

mars 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	
	Mars 2013	Mars 2012	% VAR	Février 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Mars 2013	Mars 2012	% VAR	Février 2013	% VAR	Mars 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 715 413	1 969 848	-12,92%	1 821 704	-5,84%	5 717 087	4 507 187	26,84%	20 718 268	603 834	553 365	9,12%	619 144	-2,47%	71 925	229 786
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	0	N/D	0	0	
OIS	0	50	-100%	0	N/D	0	150	-100%	150	0	50	-100%	0	N/D	0	
Total	1 715 413	1 969 898	-12,92%	1 821 704	-5,84%	5 717 087	4 507 337	26,84%	20 718 418	603 834	553 415	9,11%	619 144	-2,47%	71 925	229 786
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	35 900	19 450	84,58%	30 250	18,68%	123 567	74 054	66,86%	493 047	91 000	40 525	124,55%	105 700	-13,91%	78	232
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	11 739	2 595	352,37%	12 276	-4,37%	28 373	5 186	447,11%	71 699	1 493	1 513	-1,32%	2 106	-29,11%	302	689
CGF	17 160	13 895	23,5%	19 279	-10,99%	45 622	34 643	31,69%	153 598	2 493	2 133	16,88%	4 830	-48,39%	452	1 068
CGB	861 411	789 440	9,12%	1 350 336	-36,21%	3 012 617	2 439 362	23,5%	9 946 872	301 516	225 989	33,42%	275 385	9,49%	294 048	904 939
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	0	N/D	0	0	
Total	890 310	805 930	10,47%	1 381 891	-35,57%	3 086 612	2 479 191	24,5%	10 172 169	305 502	229 635	33,04%	282 321	8,21%	294 802	906 696
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	904	-100%	904	1 385	-34,73%	4 767	904	1 263	-28,42%	904	0%	0	1
Contrats à terme sur indices																
SXF	544 695	550 002	-0,97%	224 999	142,09%	972 482	934 493	4,07%	3 826 895	146 367	138 307	5,83%	146 948	-0,4%	191 698	507 305
SXM	5 939	9 115	-34,84%	6 029	-1,49%	18 161	22 325	-18,65%	132 549	435	1 671	-73,97%	1 016	-57,19%	1 663	5 712
SCF	32	0	N/D	0	N/D	64	0	N/D	539	0	0	N/D	0	N/D	6	13
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	550 666	559 117	-1,51%	231 028	138,36%	990 707	956 818	3,54%	3 959 983	146 802	139 978	4,88%	147 964	-0,79%	193 367	513 030
Options sur indices - SXO	30 676	6 430	377,08%	33 093	-7,3%	131 853	17 496	653,62%	314 631	110 206	15 423	614,56%	118 133	-6,71%	255	1 030
Options sur FNB	239 304	404 835	-40,89%	596 902	-59,91%	1 046 836	1 100 784	-4,9%	4 405 147	567 954	720 400	-21,16%	699 292	-18,78%	2 431	7 087
Options sur actions	1 494 062	2 367 812	-36,9%	1 674 148	-10,76%	5 418 615	7 151 862	-24,24%	24 151 035	2 552 303	3 236 495	-21,14%	2 503 770	1,94%	62 963	225 418
Options sur devises - USX	2 712	251	980,48%	188	1 342,55%	3 406	1 944	75,21%	5 235	2 653	379	600%	649	308,78%	45	111
Total contrats à terme	3 156 389	3 334 945	-5,35%	3 434 623	-8,1%	9 794 406	7 943 346	23,3%	34 850 570	1 056 138	923 028	14,42%	1 049 429	0,64%	560 094	1 649 512
Total options	1 802 654	2 801 610	-35,66%	2 335 485	-22,82%	6 725 181	8 379 696	-19,74%	29 406 979	3 325 020	4 020 560	-17,3%	3 428 448	-3,02%	65 772	233 879
Grand total	4 959 043	6 136 555	-19,19%	5 770 108	-14,06%	16 519 587	16 323 042	1,2%	64 257 549	4 381 158	4 943 588	-11,38%	4 477 877	-2,16%	625 866	1 883 391

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Mars 2013	Mars 2012	% VAR	Février 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	85 770	89 538	-4,21%	95 879	-10,54%	93 722	71 542	31%	82 542
ONX	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
OIS	0	2	-100%	0	N/D	0	5	-100%	0
Total	85 770	89 540	-4,21%	95 879	-10,54%	93 722	71 545	31%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 795	884	103,05%	1 592	12,75%	2 025	1 175	72,34%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	586	117	400,86%	646	-9,29%	465	82	467,07%	285
CGF	858	631	35,98%	1 014	-15,39%	747	549	36,07%	611
CGB	43 070	35 883	20,03%	71 070	-39,4%	49 387	38 720	27,55%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	44 515	36 633	21,52%	72 731	-38,8%	50 600	39 352	28,58%	40 526
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	47	-100%	14	21	-33,33%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	27 234	25 000	8,94%	11 842	129,98%	15 942	14 833	7,48%	15 246
SXM	296	414	-28,5%	317	-6,63%	297	354	-16,1%	528
SCF	1	0	N/D	0	N/D	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	27 533	25 414	8,34%	12 159	126,44%	16 241	15 187	6,94%	15 776
Options sur indices - SXO	1 533	292	425%	1 741	-11,95%	2 161	277	680,14%	1 253
Options sur FNB	11 965	18 401	-34,98%	31 415	-61,91%	17 161	17 472	-1,78%	17 550
Options sur actions	74 703	107 627	-30,59%	88 113	-15,22%	88 829	113 521	-21,75%	96 219
Options sur devises - USX	135	11	1 127,27%	9	1 400%	55	30	83,33%	20
Total contrats à terme	157 819	151 588	4,11%	180 769	-12,7%	160 564	126 084	27,35%	138 846
Total options	90 132	127 345	-29,22%	122 920	-26,67%	110 248	133 011	-17,11%	117 159
Grand total	247 952	278 934	-11,11%	303 689	-18,35%	270 812	259 095	4,52%	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.