

sept 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	
	Sept 2021	Sept 2020	% VAR	Août 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020	Sept 2021	Sept 2020	% VAR	Août 2021	% VAR	Sept 2021	A-à-D 2021
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2243227	1053776	112.9%	1406738	59.5%	19785843	17892319	10.6%	23026123	1178531	1046229	12.6%	1227249	-4.0%	140707	1197249
CRA	661	2364	-72.0%	2649	-75.0%	19951	6564	203.9%	13077	1944	3076	-36.8%	3756	-48.2%	13	498
Total	2243888	1056140	112.5%	1409387	59.2%	19805794	17898883	10.7%	23039200	1180475	1049305	12.5%	1231005	-4.1%	140720	1197747
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	8509	7200	18.2%	31600	-73.1%	213735	617548	-65.4%	714811	101497	67782	49.7%	107252	-5.4%	13	240
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	220549	0		158150	39.5%	1516648	0		97912	62856	0		27710	126.8%	5986	34636
CGF	639275	308367	107.3%	699633	-8.6%	5651546	4066696	39.0%	5471435	72281	67192	7.6%	87382	-17.3%	99628	927636
CGB	2468440	1882000	31.2%	4233195	-41.7%	27580580	23975478	15.0%	32067932	614506	620010	-0.9%	683034	-10.0%	1015466	9132492
LGB	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
Total	3328264	2190367	52.0%	5090978	-34.6%	34748774	28042164	23.9%	37637279	749643	687202	9.1%	798126	-6.1%	1121080	10094764
Options sur obligations - OGE	0	0	0.0%	450	-100.0%	3609	25958	-86.1%	26740	450	3222	-86.0%	450	0.0%	0	15
Contrats à terme sur indices																
SXF	1084246	1061240	2.2%	320548	238.2%	5374399	6355867	-15.4%	8177604	285606	291708	-2.1%	293120	-2.6%	526935	3348168
SXM	1391	1153	20.6%	346	302.0%	6355	11721	-45.8%	13344	491	252	94.8%	393	24.9%	399	2229
SEG	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
SDV	3800	0		75	4966.7%	9701	0		0	6971	0		5440	28.1%	31	152
SMJ	0	0		0		0	19	-100.0%	19	0	0		0	0.0%	0	0
SCF	12	0		0		17	21	-19.0%	21	1	0		1	0.0%	4	7
SXA	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
SXB	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
SXH	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
SXY	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
SXK	0	29000	-100.0%	0		35000	39000	-10.3%	59000	0	19000	-100%	0	0.0%	0	8
SXU	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
Total	1089449	1091393	-0.2%	320969	239.4%	5425472	6406628	-15.3%	8249988	293069	310960	-5.8%	298954	-2.0%	527369	3350564
Options sur indices																
SXJ	0	0		0		0	340	-100.0%	340	0	340	-100.0%	0	0.0%	0	0
SXO	0	17520	-100.0%	0		0	22356	-100.0%	30476	12820	17520	-27%	12820	0.0%	0	0
SXV	0	0		0		0	0		0	0	0		0	0.0%	0	0
Total	0	17520	-100.0%	0		0	22696	-100.0%	30816	12820	17860	-28%	12820	0.0%	0	0
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
Options sur FNB	950027	621862	52.8%	842447	12.8%	8605619	6912649	24.5%	9359748	2488244	1516463	64.1%	2318486	7.3%	7477	61459
Contrats à terme sur actions	2481800	214991	1054.4%	1560600	59.0%	16168284	9858320	64.0%	11707465	1042600	217921	378.4%	639975	62.9%	155	1172
Options sur actions	2833721	1656846	71.0%	2628645	7.8%	24124969	18053866	33.6%	25059590	5539928	3926412	41.1%	5136596	7.9%	142532	1404938
Options sur devises - USX	252	1538	-83.6%	342	-26.3%	13187	15698	-16.0%	24460	1147	1035	10.8%	1638	-30.0%	19	283
Total contrats à terme	9143401	4552891	100.8%	8381934	9.1%	76148324	62205995	22.4%	80633932	3265787	2265388	44.2%	2968060	10.0%	1789324	14644247
Total options	3792509	2304966	64.5%	3503484	8.2%	32961119	25648415	28.5%	35216165	8144086	5532774	47.2%	7577242	7.5%	150041	1466935
Grand total	12935910	6857857	88.6%	11885418	8.8%	109109443	87854410	24.2%	115850097	11409873	7798162	46.3%	10545302	8.2%	1939365	16111182

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Sept 2021	Sept 2020	% VAR	Août 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	112161	50180	123.5%	66988	67.4%	105807	94668	11.8%	91738
CRA	33	113	-70.6%	126	-73.8%	107	86	23.5%	95
Total	112194	50292	123.1%	67114	67.2%	105913	94703	11.8%	91790
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	425	343	24.1%	1505	-71.7%	1143	3267	-65.0%	2848
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	11027	0	0.0%	7531	46.4%	8110	0		455
CGF	31964	14684	117.7%	33316	-4.1%	30222	21517	40.5%	21799
CGB	123422	89619	37.7%	201581	-38.8%	147490	126854	16.3%	127761
LGB	0	0		0		0	0		0
Total	166413	104303	59.5%	242428	-31.4%	185822	148371	25.2%	149949
Options sur obligations - OGB	0	0		21	-100.0%	19	137	-85.9%	107
Contrats à terme sur indices									
SXF	51631	50535	2.2%	15264	238.2%	28587	33629	-15.0%	32451
SXM	66	55	20.6%	16	302.0%	34	62	-45.5%	53
SEG	0	0		0		0	0		0
SDV	181	0		4	4966.7%	58	0		0
SMJ	0	0		0		0	0	-100.0%	0
SCF	1	0		0		0	0	-18.6%	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	1381	-100.0%	0		186	206	-9.8%	234
SXU	0	0		0		0	0		0
Total	51879	51971	-0.2%	15284	239.4%	28859	33898	-14.9%	32738
Options sur indices									
SXJ	0	0		0		0	2	-100.0%	1
SXO	0	834	-100.0%	0		0	118	-100.0%	121
SXV	0	0		0		0	0		0
Total	0	834	-100.0%	0		0	120	-100.0%	122
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0		0
Options sur FNB	45239	29612	52.8%	40117	12.8%	45775	36575	25.2%	37142
Contrats à terme sur actions	118181	10238	1054.4%	74314	59.0%	86002	52160	64.9%	46458
Options sur actions	134939	78897	71.0%	125174	7.8%	128324	95523	34.3%	99443
Options sur devises - USX	12	73	-83.6%	16	-26.3%	70	83	-15.5%	97
Total contrats à terme	435400	216804	100.8%	399140	9.1%	405044	329132	23.1%	319976
Total options	180596	109760	64.5%	166833	8.2%	175325	135706	29.2%	139747
Grand total	615996	326565	88.6%	565972	8.8%	580369	464838	24.9%	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.