

déc. 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 | |
|--|------------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------------|--------------------|------------------|--------------------|---------------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|-------------------|
| | Décembre 2020 | Décembre 2019 | % VAR | Novembre 2020 | % VAR | 2020 | 2019 | % VAR | Total 2019 | Décembre 2020 | Décembre 2019 | % VAR | Novembre 2020 | % VAR | Décembre 2020 | A-à-D 2020 |
| Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BAX | 1 744 299 | 2 698 972 | -35,37% | 1 617 081 | 7,87% | 23 026 123 | 29 816 722 | -22,77% | 29 816 722 | 1 147 439 | 997 790 | 15% | 1 282 453 | -10,53% | 77 692 | 1 864 288 |
| CRA | 1 281 | 0 | N/D | 3 437 | -62,73% | 13 077 | 0 | N/D | 0 | 5 578 | 0 | N/D | 5 864 | -4,88% | 26 | 366 |
| Total | 1 745 580 | 2 698 972 | -35,32% | 1 620 518 | 7,72% | 23 039 200 | 29 816 722 | -22,73% | 29 816 722 | 1 153 017 | 997 790 | 15,56% | 1 288 317 | -10,5% | 77 718 | 1 864 634 |
| Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX | 13 633 | 108 305 | -87,41% | 37 330 | -63,48% | 714 811 | 1 034 240 | -30,89% | 1 034 240 | 55 763 | 288 136 | -80,65% | 108 140 | -48,43% | 30 | 923 |
| Contrats à terme sur obligations | | | | | | | | | | | | | | | | |
| CGZ | 97 510 | 0 | N/D | 402 24 | 156,22% | 97 912 | 0 | N/D | 0 | 25 585 | 0 | N/D | 124 20 | 533,07% | 882 | 904 |
| CGF | 461 928 | 412 638 | 11,95% | 544 016 | -15,09% | 5 471 435 | 4 130 134 | 32,48% | 4 130 134 | 70 114 | 49 841 | 40,68% | 66 341 | 5,69% | 80 547 | 975 070 |
| CGB | 2 239 849 | 1 794 655 | 24,81% | 3 694 508 | -39,37% | 32 067 932 | 31 684 621 | 1,21% | 31 684 621 | 650 977 | 615 822 | 5,71% | 648 915 | 0,32% | 923 749 | 11 863 433 |
| LGB | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 | N/D | 0 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 |
| Total | 2 799 287 | 2 207 293 | 26,82% | 4 238 926 | -33,96% | 37 637 279 | 35 814 755 | 5,09% | 35 814 755 | 746 676 | 665 663 | 12,17% | 715 380 | 4,38% | 1 005 178 | 12 839 407 |
| Options sur obligations - OGB | 250 | 0 | N/D | 532 | -53,01% | 26 740 | 16 876 | 58,45% | 16 876 | 782 | 2 240 | -65,09% | 532 | 46,99% | 2 | 53 |
| Contrats à terme sur indices | | | | | | | | | | | | | | | | |
| SXF | 1 058 920 | 1 127 942 | -6,12% | 384 958 | 175,07% | 8 177 604 | 7 805 301 | 4,77% | 7 805 301 | 297 750 | 313 713 | -5,09% | 319 196 | -6,72% | 480 948 | 5 197 633 |
| SXM | 825 | 4 531 | -81,79% | 415 | 98,8% | 13 344 | 51 559 | -74,21% | 51 559 | 189 | 365 | -48,22% | 316 | -40,19% | 296 | 4 301 |
| SEG | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 | N/D | 0 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 |
| 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 | 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 | 20 000 | 0 | N/D | 0 | N/D | 59 000 | 3 266 | 1 400,31% | 3 266 | 10 000 | 143 | 6 893,01% | 19 000 | -47,37% | 6 | 11 |
| SXU | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 3 716 | -100% | 3 716 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 |
| Total | 1 079 745 | 1 132 473 | -4,66% | 385 373 | 180,18% | 8 249 988 | 7 863 858 | 4,91% | 7 863 858 | 307 939 | 314 221 | -2% | 338 512 | -9,03% | 481 250 | 5 201 990 |
| 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 | 4 260 | -100% | 0 | N/D | 30 476 | 62 055 | -50,89% | 62 055 | 12 820 | 1 257 | 919,89% | 25 640 | -50% | 0 | 41 |
| SXO1 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 9 700 | -100% | 9 700 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 |
| SXV | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 5 | -100% | 5 | 0 | 5 | -100% | 0 | N/D | 0 | 0 |
| Total | 0 | 4 260 | -100% | 0 | N/D | 30 816 | 71 760 | -57,06% | 71 760 | 13 160 | 1 262 | 942,79% | 25 980 | -49,35% | 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 | 805 495 | 593 982 | 35,61% | 1 005 369 | -19,88% | 9 359 748 | 7 986 880 | 17,19% | 7 986 880 | 1 373 685 | 962 364 | 42,74% | 1 593 463 | -13,79% | 3 326 | 65 682 |
| Contrats à terme sur actions | 648 910 | 553 696 | 17,2% | 673 055 | -3,59% | 11 707 465 | 4 413 772 | 165,25% | 4 413 772 | 297 160 | 191 061 | 55,53% | 382 510 | -22,31% | 136 | 1 795 |
| Options sur actions | 2 342 944 | 2 014 585 | 16,3% | 2 658 631 | -11,87% | 25 059 590 | 29 142 959 | -14,01% | 29 142 959 | 4 177 270 | 4 091 345 | 2,1% | 4 152 832 | 0,59% | 133 637 | 1 568 664 |
| Options sur devises - USX | 2 314 | 589 | 292,87% | 4 563 | -49,29% | 24 460 | 2 184 | 1 019,96% | 2 184 | 2 869 | 532 | 439,29% | 3 493 | -17,86% | 49 | 444 |
| Total contrats à terme | 6 273 522 | 6 592 434 | -4,84% | 6 917 872 | -9,31% | 80 633 932 | 77 915 152 | 3,49% | 77 915 152 | 2 504 792 | 2 168 985 | 15,48% | 2 724 719 | -8,07% | 1 564 282 | 19 907 826 |
| Total options | 3 164 636 | 2 721 721 | 16,27% | 3 706 425 | -14,62% | 35 216 165 | 38 254 899 | -7,94% | 38 254 899 | 5 623 529 | 5 345 879 | 5,19% | 5 884 440 | -4,43% | 137 044 | 1 635 808 |
| Grand total | 9 438 158 | 9 314 155 | 1,33% | 10 624 297 | -11,16% | 115 850 097 | 116 170 051 | -0,28% | 116 170 051 | 8 128 321 | 7 514 864 | 8,16% | 8 609 159 | -5,59% | 1 701 326 | 21 543 634 |

