

mars 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	
	Mars 2021	Mars 2020	% VAR	Février 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020	Mars 2021	Mars 2020	% VAR	Février 2021	% VAR	Mars 2021	A-à-D 2021
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	3154682	3833420	-0.177	2386850	32.20%	7614349	10186422	-0.253	23026123	1353839	802242	0.688	1587601	-14.70%	204176	420067
CRA	2885	0		253	1040.30%	8153	0	0	13077	6767	0		8874	-23.70%	77	323
Total	3157567	3833420	-0.176	2387103	32.30%	7622502	10186422	-0.252	23039200	1360606	802242	0.696	1596475	-14.80%	204253	420390
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	52253	136518	-0.617	39250	33.10%	107353	438277	-0.755	714811	100660	220531	-0.544	96638	4.20%	65	132
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	172832	0		269120	-35.80%	614545	0		97912	29496	0	0	53098	-44.40%	3504	8117
CGF	654298	639423	0.023	749068	-12.70%	1958638	1879844	0.042	5471435	86694	61693	0.081	81416	-18.10%	103951	284195
CGB	2565959	3138003	-0.182	4950622	-48.20%	10107513	9896301	0.021	32067932	691524	576083	0.2	766373	-9.80%	1025594	3289308
LGB	0	0		0		0	0	0	0	0	0	0	0		0	0
Total	3393089	3777426	-0.102	5968810	-43.20%	12680696	11776145	0.077	37637279	787714	637776	0.235	900887	-12.60%	1133049	3561620
Options sur obligations - OGE	145	11724	-0.988	287	-49.50%	2532	17881	-0.858	26740	432	8414	-0.949	287	50.50%	3	7
Contrats à terme sur indices																
SXF	1105726	1841296	-39.90%	317294	248.50%	1822375	2913212	-37.40%	8177604	294053	306775	-4.10%	317608	-7.40%	510438	1108364
SXM	1139	3177	-64.10%	505	125.50%	2044	6130	-66.70%	13344	371	741	-49.90%	270	37.40%	304	662
SEG	0	0		0		0	0		0	0	0	0	0		0	0
SDV	2781	0		2920	-4.80%	5701	0		0	5390	0		2710	98.90%	19	111
SMJ	0	2	-100.00%	0		0	19	-100.00%	19	0	0		0		0	0
SCF	0	0		0		0	1	-100.00%	21	0	0		0		0	0
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	31000	0		0		31000	0		59000	15500	143	#####	10000	55.00%	6	6
SXU	0	0		0		0	0		0	0	0		0		0	0
Total	1140646	1844475	-38.20%	320719	255.70%	1861120	2919362	-36.20%	8249988	315314	307659	2.50%	330588	-4.60%	510767	1109143
Options sur indices																
SXJ	0	0		0		0	0		340	0	0		340	-100.00%	0	0
SXO	0	2440	-1	0		0	4836	-1	30476	12820	181	69.829	12820	0.00%	0	0
SXV	0	0		0		0	0		0	0	5	-1	0		0	0
Total	0	2440	-1	0		0	4836	-1	30816	12820	186	67.925	13160	-2.60%	0	0
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0	0	0	0	250	-1	0		0	0
Options sur FNB	880358	1207816	-0.271	1407132	-37.40%	3226459	2466860	0.308	9359748	1598390	1089132	0.468	2191244	-27.10%	8419	19846
Contrats à terme sur actions	2412444	1025345	1.353	1373560	75.60%	4848674	2376845	1.04	11707465	1050200	472050	1.225	527730	99.00%	176	437
Options sur actions	2733919	2255191	0.212	2515930	8.70%	7985835	7274165	0.098	25059590	3972064	4054916	-0.02	3629685	9.40%	189681	548449
Options sur devises - USX	243	4919	-0.951	933	-74.00%	4383	5868	-0.253	24460	596	3095	-0.807	906	-34.20%	26	87
Total contrats à terme	10103746	10480666	-0.036	10050192	0.50%	27012992	27258774	-0.009	80633932	3513834	2219977	0.583	3355680	4.70%	1848245	5091590
Total options	3666918	3618608	0.013	3963532	-7.50%	11326562	10207887	0.11	35216165	5684962	5376274	0.057	5931920	-4.20%	198194	568521
Grand total	13770664	14099274	-0.023	14013724	-1.70%	38339554	37466661	0.023	115850097	9198796	7596251	0.211	9287600	-1.00%	2046439	5660111

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Mars 2021	Mars 2020	% VAR	Février 2021	% VAR	2021	2020	% VAR	Total 2020
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	137160	174246	-0.213	125624	9.20%	122812	161689	-0.24	91738
CRA	125	0		13	842.00%	132	0		95
Total	137286	174246	-0.212	125637	9.30%	122944	161689	-0.24	91790
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	2272	6205	-0.634	2066	10.00%	1732	6957	-0.751	2848
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	7514	0		14164	-46.90%	9912	0		455
CGF	28448	29065	-0.021	39425	-27.80%	31591	29839	0.059	21799
CGB	111563	142637	-0.218	260559	-57.20%	163024	157084	0.038	127761
LGB	0	0		0		0	0		0
Total	147526	171701	-0.141	314148	-53.00%	204527	186923	0.094	149949
Options sur obligations - OGB	6	533	-0.988	15	-58.30%	41	284	-0.856	107
Contrats à terme sur indices									
SXF	48075	83695	-42.60%	16700	187.90%	29393	46241	-36.40%	32451
SXM	50	144	-65.70%	27	86.30%	33	97	-66.10%	53
SEG	0	0		0		0	0		0
SDV	121	0		162	-25.50%	139	0		0
SMJ	0	0	-100.00%	0		0	0	-100.00%	0
SCF	0	0		0		0	0	-100.00%	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	1348	0		0		500	0		234
SXU	0	0		0		0	0		0
Total	49593	83840	-40.80%	16880	193.80%	30018	46339	-35.20%	32738
Options sur indices									
SXJ	0	0		0		0	0		1
SXO	0	111	-1	0		0	77	-1	121
SXV	0	0		0		0	0		0
Total	0	111	-1	0		0	77	-1	122
Contrats à terme sur FNB	0	0		0		0	0		0
Options sur FNB	38276	54901	-0.303	74060	-48.30%	52040	39157	0.329	37142
Contrats à terme sur actions	104889	46607	1.251	72293	45.10%	78204	37728	1.073	46458
Options sur actions	118866	102509	0.16	132417	-10.20%	128804	115463	0.116	99443
Options sur devises - USX	11	224	-0.953	49	-78.50%	71	93	-0.241	97
Total contrats à terme	439293	476394	-0.078	528957	-17.00%	435693	432679	0.007	319976
Total options	159431	164482	-0.031	208607	-23.60%	182686	162030	0.127	139747
Grand total	598725	640876	-0.066	737564	-18.80%	618380	594709	0.04	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.