné de la technologie de l'information S&P/TSX

SXY : Contrats à terme sur l'indice plafonné de l'énergie S&P/TSX

SXO : Options sur l'indice S&P/TSX 60 (Multiplicateur = 100)

SXO1 : Options Mini sur indices S&P/TSX 60 (Multiplicateur = 10)

EMF : Contrats à terme sur l'indice FTSE Marchés émergents

SXK : Contrats à terme sur l'Indice Composé S&P/TSX Banques (groupe industriel)

SXJ : Options sur l'Indice Composé S&P/TSX Banques (groupe industriel)

SXU : Contrats à terme sur l'Indice plafonné des services aux collectivités S&P/TSX

SXV : Options sur l'Indice plafonné des services aux collectivités S&P/TSX

Options sur devises

USX : Options sur le dollar US

Options sur FNB

Contrats à terme sur actions

Options sur actions

Les statistiques au présent rapport portent sur des données exécutées.

BAX^{MD}, ONX^{MD}, OBX^{MD}, CGZ^{MD}, CGF^{MD}, CGB^{MD}, LGB^{MD}, OGB^{MD} et USX^{MD} sont des marques enregistrées de Bourse de Montréal Inc.

OIS-MX^{MC}, SXF^{MC}, SXM^{MC}, SCF^{MC}, SXA^{MC}, SXB^{MC}, SXH^{MC}, SXY^{MC}, SXKMC, SXJMC, SXUMC, SXVMC, EMFMC et SXO^{MC} sont des marques de commerce de Bourse de Montréal Inc.