

sept. 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	
	Septembre 2020	Septembre 2019	% VAR	août 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019	Septembre 2020	Septembre 2019	% VAR	août 2020	% VAR	Septembre 2020	A-à-D 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 053 776	2 574 688	-59,07%	1 272 762	-17,21%	17 892 319	22 458 190	-20,33%	29 816 722	1 046 229	985 250	6,19%	1 045 645	0,06%	68 107	1 617 481
CRA	2 364	0	N/D	1 392	69,83%	6 564	0	N/D	0	3 076	0	N/D	3 274	-6,05%	42	180
Total	1 056 140	2 574 688	-58,98%	1 274 154	-17,11%	17 898 883	22 458 190	-20,3%	29 816 722	1 049 305	985 250	6,5%	1 048 919	0,04%	68 149	1 617 661
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	7 200	164 641	-95,63%	16 628	-56,7%	617 548	690 056	-10,51%	1 034 240	67 782	252 159	-73,12%	109 832	-38,29%	9	808
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	308 367	363 965	-15,28%	440 451	-29,99%	4 066 686	2 750 181	47,87%	4 130 134	67 192	50 193	33,87%	56 116	19,74%	58 055	737 582
CGB	1 882 000	2 006 285	-6,2%	3 427 524	-45,09%	23 975 478	24 163 165	-0,78%	31 684 621	620 010	571 131	8,56%	573 366	8,14%	824 893	9 038 986
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 190 367	2 370 250	-7,59%	3 867 975	-43,37%	28 042 164	26 913 346	4,19%	35 814 755	687 202	621 324	10,6%	629 482	9,17%	882 948	9 776 568
Options sur obligations - OGB	0	2 982	-100%	3 222	-100%	25 958	14 596	77,84%	16 876	3 222	4 942	-34,8%	3 222	0%	0	48
Contrats à terme sur indices																
SXF	1 061 240	1 121 381	-5,36%	289 677	266,35%	6 355 867	5 812 819	9,34%	7 805 301	291 708	298 689	-2,34%	299 595	-2,63%	481 242	4 090 654
SXM	1 153	4 009	-71,24%	326	253,68%	11 721	41 912	-72,14%	51 559	252	1 259	-79,98%	563	-55,24%	304	3 673
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	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	29 000	0	N/D	0	N/D	39 000	2 980	873,15%	3 266	19 000	0	N/D	10 143	87,32%	5	5
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	3 716	-100%	3 716	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 091 393	1 125 390	-3,02%	290 003	276,34%	6 406 628	5 861 431	9,3%	7 863 858	310 960	299 948	3,67%	310 301	0,21%	481 551	4 094 377
Options sur indices																
SXJ	0	0	N/D	340	-100%	340	0	N/D	0	340	0	N/D	340	0%	0	1
SXO	17 520	1 136	1 442,25%	0	N/D	22 356	51 328	-56,45%	62 055	17 520	5 207	236,47%	0	N/D	20	37
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	9 700	-100%	9 700	0	67 247	-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	17 520	1 136	1 442,25%	340	5 052,94%	22 696	61 028	-62,81%	71 760	17 860	72 454	-75,35%	340	5 152,94%	20	38
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	5 545	-100%	6 045	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Options sur FNB	621 862	785 495	-20,83%	529 267	17,5%	6 912 649	6 316 415	9,44%	7 986 880	1 516 468	1 026 527	47,73%	1 549 887	-2,16%	4 872	53 209
Contrats à terme sur actions	214 991	540 293	-60,21%	365 552	-41,19%	9 858 320	3 040 355	224,25%	4 413 772	217 921	261 376	-16,63%	242 230	-10,04%	91	1 411
Options sur actions	1 656 846	2 813 308	-41,11%	1 574 856	5,21%	18 053 866	22 378 456	-19,33%	29 142 959	3 926 412	4 415 645	-11,08%	3 739 394	5%	105 145	1 161 904
Options sur devises - USX	1 538	82	1 775,61%	619	148,47%	15 698	1 448	984,12%	2 184	1 035	1 149	-9,92%	1 794	-42,31%	37	321
Total contrats à terme	4 552 891	6 610 621	-31,13%	5 797 684	-21,47%	62 205 995	58 278 867	6,74%	77 915 152	2 265 388	2 167 898	4,5%	2 230 932	1,54%	1 432 739	15 490 017
Total options	2 304 966	3 767 644	-38,82%	2 124 932	8,47%	25 648 415	29 461 999	-12,94%	38 254 899	5 532 779	5 772 876	-4,16%	5 404 469	2,37%	110 083	1 216 328
Grand total	6 857 857	10 378 265	-33,92%	7 922 616	-13,44%	87 854 410	87 740 866	0,13%	116 170 051	7 798 167	7 940 774	-1,8%	7 635 401	2,13%	1 542 822	16 706 345

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Septembre 2020	Septembre 2019	% VAR	Août 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	50 179	128 734	-61,02%	63 638	-21,15%	94 668	119 458	-20,75%	119 266
CRA	112	0	N/D	69	62,32%	86	0	N/D	0
Total	50 292	128 734	-60,93%	63 707	-21,06%	94 703	119 458	-20,72%	119 266
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	342	8 232	-95,85%	831	-58,85%	3 267	3 670	-10,98%	4 136
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
CGF	14 684	18 198	-19,31%	22 022	-33,32%	21 516	14 628	47,09%	16 520
CGB	89 619	100 314	-10,66%	171 376	-47,71%	126 854	128 527	-1,3%	126 738
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	104 303	118 512	-11,99%	193 398	-46,07%	148 371	143 156	3,64%	143 259
Options sur obligations - OGB	0	149	-100%	161	-100%	137	77	77,92%	67
Contrats à terme sur indices									
SXF	50 534	56 068	-9,87%	14 483	248,91%	33 628	30 918	8,76%	31096
SXM	54	200	-73%	16	237,5%	61	222	-72,52%	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	1 380	0	N/D	0	N/D	206	15	920%	13
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	19	-100%	14
Total	51 971	56 269	-7,64%	14 500	258,42%	33 897	31 177	8,72%	31 330
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	17	-100%	1	0	N/D	0
SXO	834	59 131	3,56%	0	N/D	118	274	-56,93%	248
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	116	-100%	68
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	834	56 138	2,9%	17 480	88%	120	324	-62,96%	285
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	29	-100%	24
Options sur FNB	29 612	39 274	-24,6%	26 463	11,9%	36 574	33 597	8,86%	31 820
Contrats à terme sur actions	10 237	27 014	-62,11%	18 277	-43,99%	52 160	16 172	222,53%	17 584
Options sur actions	78 897	140 665	-43,91%	78 742	0,2%	95 523	119 034	-19,75%	116 107
Options sur devises - USX	73	4	1 725%	30	143,33%	83	7 108	5,71%	8
Total contrats à terme	216 804	330 531	-34,41%	289 884	-25,21%	329 132	309 993	6,17%	310 418
Total options	109 760	188 382	-41,74%	106 246	3,31%	135 705	156 712	-13,41%	152 409
Grand total	326 564	518 913	-37,07%	396 130	-17,56%	464 838	466 706	-0,4%	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.