

nov. 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	
	Novembre 2020	Novembre 2019	% VAR	Octobre 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019	Novembre 2020	Novembre 2019	% VAR	Octobre 2020	% VAR	Novembre 2020	A-à-D 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 617 081	1 777 758	-9,04%	1 772 424	-8,76%	21 281 824	27 120 513	-21,53%	29 816 722	1 282 453	1 165 811	10,01%	1 226 394	4,57%	82 905	1 786 576
CRA	3 437	0	N/D	1 795	91,48%	11 796	0	N/D	0	5 864	0	N/D	4 064	44,29%	95	340
Total	1 620 518	1 777 758	-8,85%	1 774 219	-8,66%	21 293 620	27 120 513	-21,49%	29 816 722	1 288 317	1 165 811	10,51%	1 230 458	4,7%	83 000	1 786 916
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	37 330	54 011	-30,88%	46 300	-19,37%	701 178	925 935	-24,27%	1 034 240	108 140	364 621	-70,34%	84 486	28%	27	893
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	402	0	N/D	0	N/D	402	0	N/D	0	124	0	N/D	0	N/D	22	22
CGF	544 016	473 230	14,96%	398 905	36,41%	5 009 507	3 717 543	34,75%	4 130 134	66 341	60 378	9,88%	71 933	-7,77%	84 683	894 523
CGB	3 694 508	3 366 192	9,75%	2 158 097	71,19%	29 828 083	29 892 611	-0,22%	31 684 621	648 915	585 179	10,89%	642 763	0,96%	1 023 118	10 939 684
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	4 238 926	3 839 422	10,41%	2 556 902	65,78%	34 837 992	33 610 154	3,65%	35 814 755	715 380	645 557	10,82%	714 696	0,1%	1 107 823	11 834 229
Options sur obligations - OGB	532	2 079	-74,41%	0	N/D	26 490	16 876	56,97%	16 876	532	2 240	-76,25%	3 222	-83,49%	3	51
Contrats à terme sur indices																
SXF	384 958	382 971	0,52%	377 859	1,88%	7 118 684	6 677 907	6,60%	7 805 301	319 196	305 353	4,53%	304 875	4,70%	323 008	4 716 685
SXM	415	1 636	-74,63%	383	8,36%	12 519	47 028	-73,48%	51 559	316	828	-61,84%	269	17,47%	196	4 005
SMJ	0	0	N/D	0	N/D	19	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	16
SCF	0	2	-100%	0	N/D	21	16	31,25%	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	286	-100%	0	N/D	39 000	3 266	787,94%	3 266	19 000	286	6 543,36%	19 000	0%	0	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	385 373	384 895	0,12%	378 242	1,89%	7 170 243	6 731 933	6,51%	7 863 858	338 512	306 467	10,46%	324 144	4,43%	323 204	4 720 740
Options sur indices																
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	340	0	N/D	0	340	0	N/D	340	0%	0	1
SXO	0	417	-100%	8 120	-100%	30 476	57 795	-47,27%	62 055	25 640	3 559	620,43%	25 640	0%	0	41
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	5	-100%	0	N/D	0	5	-100%	5	0	5	-100%	0	N/D	0	0
Total	0	422	-100%	8 120	-100%	30 816	67 500	-54,35%	71 760	25 980	70 811	-63,31%	25 980	0%	0	42
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	6 045	-100%	6 045	0	250	-100%	0	N/D	0	0
Options sur FNB	1 005 369	535 863	87,62%	636 235	58,02%	8 554 253	7 392 898	15,71%	7 986 880	1 593 463	1 012 645	57,36%	1 740 955	-8,47%	5 029	62 356
Contrats à terme sur actions	673 055	397 693	69,24%	527 180	27,67%	11 058 555	3 860 076	186,49%	4 413 772	382 510	234 446	63,16%	272 610	40,31%	121	1 659
Options sur actions	2 658 631	2 379 957	11,71%	2 004 149	32,66%	22 716 646	27 128 374	-16,26%	29 142 959	4 152 832	4 528 235	-8,29%	3 971 868	4,56%	158 890	1 435 027
Options sur devises - USX	4 563	87 514	83%	1 885	142,07%	22 146	1 595	1 288,46%	2 184	3 493	1 190	193,53%	1 979	76,5%	44	395
Total contrats à terme	6 917 872	6 399 768	8,1%	5 236 543	32,11%	74 360 410	71 328 721	4,25%	77 915 152	2 724 719	2 352 531	15,82%	2 541 908	7,19%	1 514 148	18 343 544
Total options	3 706 425	2 972 419	24,69%	2 696 689	37,44%	32 051 529	35 533 178	-9,8%	38 254 899	5 884 440	5 979 742	-1,59%	5 828 490	0,96%	163 993	1 498 764
Grand total	10 624 297	9 372 187	13,36%	7 933 232	33,92%	106 411 939	106 861 899	-0,42%	116 170 051	8 609 159	8 332 273	3,32%	8 370 398	2,85%	1 678 141	19 842 308

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2020	Novembre 2019	% VAR	Octobre 2020	% VAR	2020	2019	% VAR	Total 2019
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	80 854	88 887	-9,04%	84 401	-4,2%	92 529	117 915	-21,53%	119 266
CRA	171	0	N/D	85	101,18%	100	0	N/D	0
Total	81 025	88 887	-8,85%	84 486	-4,1%	92 580	117 915	-21,49%	119 266
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 866	2 700	-30,89%	2 204	-15,34%	3 048	4 025	-24,27%	4 136
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	36	0	N/D	0	N/D	2	0	N/D	0
CGF	27 200	23 661	14,96%	18 990	43,23%	21 780	16 163	34,75%	16 520
CGB	184 725	168 309	9,75%	102 766	79,75%	129 687	129 967	-0,22%	126 738
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	211 946	191 971	10,41%	121 757	74,07%	151 469	146 131	3,65%	143 259
Options sur obligations - OGB	26	103	-74,76%	0	N/D	115	73	57,53%	67
Contrats à terme sur indices									
SXF	18 330	18 236	0,52%	17 993	1,87%	30 816	28 908	6,60%	31 096
SXM	19	77	-75,33%	18	5,56%	54	203	-73,4%	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	13	-100%	0	N/D	169	14	792,86%	13
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	16	-100%	14
Total	18 351	18 328	0,13%	18 011	1,89%	31 040	29 142	6,51%	31 330
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	1	0	N/D	0
SXO	0	19	-100%	386	-100%	131	251	-47,81%	248
SXO1	0	0	N/D	0	N/D	0	76	-100%	68
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	0	20	-100%	386	-100%	133	292	-54,45%	285
Contrats à terme sur FNB	0	0	N/D	0	N/D	0	26	-100%	24
Options sur FNB	47 874	25 517	87,62%	30 296	58,02%	37 031	32 003	15,71%	31 820
Contrats à terme sur actions	32 050	18 937	69,25%	25 103	27,67%	47 872	16 710	186,49%	17 584
Options sur actions	126 601	113 331	11,71%	95 435	32,66%	98 340	117 438	-16,26%	116 107
Options sur devises - USX	217	4	5 325%	89	143,82%	95	6 1483,33%		8
Total contrats à terme	329 422	304 750	8,1%	249 359	32,11%	321 906	308 782	4,25%	310 418
Total options	176 496	141 543	24,69%	128 413	37,44%	138 751	153 823	-9,8%	152 409
Grand total	505 918	446 294	13,36%	377 772	33,92%	460 657	462 605	-0,42%	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.