

oct. 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	
	Octobre 2012	Octobre 2011	% VAR	Septembre 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011	Octobre 2012	Octobre 2011	% VAR	Septembre 2012	% VAR	Octobre 2012	A-à-D 2012
<b>Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme</b>																
BAX	1 940 359	1 446 239	34,17%	1 595 070	21,65%	18 144 690	18 346 639	-1,1%	20 790 678	505 972	430 001	17,67%	519 708	-2,64%	86 160	814 990
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
<b>Total</b>	<b>1 940 359</b>	<b>1 446 239</b>	<b>34,17%</b>	<b>1 595 070</b>	<b>21,65%</b>	<b>18 144 840</b>	<b>18 346 639</b>	<b>-1,1%</b>	<b>20 790 678</b>	<b>505 972</b>	<b>430 001</b>	<b>17,67%</b>	<b>519 708</b>	<b>-2,64%</b>	<b>86 160</b>	<b>814 993</b>
<b>Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX</b>	<b>47 367</b>	<b>34 750</b>	<b>36,31%</b>	<b>40 700</b>	<b>16,38%</b>	<b>464 172</b>	<b>591 032</b>	<b>-21,46%</b>	<b>635 046</b>	<b>132 790</b>	<b>144 208</b>	<b>-7,92%</b>	<b>124 040</b>	<b>7,05%</b>	<b>101</b>	<b>957</b>
<b>Contrats à terme sur obligations</b>																
CGZ	5 001	8 088	-38,17%	5 706	-12,36%	61 607	49 363	24,8%	59 650	1 001	2 482	-59,67%	842	18,88%	90	935
CGF	10 060	15 485	-35,03%	10 719	-6,15%	132 948	72 898	82,38%	105 580	3 144	4 330	-27,39%	2 687	17,01%	245	3 030
CGB	650 836	517 904	25,67%	622 654	4,53%	8 090 305	6 510 578	24,26%	7 782 924	215 354	175 472	22,73%	206 160	4,46%	259 099	2 727 949
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
<b>Total</b>	<b>665 897</b>	<b>541 477</b>	<b>22,98%</b>	<b>639 079</b>	<b>4,2%</b>	<b>8 284 860</b>	<b>6 632 839</b>	<b>24,91%</b>	<b>7 948 154</b>	<b>219 499</b>	<b>182 284</b>	<b>20,42%</b>	<b>209 689</b>	<b>4,68%</b>	<b>259 434</b>	<b>2 731 914</b>
<b>Options sur obligations - OGB</b>	<b>8</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>3 854</b>	<b>7 594</b>	<b>-49,25%</b>	<b>8 775</b>	<b>1 198</b>	<b>1 577</b>	<b>-24,03%</b>	<b>1 190</b>	<b>0,67%</b>	<b>1</b>	<b>7</b>
<b>Contrats à terme sur indices</b>																
SXF	208 506	273 583	-23,79%	507 288	-58,9%	3 124 147	3 493 318	-10,57%	4 226 332	147 188	138 302	6,43%	137 957	6,69%	162 064	1 681 807
SXM	10 655	10 508	1,4%	11 597	-8,12%	119 901	82 758	44,88%	100 554	1 821	2 602	-30,02%	1 264	44,07%	5 678	50 437
SCF	15	4	275%	106	-85,85%	447	142	214,79%	232	3	0	N/D	6	-50%	5	63
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
<b>Total</b>	<b>219 176</b>	<b>284 095</b>	<b>-22,85%</b>	<b>518 991</b>	<b>-57,77%</b>	<b>3 244 495</b>	<b>3 576 218</b>	<b>-9,28%</b>	<b>4 327 118</b>	<b>149 012</b>	<b>140 904</b>	<b>5,75%</b>	<b>139 227</b>	<b>7,03%</b>	<b>167 747</b>	<b>1 732 307</b>
<b>Options sur indices - SXO</b>	<b>41 566</b>	<b>5 068</b>	<b>720,17%</b>	<b>49 542</b>	<b>-16,1%</b>	<b>189 458</b>	<b>82 986</b>	<b>128,3%</b>	<b>93 045</b>	<b>140 402</b>	<b>15 980</b>	<b>778,61%</b>	<b>128 617</b>	<b>9,16%</b>	<b>332</b>	<b>3 849</b>
<b>Options sur FNB</b>	<b>175 543</b>	<b>295 868</b>	<b>-40,67%</b>	<b>322 110</b>	<b>-45,5%</b>	<b>3 559 754</b>	<b>3 174 379</b>	<b>12,14%</b>	<b>3 862 981</b>	<b>751 512</b>	<b>527 555</b>	<b>42,45%</b>	<b>721 679</b>	<b>4,13%</b>	<b>2 874</b>	<b>34 528</b>
<b>Options sur actions</b>	<b>2 066 288</b>	<b>1 883 409</b>	<b>9,71%</b>	<b>1 919 451</b>	<b>7,65%</b>	<b>20 678 726</b>	<b>18 709 596</b>	<b>10,53%</b>	<b>23 161 967</b>	<b>2 712 433</b>	<b>2 474 274</b>	<b>9,63%</b>	<b>2 890 389</b>	<b>-6,16%</b>	<b>78 852</b>	<b>821 643</b>
<b>Options sur devises - USX</b>	<b>323</b>	<b>1 590</b>	<b>-79,69%</b>	<b>241</b>	<b>34,03%</b>	<b>3 986</b>	<b>14 987</b>	<b>-73,4%</b>	<b>16 947</b>	<b>715</b>	<b>1 448</b>	<b>-50,62%</b>	<b>534</b>	<b>33,9%</b>	<b>39</b>	<b>335</b>
Total contrats à terme	2 825 432	2 271 811	24,37%	2 753 140	2,63%	29 674 195	28 555 696	3,92%	33 065 950	874 483	753 189	16,1%	868 624	0,68%	513 341	5 279 214
Total options	2 331 095	2 274 543	2,49%	2 332 044	-0,04%	24 933 067	23 518 644	6,01%	28 822 603	3 739 080	3 250 280	15,04%	3 866 785	-3,3%	82 199	862 290
<b>Grand total</b>	<b>5 156 527</b>	<b>4 546 354</b>	<b>13,42%</b>	<b>5 085 184</b>	<b>1,4%</b>	<b>54 607 262</b>	<b>52 074 340</b>	<b>4,86%</b>	<b>61 888 553</b>	<b>4 613 563</b>	<b>4 003 469</b>	<b>15,24%</b>	<b>4 735 409</b>	<b>-2,57%</b>	<b>595 540</b>	<b>6 141 504</b>

