

février 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	
	Février 2013	Février 2012	% VAR	Janvier 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Février 2013	Février 2012	% VAR	Janvier 2013	% VAR	Février 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 821 704	1 199 526	51,87%	2 179 970	-16,43%	4 001 674	2 537 339	57,71%	20 718 268	619 144	542 320	14,17%	538 041	15,07%	74 967	157 861
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
OIS	0	100	-100%	0	N/D	0	100	-100%	150	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 821 704	1 199 626	51,86%	2 179 970	-16,43%	4 001 674	2 537 439	57,71%	20 718 418	619 144	542 320	14,17%	538 041	15,07%	74 967	157 861
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	30 250	19 875	52,2%	57 417	-47,32%	87 667	54 604	60,55%	493 047	105 700	90 030	17,41%	89 500	18,1%	61	154
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	12 276	1 985	518,44%	4 358	181,69%	16 634	2 591	541,99%	71 699	2 106	32 648	1,25%	1 069	97,01%	287	387
CGF	19 279	9 516	102,6%	9 183	109,94%	28 462	20 748	37,18%	153 598	4 830	3 181	51,84%	3 767	28,22%	407	616
CGB	1 350 336	1 087 345	24,19%	800 870	68,61%	2 151 206	1 649 922	30,38%	9 946 872	275 385	221 010	24,6%	273 715	0,61%	319 479	610 891
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 381 891	1 098 846	25,76%	814 411	69,68%	2 196 302	1 673 261	31,26%	10 172 169	282 321	224 223	25,91%	278 551	1,35%	320 173	611 894
Options sur obligations - OGB	904	1 263	-28,42%	0	N/D	904	1 385	-34,73%	4 767	904	1 263	-28,42%	913	-0,99%	1	1
Contrats à terme sur indices																
SXF	224 999	190 449	18,14%	202 788	10,95%	427 787	384 491	11,26%	3 826 895	146 948	158 706	-7,41%	152 158	-3,42%	162 807	315 607
SXM	6 029	6 859	-12,1%	6 193	-2,65%	12 222	13 210	-7,48%	132 549	1 016	2 065	-50,8%	1 519	-33,11%	1 894	4 049
SCF	0	0	N/D	32	-100%	32	0	N/D	539	0	0	N/D	0	N/D	0	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	231 028	197 308	17,09%	209 013	10,53%	440 041	397 701	10,65%	3 959 983	147 964	160 771	-7,97%	153 677	-3,72%	164 701	319 663
Options sur indices - SXO	33 093	5 842	466,47%	68 084	-51,39%	101 177	11 066	814,31%	314 631	118 133	14 002	743,69%	127 754	-7,53%	317	775
Options sur FNB	596 902	345 230	72,9%	210 630	183,39%	807 532	695 949	16,03%	4 405 147	699 292	740 726	-5,59%	689 348	1,44%	2 005	4 656
Options sur actions	1 674 148	2 149 720	-22,12%	2 250 405	-25,61%	3 924 553	4 784 050	-17,97%	24 151 035	2 503 770	2 884 531	-13,2%	2 212 601	13,16%	65 412	162 455
Options sur devises - USX	188	547	-65,63%	506	-62,85%	694	1 693	-59,01%	5 235	649	630	3,02%	728	-10,85%	22	66
Total contrats à terme	3 434 623	2 495 780	37,62%	3 203 394	7,22%	6 638 017	4 608 401	44,04%	34 850 570	1 049 429	927 314	13,17%	970 269	8,16%	559 841	1 089 418
Total options	2 335 485	2 531 516	-7,74%	2 587 042	-9,72%	4 922 527	5 578 086	-11,75%	29 406 979	3 428 448	3 776 448	-9,22%	3 120 844	9,86%	67 818	168 107
Grand total	5 770 108	5 027 296	14,78%	5 790 436	-0,35%	11 560 544	10 186 487	13,49%	64 257 549	4 477 877	4 703 762	-4,8%	4 091 113	9,45%	627 659	1 257 525

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Février 2013	Février 2012	% VAR	Janvier 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	95 879	59 976	59,86%	99 089	-3,24%	97 601	61 886	57,71%	82 542
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
OIS	0	25	-100%	0	N/D	0	25	-100%	0
Total	95 879	59 981	59,85%	99 089	-3,24%	97 601	61 888	57,71%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 592	993	60,32%	2 609	-38,98%	2 138	1 331	60,63%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	646	99	552,53%	198	226,26%	405	63	542,86%	285
CGF	1 014	475	113,47%	417	143,17%	694	506	37,15%	611
CGB	71 070	54 367	30,72%	36 403	95,23%	52 468	40 242	30,38%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	72 731	54 942	32,38%	37 018	96,48%	53 568	40 811	31,26%	40 526
Options sur obligations - OGB	47	63	-25,4%	0	N/D	22	33	-33,33%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	11 842	9 522	24,37%	9 217	28,48%	10 433	9 377	11,26%	15 246
SXM	317	342	-7,31%	281	12,81%	298	322	-7,45%	528
SCF	0	0	N/D	1	-100%	0	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	12 159	9 865	23,25%	9 500	27,99%	10 732	9 700	10,64%	15 776
Options sur indices - SXO	1 741	292	496,23%	3 094	-43,73%	2 467	269	817,1%	1 253
Options sur FNB	31 415	17 261	82%	9 574	228,13%	19 695	16 974	16,03%	17 550
Options sur actions	88 113	107 486	-18,02%	102 291	-13,86%	95 720	116 684	-17,97%	96 219
Options sur devises - USX	9	27	-66,67%	23	-60,87%	16	41	-60,98%	20
Total contrats à terme	180 769	124 789	44,86%	145 608	24,15%	161 902	112 400	44,04%	138 846
Total options	122 920	126 575	-2,89%	117 592	4,53%	120 061	136 050	-11,75%	117 159
Grand total	303 689	251 364	20,82%	263 201	15,38%	281 964	248 450	13,49%	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.