

Sep. 2012

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 2012	Septembre 2011	% VAR	Août 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011	Septembre 2012	Septembre 2011	% VAR	Août 2012	% VAR	Septembre 2012	A-à-D 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 595 070	1 356 586	17,58%	1 667 074	-4,32%	16 204 331	16 900 400	-4,12%	20 790 678	519 708	419 008	24,03%	531 358	-2,19%	71 903	728 830
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
OIS	0	0	N/D	0	N/D	150	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	3
Total	1 595 070	1 356 586	17,58%	1 667 074	-4,32%	16 204 481	16 900 400	-4,12%	20 790 678	519 708	419 008	24,03%	531 358	-2,19%	71 903	728 833
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	40 700	41 480	-1,88%	65 676	-38,03%	416 805	556 282	-25,07%	635 046	124 040	136 445	-9,09%	160 889	-22,9%	54	856
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	5 706	9 332	-38,86%	6 981	-18,26%	56 606	41 275	37,14%	59 650	842	2 469	-65,9%	667	26,24%	101	845
CGF	10 719	15 744	-31,92%	14 461	-25,68%	122 888	57 413	114,04%	105 580	2 687	3 291	-18,35%	6 160	-56,38%	267	2 785
CGB	622 654	566 535	9,91%	1 072 744	-41,96%	7 439 469	5 992 674	24,14%	7 782 924	206 160	169 681	21,5%	191 627	7,58%	253 894	2 468 850
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	639 079	591 611	8,02%	1 094 186	-41,59%	7 618 963	6 091 362	25,08%	7 948 154	209 689	175 441	19,52%	198 454	5,66%	254 262	2 472 480
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	1 190	-100%	3 846	7 594	-49,36%	8 775	1 190	1 577	-24,54%	1 190	0%	0	6
Contrats à terme sur indices																
SXF	507 288	605 837	-16,27%	200 935	152,46%	2 915 641	3 219 735	-9,45%	4 226 332	137 957	133 990	2,96%	151 111	-8,71%	183 967	1 519 743
SXM	11 597	13 152	-11,82%	18 250	-36,46%	109 246	72 250	51,21%	100 554	1 264	889	42,18%	4 705	-73,14%	6 072	44 759
SCF	106	6	1 666,67%	100	6%	432	138	213,04%	232	6	0	N/D	0	N/D	15	58
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
Total	518 991	618 995	-16,16%	219 285	136,67%	3 025 319	3 292 123	-8,1%	4 327 118	139 227	134 879	3,22%	155 816	-10,65%	190 054	1 564 560
Options sur indices - SXO	49 542	8 033	516,73%	28 147	76,01%	147 892	77 918	89,81%	93 045	128 617	13 950	821,99%	142 705	-9,87%	361	3 517
Options sur FNB	322 110	421 759	-23,63%	227 576	41,54%	3 384 211	2 878 511	17,57%	3 862 981	721 679	542 063	33,14%	814 536	-11,4%	3 766	31 654
Options sur actions	1 919 451	2 450 936	-21,69%	2 058 173	-6,74%	18 612 438	16 826 187	10,62%	23 161 967	2 890 389	2 872 304	0,63%	2 914 052	-0,81%	78 404	742 791
Options sur devises - USX	241	1 064	-77,35%	269	-10,41%	3 663	13 397	-72,66%	16 947	534	1 605	-66,73%	577	-7,45%	30	296
Total contrats à terme	2 753 140	2 567 192	7,24%	2 980 545	-7,63%	26 848 763	26 283 885	2,15%	33 065 950	868 624	729 328	19,1%	885 628	-1,92%	516 219	4 765 873
Total options	2 332 044	2 991 304	-22,04%	2 381 031	-2,06%	22 601 972	21 244 101	6,39%	28 822 603	3 866 785	3 674 490	5,23%	4 034 285	-4,15%	82 615	780 091
Grand total	5 085 184	5 558 496	-8,52%	5 361 576	-5,16%	49 450 735	47 527 986	4,05%	61 888 553	4 735 409	4 403 818	7,53%	4 919 913	-3,75%	598 834	5 545 964

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Septembre 2012	Septembre 2011	% VAR	Août 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	83 951	64 599	17,58%	75 776	-4,32%	86 193	89 895	-4,12%	83 162
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
OIS	0	0	N/D	0	N/D	1	0	N/D	0
Total	83 951	64 599	17,58%	75 776	-4,32%	86 194	89 895	-4,12%	83 162
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	2 142	1 975	-1,88%	2 985	-38,03%	2 217	2 958	-25,07%	2 540
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	300	444	-38,86%	317	-18,26%	301	219	37,14%	238
CGF	564	749	-31,92%	657	-25,88%	654	305	114,04%	422
CGB	32 771	26 977	9,91%	48 761	-41,96%	39 572	31 875	24,14%	31 131
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	33 635	28 171	8,02%	49 735	-41,59%	40 526	32 400	25,08%	31 792
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	54	-100%	20	40	-49,36%	35
Contrats à terme sur indices									
SXF	26 699	28 849	-16,27%	9 133	152,46%	15 509	17 126	-9,45%	16 905
SXM	610	626	-11,82%	829	-36,46%	581	708	51,21%	613
SCF	5	0	N/D	4	6%	2	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
Total	27 315	29 475	-16,16%	9 967	136,67%	16 092	17 511	-8,1%	17 308
Options sur indices - SXO	2 607	382	516,73%	1 279	76,01%	787	414	89,81%	372
Options sur FNB	16 953	20 083	-23,63%	10 344	41,54%	18 001	15 311	17,57%	15 451
Options sur actions	101 023	116 711	-21,69%	93 553	-6,74%	99 002	89 500	10,62%	92 647
Options sur devises - USX	12	50	-77,35%	12	-10,41%	19	71	-72,66%	67
Total contrats à terme	144 902	122 247	7,24%	135 479	-7,63%	142 813	139 807	2,15%	132 263
Total options	122 739	142 443	-22,04%	108 228	-2,06%	120 223	113 000	6,39%	115 290
Grand total	267 641	264 690	-8,52%	243 708	-5,16%	263 036	252 808	4,05%	247 554

Liste des produits

Dérivés sur taux d'intérêt à court terme

BAX : Contrats à terme sur acceptations bancaires canadiennes de trois mois
ONX : Contrats à terme 30 jours sur le taux repo à un jour
OIS : Contrats à terme sur swap indexé à un jour
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
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

Options sur devises

USX : Options sur le dollar US

Options sur FNB

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} et SXO^{MC} sont des marques de commerce de Bourse de Montréal Inc.