

juillet 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	
	Juillet 2020	Juillet 2019	% VAR	Juin 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019	Juillet 2020	Juillet 2019	% VAR	Juin 2020	% VAR	Juillet 2020	A-à-D 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	948 567	2 374 031	-60,04%	1 655 602	-42,71%	15 565 781	17 452 732	-10,81%	29 816 722	983 494	1 040 290	-5,46%	900 145	9,26%	78 264	1 464 819
CRA	216	0	N/D	2 592	-91,67%	2 808	0	N/D	0	2 595	0	N/D	2 447	6,05%	20	93
Total	948 783	2 374 031	-60,04%	1 658 194	-42,78%	15 568 589	17 452 732	-10,8%	29 816 722	986 089	1 040 290	-5,21%	902 592	9,25%	78 284	1 464 912
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	18 052	51 666	-65,06%	19 007	-5,02%	593 720	436 929	35,89%	1 034 240	112 025	253 453	-55,8%	114 129	-1,84%	72	779
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	291 098	301 103	-3,32%	381 851	-23,77%	3 317 868	1 872 537	77,19%	4 130 134	59 656	50 384	18,4%	58 913	1,26%	65 458	609 467
CGB	1 789 936	1 963 697	-8,85%	2 092 171	-14,45%	18 665 954	18 266 629	2,19%	31 684 621	606 637	621 874	-2,45%	552 923	9,72%	810 722	7 273 900
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 081 034	2 264 800	-8,11%	2 474 022	-15,89%	21 983 822	20 139 166	9,16%	35 814 755	666 293	672 258	-0,89%	611 836	8,9%	876 180	7 883 367
Options sur obligations - OGB	1 318	944	39,62%	999	31,93%	22 736	10 089	125,35%	16 876	3 585	3 606	-0,58%	3 467	3,4%	5	43
Contrats à terme sur indices																
SXF	372 897	397 108	-6,10%	1 029 940	-63,79%	5 004 950	4 181 567	19,70%	7 805 301	294 185	311 986	-5,71%	285 960	2,88%	322123	3357710
SXM	277	1 822	-84,8%	1 906	-85,47%	10 197	32 471	-68,6%	51 559	567	630	-10%	581	-2,41%	154	3 204
SMJ	0	0	N/D	0	N/D	19	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	16
SCF	0	0	N/D	18	-100%	21	3	600%	16	0	1	-100%	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	373 174	398 930	-6,46%	1 041 864	-64,18%	5 025 232	4 220 737	19,06%	7 863 858	304 895	315 511	-3,37%	296 684	2,77%	322 277	3 360 959
Options sur indices																
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXO	0	2 467	-100%	0	N/D	4 836	42 646	-88,66%	62 055	0	2 912	-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	0	2 467	-100%	0	N/D	4 836	52 346	-90,76%	71 760	0	71 359	-100%	0	N/D	0	17
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	795 094	453 554	75,3%	731 096	8,75%	5 761 520	4 814 183	19,68%	7 986 880	1 562 806	948 137	64,83%	1 535 989	1,75%	4 825	43 721
Contrats à terme sur actions	857 223	350 654	144,46%	2 573 379	-66,69%	9 277 777	2 233 333	315,42%	4 413 772	352 221	223 226	57,79%	739 780	-52,39%	119	1 227
Options sur actions	1 741 029	2 080 803	-16,33%	2 085 774	-16,53%	14 822 164	17 226 322	-13,96%	29 142 959	3 710 553	3 583 387	3,55%	3 964 663	-6,41%	123 292	942 054
Options sur devises - USX	245	146	67,81%	891	-72,5%	13 541	1 249	984,15%	2 184	1 813	1 155	56,97%	2 162	-16,14%	22	262
Total contrats à terme	4 260 214	5 388 415	-20,94%	7 747 459	-45,01%	51 855 420	44 051 513	17,72%	77 915 152	2 309 498	2 251 645	2,57%	2 550 892	-9,46%	1 276 860	12 710 465
Total options	2 555 738	2 589 580	-1,31%	2 837 767	-9,94%	21 218 517	22 541 118	-5,87%	38 254 899	5 390 782	4 861 097	10,9%	5 620 410	-4,09%	128 216	986 876
Grand total	6 815 952	7 977 995	-14,57%	10 585 226	-35,61%	73 073 937	66 592 631	9,73%	116 170 051	7 700 280	7 112 742	8,26%	8 171 302	-5,76%	1 405 076	13 697 341

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Juillet 2020	Juillet 2019	% VAR	Juin 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	43 116	107 910	-60,04%	75 254	-42,71%	105 174	118 726	-11,42%	119 266
CRA	9	0	N/D	199	-95,48%	80	0	N/D	0
Total	43 126	107 910	-60,04%	75 372	-42,78%	105 193	118 726	-11,4%	119 266
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	820	2 348	-65,08%	863	-4,98%	4 011	2 972	34,96%	4 136
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
CGF	13 231	13 686	-3,33%	17 356	-23,77%	22 418	12 738	75,99%	16 520
CGB	81 360	89 258	-8,85%	95 098	-14,45%	126 121	124 262	1,5%	126 738
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	94 592	102 945	-8,11%	112 455	-15,89%	148 539	137 001	8,42%	143 259
Options sur obligations - OGB	59	42	40,48%	45	31,11%	153	68	125%	67
Contrats à terme sur indices									
SXF	16 949	18 049	-6,10%	46 815	-63,80%	33 816	28 445	18,88%	31 096
SXM	12	82	-85,37%	86	-86,05%	68	220	-69,09%	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	68	20	-100%	13
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	25	-100%	14
Total	16 962	18 133	-6,46%	47 357	-64,18%	33 954	28 712	18,26%	31 330
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXO	0	112	-100%	0	N/D	32	290	-88,97%	248
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	230	-100%	68
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	0	112	-100%	0	N/D	32	356	-91,01%	285
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	37	-100%	24
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	38 964	15 938	144,47%	116 971	-66,69%	62 687	15 192	312,63%	17 584
Options sur actions	79 137	94 581	-16,33%	94 807	-16,53%	100 149	117 185	-14,54%	116 107
Options sur devises - USX	11	6	83,33%	40	-72,5%	91	8	1 037,5%	8
Total contrats à terme	193 646	244 927	-20,94%	352 157	-45,01%	350 374	299 670	16,92%	310 418
Total options	116 169	117 708	-1,31%	128 989	-9,94%	143 368	153 340	-6,5%	152 409
Grand total	309 816	362 636	-14,57%	481 146	-35,61%	493 742	453 011	8,99%	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.