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Octobre 2012	Octobre 2011	% VAR	Septembre 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011
<b>Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme</b>									
BAX	88 198	72 311	21,97%	83 951	5,06%	85 588	88 204	-2,97%	83 162
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
OIS	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
<b>Total</b>	<b>88 198</b>	<b>72 311</b>	<b>21,97%</b>	<b>83 951</b>	<b>5,06%</b>	<b>85 588</b>	<b>88 204</b>	<b>-2,97%</b>	<b>83 162</b>
<b>Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX</b>	<b>2 153</b>	<b>1 737</b>	<b>23,95%</b>	<b>2 142</b>	<b>0,51%</b>	<b>2 189</b>	<b>2 841</b>	<b>-22,95%</b>	<b>2 540</b>
<b>Contrats à terme sur obligations</b>									
CGZ	227	404	-43,81%	300	-24,33%	290	237	22,36%	238
CGF	457	774	-40,96%	564	-18,97%	627	350	79,14%	422
CGB	29 583	25 895	14,24%	32 771	-9,73%	38 161	31 300	21,92%	31 131
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
<b>Total</b>	<b>30 268</b>	<b>27 073</b>	<b>11,8%</b>	<b>33 635</b>	<b>-10,01%</b>	<b>39 079</b>	<b>31 888</b>	<b>22,55%</b>	<b>31 792</b>
<b>Options sur obligations - OGB</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>18</b>	<b>36</b>	<b>-50%</b>	<b>35</b>
<b>Contrats à terme sur indices</b>									
SXF	9 477	13 679	-30,72%	26 699	-64,5%	14 736	16 794	-12,25%	16 905
SXM	484	525	-7,81%	610	-20,66%	565	678	-16,67%	613
SCF	0	0	N/D	5	-100%	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
<b>Total</b>	<b>9 962</b>	<b>14 204</b>	<b>-29,87%</b>	<b>27 315</b>	<b>-63,53%</b>	<b>15 304</b>	<b>17 193</b>	<b>-10,99%</b>	<b>17 308</b>
<b>Options sur indices - SXO</b>	<b>1 889</b>	<b>253</b>	<b>646,64%</b>	<b>2 607</b>	<b>-27,54%</b>	<b>893</b>	<b>398</b>	<b>124,37%</b>	<b>372</b>
<b>Options sur FNB</b>	<b>7 979</b>	<b>14 793</b>	<b>-46,06%</b>	<b>16 953</b>	<b>-52,94%</b>	<b>16 791</b>	<b>15 261</b>	<b>10,03%</b>	<b>15 451</b>
<b>Options sur actions</b>	<b>93 922</b>	<b>94 170</b>	<b>-0,26%</b>	<b>101 023</b>	<b>-7,03%</b>	<b>97 541</b>	<b>89 949</b>	<b>8,44%</b>	<b>92 647</b>
<b>Options sur devises - USX</b>	<b>14</b>	<b>79</b>	<b>-82,28%</b>	<b>12</b>	<b>16,67%</b>	<b>18</b>	<b>72</b>	<b>-75%</b>	<b>67</b>
Total contrats à terme	128 428	113 590	13,06%	144 902	-11,37%	139 972	137 287	1,96%	132 263
Total options	105 958	113 727	-6,83%	122 739	-13,67%	117 608	113 070	4,01%	115 290
<b>Grand total</b>	<b>234 387</b>	<b>227 317</b>	<b>3,11%</b>	<b>267 641</b>	<b>-12,43%</b>	<b>257 581</b>	<b>250 357</b>	<b>2,89%</b>	<b>247 554</b>

## 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<sup>MD</sup>, ONX<sup>MD</sup>, OBX<sup>MD</sup>, CGZ<sup>MD</sup>, CGF<sup>MD</sup>, CGB<sup>MD</sup>, LGB<sup>MD</sup>, OGB<sup>MD</sup> et USX<sup>MD</sup> sont des marques enregistrées de Bourse de Montréal Inc.

OIS-MX<sup>MC</sup>, SXF<sup>MC</sup>, SXM<sup>MC</sup>, SCF<sup>MC</sup>, SXA<sup>MC</sup>, SXB<sup>MC</sup>, SXH<sup>MC</sup>, SXY<sup>MC</sup> et SXO<sup>MC</sup> sont des marques de commerce de Bourse de Montréal Inc.