

oct. 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		
	Octobre 2013	Octobre 2012	% VAR	Septembre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Octobre 2013	Octobre 2012	% VAR	Septembre 2013	% VAR	Octobre 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 937 222	1 940 359	-0,16%	2 340 358	-17,23%	19 247 198	18 144 690	6,08%	20 718 268	752 878	505 972	48,8%	714 036	5,44%	66 152	706 260
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	1 937 222	1 940 359	-0,16%	2 340 358	-17,23%	19 247 198	18 144 840	6,08%	20 718 418	752 878	505 972	48,8%	714 036	5,44%	66 152	706 260
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	26 248	47 367	-44,59%	63 054	-58,37%	499 590	464 172	7,63%	493 047	163 979	132 790	23,49%	151 054	8,56%	59	1 094
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	3 076	5 001	-38,49%	3 652	-15,77%	74 198	61 607	20,44%	71 699	1 189	1 001	18,78%	1 266	-6,08%	62	1 882
CGF	19 709	10 060	95,92%	17 727	11,18%	234 906	132 948	76,69%	153 598	5 257	3 144	67,21%	5 501	-4,44%	519	6 061
CGB	970 106	650 836	49,06%	885 081	9,61%	11 296 514	8 090 305	39,63%	9 946 872	268 524	215 354	24,69%	257 350	4,34%	374 065	3 553 040
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	992 891	665 897	49,11%	906 460	9,54%	11 605 618	8 284 860	40,08%	10 172 169	274 970	219 499	25,27%	264 117	4,11%	374 646	3 560 983
Options sur obligations - OGB	479	8 588,5%		119	302,52%	3 234	3 854	-16,09%	4 767	1 449	1 198	20,95%	970	49,38%	3	9
Contrats à terme sur indices																
SXF	243 418	208 506	16,74%	513 952	-52,64%	3 245 549	3 124 147	3,89%	3 826 895	142 193	147 188	-3,39%	140 193	1,43%	189 953	1 833 663
SXM	7 361	10 655	-30,92%	7 086	3,88%	83 312	119 901	-30,52%	132 549	2 133	1 821	17,13%	1 055	102,18%	2 667	27 353
SCF	11	15	-26,67%	40	-72,5%	397	447	-11,19%	539	1	3	-66,67%	20	-95%	3	55
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	250 790	219 176	14,42%	521 078	-51,87%	3 329 258	3 244 495	2,61%	3 959 983	144 327	149 012	-3,14%	141 268	2,17%	192 623	1 861 071
Options sur indices - SXO	50 150	41 566	20,65%	42 601	17,72%	397 340	189 458	109,73%	314 631	126 877	140 402	-9,63%	111 683	13,61%	270	2 780
Options sur FNB	139 400	175 543	-20,59%	360 767	-61,36%	2 581 040	3 559 754	-27,49%	4 405 147	408 929	751 512	-45,59%	361 110	13,24%	2 391	24 268
Options sur actions	1 973 335	2 066 288	-4,5%	1 433 367	37,67%	18 125 550	20 678 726	-12,35%	24 151 035	2 636 454	2 712 433	-2,8%	2 792 422	-5,59%	70 265	697 706
Options sur devises - USX	505	323	56,35%	982	-48,57%	6 436	3 986	61,47%	5 235	844	715	18,04%	759	11,2%	33	329
Total contrats à terme	3 180 903	2 825 432	12,58%	3 767 896	-15,58%	34 182 074	29 674 195	15,19%	34 850 570	1 172 175	874 483	34,04%	1 119 421	4,71%	633 421	6 128 314
Total options	2 190 117	2 331 095	-6,05%	1 900 890	15,22%	21 613 190	24 933 067	-13,32%	29 406 979	3 338 532	3 739 080	-10,71%	3 417 998	-2,33%	73 021	726 186
Grand total	5 371 020	5 156 527	4,16%	5 668 786	-5,25%	55 795 264	54 607 262	2,18%	64 257 549	4 510 707	4 613 563	-2,23%	4 537 419	-0,59%	706 442	6 854 500

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Octobre 2013	Octobre 2012	% VAR	Septembre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	88 055	88 198	-0,16%	117 017	-24,75%	91 653	86 403	6,08%	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	88 055	88 198	-0,16%	117 017	-24,75%	91 653	86 404	6,08%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 193	2 153	-44,59%	3 152	-62,15%	2 379	2 210	7,65%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	139	227	-38,77%	182	-23,63%	353	293	20,48%	285
CGF	895	457	95,84%	886	1,02%	1 118	633	76,62%	611
CGB	44 095	29 583	49,06%	44 254	-0,36%	53 792	38 525	39,63%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	45 131	30 268	49,11%	45 323	-0,42%	55 264	39 451	40,08%	40 526
Options sur obligations - OGB	21	0	N/D	5	320%	15	18	-16,67%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	11 064	9 477	16,75%	25 697	-56,94%	15 454	14 876	3,89%	15 246
SXM	334	484	-30,99%	354	-5,65%	396	570	-30,53%	528
SCF	0	0	N/D	2	-100%	1	2	-50%	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	11 399	9 962	14,43%	26 053	-56,25%	15 853	15 449	2,62%	15 776
Options sur indices - SXO	2 279	1 889	20,65%	2 130	7%	1 892	902	109,76%	1 253
Options sur FNB	6 336	7 979	-20,59%	18 038	-64,87%	12 290	16 951	-27,5%	17 550
Options sur actions	89 697	93 922	-4,5%	71 668	25,16%	86 312	98 470	-12,35%	96 219
Options sur devises - USX	22	14	57,14%	49	-55,1%	30	18	66,67%	20
Total contrats à terme	144 586	128 428	12,58%	188 394	-23,25%	162 771	141 305	15,19%	138 846
Total options	99 550	105 958	-6,05%	95 044	4,74%	102 919	118 728	-13,32%	117 159
Grand total	244 137	234 387	4,16%	283 439	-13,87%	265 691	260 034	2,18%	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.