

sept. 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	
	Septembre 2013	Septembre 2012	% VAR	Août 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Septembre 2013	Septembre 2012	% VAR	Août 2013	% VAR	Septembre 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2 340 358	1 595 070	46,72%	1 381 327	69,43%	17 309 976	16 204 331	6,82%	20 718 268	714 036	519 708	37,39%	661 065	8,01%	71 341	640 108
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	150	-100%	150	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 340 358	1 595 070	46,72%	1 381 327	69,43%	17 309 976	16 204 481	6,82%	20 718 418	714 036	519 708	37,39%	661 065	8,01%	71 341	640 108
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	63 054	40 700	54,92%	73 252	-13,92%	473 342	416 805	13,56%	493 047	151 054	124 040	21,78%	173 022	-12,7%	112	1 035
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	3 652	5 706	-36%	5 411	-32,51%	71 122	56 606	25,64%	71 699	1 266	842	50,36%	2 474	-48,83%	96	1 820
CGF	17 727	10 719	65,38%	25 427	-30,28%	215 197	122 888	75,12%	153 598	5 501	2 687	104,73%	5 815	-5,4%	461	5 542
CGB	885 081	622 654	42,15%	1 397 831	-36,68%	10 326 408	7 439 469	38,81%	9 946 872	257 350	206 160	24,83%	266 317	-3,37%	350 820	3 178 975
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	906 460	639 079	41,84%	1 428 669	-36,55%	10 612 727	7 618 963	39,29%	10 172 169	264 117	209 689	25,96%	274 606	-3,82%	351 377	3 186 337
Options sur obligations - OGB	119	0	N/D	851	-86,02%	2 755	3 846	-28,37%	4 767	970	1 190	-18,49%	851	13,98%	1	6
Contrats à terme sur indices																
SXF	513 952	507 288	1,31%	217 943	135,82%	3 002 131	2 915 641	2,97%	3 826 895	140 193	137 957	1,62%	148 732	-5,74%	195 472	1 643 710
SXM	7 086	11 597	-38,9%	8 910	-20,47%	75 951	109 246	-30,48%	132 549	1 055	1 264	-16,54%	902	16,96%	2 384	24 686
SCF	40	106	-62,26%	0	N/D	386	432	-10,65%	539	20	6	233,33%	0	N/D	4	52
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	521 078	518 991	0,4%	226 853	129,7%	3 078 468	3 025 319	1,76%	3 959 983	141 268	139 227	1,47%	149 634	-5,59%	197 860	1 668 448
Options sur indices - SXO	42 601	49 542	-14,01%	20 862	104,2%	347 190	147 892	134,76%	314 631	111 683	128 617	-13,17%	125 632	-11,1%	197	2 510
Options sur FNB	360 767	322 110	12%	120 880	198,45%	2 441 640	3 384 211	-27,85%	4 405 147	361 110	721 679	-49,96%	477 351	-24,35%	2 318	21 877
Options sur actions	1 433 367	1 919 451	-25,32%	1 802 116	-20,46%	16 152 215	18 612 438	-13,22%	24 151 035	2 792 422	2 890 382	-3,39%	2 892 802	-3,47%	57 626	627 441
Options sur devises - USX	982	241	307,47%	116	746,55%	5 931	3 663	61,92%	5 235	759	534	42,14%	530	43,21%	44	296
Total contrats à terme	3 767 896	2 753 140	36,86%	3 036 849	24,07%	31 001 171	26 848 763	15,47%	34 850 570	1 119 421	868 624	28,87%	1 085 305	3,14%	620 578	5 494 893
Total options	1 900 890	2 332 044	-18,49%	2 018 077	-5,81%	19 423 073	22 601 972	-14,07%	29 406 979	3 417 998	3 866 778	-11,61%	3 670 188	-6,87%	60 298	653 165
Grand total	5 668 786	5 085 184	11,48%	5 054 926	12,14%	50 424 244	49 450 735	1,97%	64 257 549	4 537 419	4 735 402	-4,18%	4 755 493	-4,59%	680 876	6 148 058

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Septembre 2013	Septembre 2012	% VAR	Août 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	117 017	83 951	39,39%	65 777	77,9%	92 074	86 193	6,82%	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	117 017	83 951	39,39%	65 777	77,9%	92 074	86 194	6,82%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	3 152	2 142	47,15%	3 488	-9,63%	2 517	2 217	13,53%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	182	300	-39,33%	257	-29,18%	378	301	25,58%	285
CGF	886	564	57,09%	1 210	-26,78%	1 144	653	75,19%	611
CGB	44 254	32 771	35,04%	66 563	-33,52%	54 927	39 571	38,81%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	45 323	33 635	34,75%	68 031	-33,38%	56 450	40 526	39,29%	40 526
Options sur obligations - OGB	5	0	N/D	40	-87,5%	14	20	-30%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	25 697	26 699	-3,75%	10 378	147,61%	15 968	15 508	2,97%	15 246
SXM	354	610	-41,97%	424	-16,51%	403	581	-30,64%	528
SCF	2	5	-60%	0	N/D	2	2	0%	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	26 053	27 315	-4,62%	10 802	141,19%	16 374	16 092	1,75%	15 776
Options sur indices - SXO	2 130	2 607	-18,3%	993	114,5%	1 846	786	134,86%	1 253
Options sur FNB	18 038	16 953	6,4%	5 756	213,38%	12 987	18 001	-27,85%	17 550
Options sur actions	71 668	101 023	-29,06%	85 815	-16,49%	85 916	99 002	-13,22%	96 219
Options sur devises - USX	49	12	308,33%	5	880%	31	19	63,16%	20
Total contrats à terme	188 394	144 902	30,02%	144 611	30,28%	164 899	142 812	15,47%	138 846
Total options	95 044	122 739	-22,56%	96 098	-1,1%	103 314	120 223	-14,07%	117 159
Grand total	283 439	267 641	5,9%	240 710	17,75%	268 214	263 035	1,97%	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.