| | Volume moyen quotidien | | | | | Volume moyen quotidien A-à-D | | | |
|--|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------------------|----------------|-----------------|----------------|
| | Décembre 2020 | Décembre 2019 | % VAR | Novembre 2020 | % VAR | 2020 | 2019 | % VAR | Total 2019 |
| Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme | | | | | | | | | |
| BAX | 83 061 | 134 948 | -38,45% | 80 854 | 2,73% | 91 737 | 119 266 | -23,08% | 119 266 |
| CRA | 61 | 0 | N/D | 171 | -64,33% | 94 | 0 | N/D | 0 |
| Total | 83 122 | 134 948 | -38,4% | 81 025 | 2,59% | 91 789 | 119 266 | -23,04% | 119 266 |
| Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX | 649 | 5 415 | -88,02% | 1 866 | -65,22% | 2 847 | 4 136 | -31,17% | 4 136 |
| Contrats à terme sur obligations | | | | | | | | | |
| CGZ | 4 643 | 0 | N/D | 36 12 | 797,22% | 455 | 0 | N/D | 0 |
| CGF | 21 996 | 20 631 | 6,62% | 27 200 | -19,13% | 21 798 | 16 520 | 31,95% | 16 520 |
| CGB | 106 659 | 89 732 | 18,86% | 184 725 | -42,26% | 127 760 | 126 738 | 0,81% | 126 738 |
| LGB | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 | N/D | 0 |
| Total | 133 299 | 110 364 | 20,78% | 211 946 | -37,11% | 149 949 | 143 259 | 4,67% | 143 259 |
| Options sur obligations - OGB | 11 | 0 | N/D | 26 | -57,69% | 106 | 67 | 58,21% | 67 |
| Contrats à terme sur indices | | | | | | | | | |
| SXF | 50 424 | 56 396 | -10,59% | 18 330 | 175,09% | 32 450 | 31 096 | 4,35% | 31 096 |
| SXM | 39 | 226 | -82,74% | 19 | 105,26% | 52 | 205 | -74,63% | 205 |
| SEG | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 | N/D | 0 |
| 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 | 952 | 0 | N/D | 0 | N/D | 234 | 13 139 | 2,31% | 13 |
| SXU | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 14 | -100% | 14 |
| Total | 51 416 | 56 623 | -9,2% | 18 351 | 180,18% | 32 738 | 31 330 | 4,49% | 31 330 |
| Options sur indices | | | | | | | | | |
| SXJ | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 1 | 0 | N/D | 0 |
| SXO | 0 | 213 | -100% | 0 | N/D | 120 | 248 | -51,61% | 248 |
| SXO1 | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 68 | -100% | 68 |
| SXV | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 0 | N/D | 0 |
| Total | 0 | 213 | -100% | 0 | N/D | 122 | 285 | -57,19% | 285 |
| Contrats à terme sur FNB | 0 | 0 | N/D | 0 | N/D | 0 | 24 | -100% | 24 |
| Options sur FNB | 38 356 | 29 699 | 29,15% | 47 874 | -19,88% | 37 141 | 31 820 | 16,72% | 31 820 |
| Contrats à terme sur actions | 30 900 | 27 684 | 11,62% | 32 050 | -3,59% | 46 458 | 17 584 | 164,21% | 17 584 |
| Options sur actions | 111 568 | 100 729 | 10,76% | 126 601 | -11,87% | 99 442 | 116 107 | -14,35% | 116 107 |
| Options sur devises - USX | 110 | 29 | 279,31% | 217 | -49,31% | 97 | 8 | 1 112,5% | 8 |
| Total contrats à terme | 298 739 | 329 621 | -9,37% | 329 422 | -9,31% | 319 975 | 310 418 | 3,08% | 310 418 |
| Total options | 150 696 | 136 086 | 10,74% | 176 496 | -14,62% | 139 746 | 152 409 | -8,31% | 152 409 |
| Grand total | 449 436 | 465 707 | -3,49% | 505 918 | -11,16% | 459 722 | 462 828 | -0,67% | 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

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.