

juin 2021

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	
	Jun 2020	Jun 2020	% VAR	Mai 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020	Jun 2021	Jun 2020	% VAR	Mai 2021	% VAR	Jun 2021	A-à-D 2021
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2695850	1655602	62.8%	1666531	61.8%	13786600	14617214	-5.7%	23026123	1346180	900145	49.6%	1348894	-0.2%	158374	805974
CRA	5331	2592	105.7%	780	583.5%	15483	2592	497.3%	13077	4186	2447	71.1%	6942	-39.7%	69	435
Total	2701181	1658194	62.9%	1667311	62.0%	13802083	14619806	-5.6%	23039200	1350366	902592	49.6%	1355836	-0.4%	158443	806409
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	10000	19007	-47.4%	773	1193.7%	128126	575668	-77.7%	714811	78902	114129	-30.9%	101427	-22.2%	23	174
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	129138	0		148112	-12.8%	1011297	0	22.0%	97912	35652	0		38530	-7.5%	3791	18175
CGF	612504	381851	60.4%	642224	-4.6%	3691162	3026770	22.0%	5471435	98323	59913	66.9%	84261	16.7%	115143	625330
CGB	2274302	2092171	8.7%	4172764	-45.5%	18820921	16876018	11.5%	32067932	673731	552923	21.8%	705539	-4.5%	887728	6199529
LGB	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
Total	3015944	2474022	21.9%	4963100	-39.2%	23523380	19902788	18.2%	37637279	807706	611836	32.0%	828330	-2.5%	1006662	6843034
Options sur obligations - OGE	74	999	-92.6%	432	-82.9%	3038	21418	-85.8%	26740	506	3467	-85.4%	432	17.1%	2	12
Contrats à terme sur indices																
SXF	1013529	1029940	-1.6%	383010	164.6%	3568619	4632053	-23.0%	8177604	286267	285960	0.1%	292334	-2.1%	439457	2187437
SXM	1134	1906	-40.5%	524	116.4%	4148	9965	-58.4%	13344	391	581	-32.7%	392	-0.3%	266	1398
SEG	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
SDV	0	0		0		5701	0		0	5390	0		5390	0.0%	0	111
SMJ	0	0		0		0	19	-100.0%	19	0	0		0		0	0
SCF	3	18	-83.3%	0		5	21	-76.2%	21	1	0		2	-50.0%	2	3
SXA	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
SXB	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
SXH	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
SXY	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
SXK	0	10000	-100.0%	0		35000	10000	250.0%	59000	0	10143	-100%	19500	-100.0%	0	8
SXU	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
Total	1014666	1041864	-2.6%	383534	164.6%	3613473	4652058	-22.3%	8249988	292049	296684	-1.6%	317618	-8.1%	439725	2188957
Options sur indices																
SXJ	0	0		0		0	0		340	0	0		0		0	0
SXO	0	0		0		0	4836	-100.0%	30476	12820	0		12820	0.0%	0	0
SXV	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
Total	0	0		0		0	4836	-100.0%	30816	12820	0		12820	0.0%	0	0
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
Options sur FNB	837077	731096	14.5%	1075767	-22.2%	5917565	4966426	19.2%	9359748	1930550	1534416	25.8%	1750885	10.3%	6994	42479
Contrats à terme sur actions	2444100	2573379	-5.0%	2052700	19.1%	11004824	8420554	30.7%	11707465	748825	739780	1.2%	761375	-1.6%	132	818
Options sur actions	3026840	2085774	45.1%	2695628	12.3%	16144188	13081135	23.4%	25059590	4812611	3964663	21.4%	4547684	5.8%	157057	1021817
Options sur devises - USX	3506	891	293.5%	3104	13.0%	12134	13296	-8.7%	24460	2278	2162	5.4%	2171	4.9%	54	225
Total contrats à terme	9175891	7747459	18.4%	9066645	1.2%	51943760	47595206	9.1%	80633932	3198946	2550892	25.4%	3263159	-2.0%	1604962	9839218
Total options	3877497	2837767	36.6%	3775704	2.7%	22205051	18662779	19.0%	35216165	6837667	5618837	21.7%	6415419	6.6%	164130	1064707
Grand total	13053388	10585226	23.3%	12842349	1.6%	74148811	66257985	11.9%	115850097	10036613	8169729	22.9%	9678578	3.7%	1769092	10903925

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Jun 2021	Jun 2020	% VAR	Mai 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	122539	75255	62.8%	83327	47.1%	110293	116010	-4.9%	91738
CRA	242	199	21.5%	39	521.3%	124	199	-37.9%	95
Total	122781	75372	62.9%	83366	47.3%	110417	116030	-4.8%	91790
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	455	864	-47.4%	39	1076.1%	1025	4569	-77.6%	2848
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	5870	0		7406	-20.7%	8090	0		455
CGF	27841	17357	60.4%	32111	-13.3%	29529	24022	22.9%	21799
CGB	103377	95099	8.7%	208638	-50.5%	150567	133937	12.4%	127761
LGB	0	0		0		0	0		0
Total	137088	112456	21.9%	248155	-44.8%	188187	157959	19.1%	149949
Options sur obligations - OGB	3	45	-92.6%	22	-84.4%	24	170	-85.7%	107
Contrats à terme sur indices									
SXF	46070	46815	-1.6%	19151	140.6%	28549	36762	-22.3%	32451
SXM	52	87	-40.5%	26	96.7%	33	79	-58.0%	53
SEG	0	0		0		0	0		0
SDV	0	0		0		55	0		0
SMJ	0	0		0		0	0		0
SCF	0	1	-83.3%	0		0	0		0
SXA	0	0		0		0	0		0
SXB	0	0		0		0	0		0
SXH	0	0		0		0	0		0
SXY	0	0		0		0	0		0
SXK	0	455	-100.0%	0		280	79	252.8%	234
SXU	0	0		0		0	0	0.0%	0
Total	46121	47357	-2.6%	19177	140.5%	28908	36921	-21.7%	32738
Options sur indices									
SXJ	0	0		0		0	0		1
SXO	0	0		0		0	38	-100.0%	121
SXV	0	0		0		0	0		0
Total	0	0		0		0	38	-100.0%	122
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0		0
Options sur FNB	38049	33232	14.5%	53788	-29.3%	47341	39416	20.1%	37142
Contrats à terme sur actions	111095	116972	-5.0%	102635	8.2%	88039	66830	31.7%	46458
Options sur actions	137584	94808	45.1%	134781	2.1%	129154	103819	24.4%	99443
Options sur devises - USX	159	41	293.5%	155	2.7%	97	106	-8.0%	97
Total contrats à terme	417086	352157	18.4%	453332	-8.0%	415550	377740	10.0%	319976
Total options	176250	128989	36.6%	188785	-6.6%	177640	148117	19.9%	139747
Grand total	593336	481147	23.3%	642117	-7.6%	593190	525857	12.8%	459723

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

SEG : Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60 ESG

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.