

janvier 2013

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	
	Janvier 2013	Janvier 2012	% VAR	Décembre 2012	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Janvier 2013	Janvier 2012	% VAR	Décembre 2012	% VAR	Janvier 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2 179 970	1 337 813	62,95%	1 391 997	56,61%	2 179 970	1 337 813	62,95%	20 718 268	538 041	508 063	5,9%	451 821	19,08%	82 894	82 894
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	0	0	N/D	150	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 179 970	1 337 813	62,95%	1 391 997	56,61%	2 179 970	1 337 813	62,95%	20 718 418	538 041	508 063	5,9%	451 821	19,08%	82 894	82 894
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	57 417	34 729	65,33%	12 122	373,66%	57 417	34 729	65,33%	493 047	89 500	86 105	3,94%	55 150	62,28%	93	93
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	4 358	606	619,14%	5 899	-26,12%	4 358	606	619,14%	71 699	1 069	451	137,03%	1 117	-4,30%	100	100
CGF	9 183	11 232	-18,24%	8 952	2,58%	9 183	11 232	-18,24%	153 598	3 767	3 964	-4,97%	1 844	104,28%	209	209
CGB	800 870	562 577	42,36%	610 526	31,18%	800 870	562 577	42,36%	9 946 872	273 715	197 480	38,6%	249 254	9,81%	291 412	291 412
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	814 411	574 415	41,78%	625 377	30,23%	814 411	574 415	41,78%	10 172 169	278 551	201 895	37,97%	252 215	10,44%	291 721	291 721
Options sur obligations - OGB	0	122	-100%	3	-100,00%	0	122	-100%	4 767	913	1 303	-29,93%	913	0,00%	0	0
Contrats à terme sur indices																
SXF	202 788	194 042	4,51%	480 895	-57,83%	202 788	194 042	4,51%	3 826 895	152 158	144 087	5,6%	146 716	3,71%	152 800	152 800
SXM	6 193	6 351	-2,49%	5 289	17,09%	6 193	6 351	-2,49%	132 549	1 519	2 629	-42,22%	755	101,19%	2 155	2 155
SCF	32	0	N/D	32	0,00%	32	0	N/D	539	0	0	N/D	0	N/D	7	7
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	209 013	200 393	4,3%	486 216	-57,01%	209 013	200 393	4,3%	3 959 983	153 677	146 716	4,75%	147 471	4,21%	154 962	154 962
Options sur indices - SXO	68 084	5 224	1 203,29%	79 649	-14,52%	68 084	5 224	1 203,29%	314 631	127 754	13 095	875,59%	99 837	27,96%	458	458
Options sur FNB	210 630	350 719	-39,94%	627 134	-66,41%	210 630	350 719	-39,94%	4 405 147	689 348	663 285	3,93%	612 447	12,56%	2 651	2 651
Options sur actions	2 250 405	2 634 330	-14,57%	1 526 530	47,42%	2 250 405	2 634 330	-14,57%	24 151 035	2 212 601	2 746 142	-19,43%	2 610 992	-15,26%	97 043	97 043
Options sur devises - USX	506	1 146	-55,85%	924	-45,24%	506	1 146	-55,85%	5 235	728	959	-24,09%	619	17,61%	44	44
Total contrats à terme	3 203 394	2 112 621	51,63%	2 503 590	27,95%	3 203 394	2 112 621	51,63%	34 850 570	970 269	856 674	13,26%	851 507	13,95%	529 577	529 577
Total options	2 587 042	3 046 570	-15,08%	2 246 374	15,17%	2 587 042	3 046 570	-15,08%	29 406 979	3 120 844	3 559 364	-12,32%	3 380 450	-7,68%	100 289	100 289
Grand total	5 790 436	5 159 191	12,24%	4 749 964	21,90%	5 790 436	5 159 191	12,24%	64 257 549	4 091 113	4 416 038	-7,36%	4 231 957	-3,33%	629 866	629 866

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Janvier 2013	Janvier 2012	% VAR	Décembre 2012	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	99 089	63 705	55,54%	73 263	35,25%	99 089	63 705	55,54%	82 542
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
Total	99 089	63 705	55,54%	73 263	35,25%	99 089	63 705	55,54%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	2 609	1 653	57,83%	638	308,93%	2 609	1 653	57,83%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	198	28	607,14%	310	-36,13%	198	28	607,14%	285
CGF	417	534	-21,91%	471	-11,46%	417	534	-21,91%	611
CGB	36 403	26 789	35,89%	32 132	13,29%	36 403	26 789	35,89%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	37 018	27 353	35,33%	32 914	12,47%	37 018	27 353	35,33%	40 526
Options sur obligations - OGB	0	5	-100%	0	N/D	0	5	-100%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	9 217	9 240	-0,25%	25 310	-63,58%	9 217	9 240	-0,25%	15 246
SXM	281	302	-6,95%	278	1,08%	281	302	-6,95%	528
SCF	1	0	N/D	1	0,00%	1	0	N/D	2
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	9 500	9 542	-0,44%	25 590	-62,88%	9 500	9 542	-0,44%	15 776
Options sur indices - SXO	3 094	248	1 147,58%	4 192	-26,19%	3 094	248	1 147,58%	1 253
Options sur FNB	9 574	16 700	-42,67%	33 007	-70,99%	9 574	16 700	-42,67%	17 550
Options sur actions	102 291	125 444	-18,46%	80 343	27,32%	102 291	125 444	-18,46%	96 219
Options sur devises - USX	23	54	-57,41%	48	-52,08%	23	54	-57,41%	20
Total contrats à terme	145 608	100 601	44,74%	131 767	10,50%	145 608	100 601	44,74%	138 846
Total options	117 592	145 074	-18,94%	118 230	-0,54%	117 592	145 074	-18,94%	117 159
Grand total	263 201	245 675	7,13%	249 998	5,28%	263 201	245 675	7,13%	256 006

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.