

nov. 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		
	Novembre 2013	Novembre 2012	% VAR	Octobre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Novembre 2013	Novembre 2012	% VAR	Octobre 2013	% VAR	Novembre 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 608 895	1 181 581	36,17%	1 937 222	-16,95%	20 856 093	19 326 271	7,92%	20 718 268	779 235	508 423	53,27%	752 878	3,5%	47 661	753 921
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	1 608 895	1 181 581	36,17%	1 937 222	-16,95%	20 856 093	19 326 421	7,92%	20 718 418	779 235	508 423	53,27%	752 878	3,5%	47 661	753 921
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	33 233	16 753	98,37%	26 248	26,61%	532 823	480 925	10,79%	493 047	185 453	137 392	34,98%	163 979	13,1%	140	1 234
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	2 594	4 193	-38,14%	3 076	-15,67%	76 792	65 800	16,71%	71 699	1 493	1 359	9,86%	1 189	25,57%	72	1 954
CGF	26 051	11 698	122,7%	19 709	32,18%	260 957	144 646	80,41%	153 598	7 412	2 929	153,06%	5 257	40,99%	390	6 451
CGB	1 573 379	1 246 041	26,27%	970 106	62,19%	12 869 893	9 336 346	37,85%	9 946 872	275 973	299 778	-7,94%	268 524	2,77%	388 038	3 941 078
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 602 024	1 261 932	26,95%	992 891	61,35%	13 207 642	9 546 792	38,35%	10 172 169	284 878	304 066	-6,31%	274 970	3,6%	388 500	3 949 483
Options sur obligations - OGB	1 435	910	57,69%	479	199,58%	4 669	4 764	-1,99%	4 767	1 435	910	57,69%	1 449	-0,97%	2	11
Contrats à terme sur indices																
SXF	199 696	221 853	-9,99%	243 418	-17,96%	3 445 245	3 346 000	2,97%	3 826 895	150 433	150 585	-0,1%	142 193	5,8%	154 522	1 988 185
SXM	6 765	7 359	-8,07%	7 361	-8,1%	90 077	127 260	-29,22%	132 549	2 726	2 371	14,97%	2 133	27,8%	2 172	29 525
SCF	9	60	-85%	11	-18,18%	406	507	-19,92%	539	0	8	-100%	1	-100%	7	62
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	206 470	229 272	-9,95%	250 790	-17,67%	3 535 728	3 473 767	1,78%	3 959 983	153 159	152 964	0,13%	144 327	6,12%	156 701	2 017 772
Options sur indices - SXO	23 531	45 524	-48,31%	50 150	-53,08%	420 871	234 982	79,11%	314 631	123 411	147 348	-16,25%	126 877	-2,73%	228	3 008
Options sur FNB	173 133	218 247	-20,67%	139 400	24,2%	2 754 173	3 778 001	-27,1%	4 405 147	473 830	770 259	-38,48%	408 929	15,87%	2 166	26 434
Options sur actions	1 562 911	1 945 779	-19,68%	1 973 335	-20,8%	19 688 461	22 624 505	-12,98%	24 151 035	2 787 180	2 715 876	2,63%	2 636 454	5,72%	55 193	752 899
Options sur devises - USX	251	325	-22,77%	505	-50,3%	6 687	4 311	55,12%	5 235	628	825	-23,88%	844	-25,59%	16	345
Total contrats à terme	3 417 389	2 672 785	27,86%	3 180 903	7,44%	37 599 463	32 346 980	16,24%	34 850 570	1 217 272	965 453	26,08%	1 172 175	3,85%	592 862	6 721 176
Total options	1 794 494	2 227 538	-19,44%	2 190 117	-18,06%	23 407 684	27 160 605	-13,82%	29 406 979	3 571 937	3 772 640	-5,32%	3 338 532	6,99%	57 745	783 931
Grand total	5 211 883	4 900 323	6,36%	5 371 020	-2,96%	61 007 147	59 507 585	2,52%	64 257 549	4 789 209	4 738 093	1,08%	4 510 707	6,17%	650 607	7 505 107

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2013	Novembre 2012	% VAR	Octobre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	80 444	53 708	49,78%	88 055	-8,64%	90 678	83 302	8,86%	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	80 444	53 708	49,78%	88 055	-8,64%	90 678	83 303	8,85%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 661	761	118,27%	1 193	39,23%	2 316	2 072	11,78%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	129	190	-32,11%	139	-7,19%	333	283	17,67%	285
CGF	1 302	531	145,2%	895	45,48%	1 134	623	82,02%	611
CGB	78 668	56 638	38,9%	44 095	78,41%	55 956	40 242	39,05%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	80 101	57 360	39,65%	45 131	77,49%	57 424	41 149	39,55%	40 526
Options sur obligations - OGB	71	41	73,17%	21	238,1%	20	20	0%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	9 509	10 084	-5,7%	11 064	-14,06%	14 914	14 422	3,41%	15 246
SXM	322	334	-3,59%	334	-3,59%	389	548	-29,02%	528
SCF	0	2	-100%	0	N/D	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	9 831	10 421	-5,66%	11 399	-13,76%	15 306	14 973	2,22%	15 776
Options sur indices - SXO	1 120	2 069	-45,87%	2 279	-50,86%	1 821	1 012	79,94%	1 253
Options sur FNB	8 244	9 920	-16,9%	6 336	30,11%	11 922	16 284	-26,79%	17 550
Options sur actions	74 424	88 444	-15,85%	89 697	-17,03%	85 231	97 519	-12,6%	96 219
Options sur devises - USX	11	14	-21,43%	22	-50%	28	18	55,56%	20
Total contrats à terme	162 732	121 490	33,95%	144 586	12,55%	162 768	139 426	16,74%	138 846
Total options	85 452	101 251	-15,6%	99 550	-14,16%	101 331	117 071	-13,45%	117 159
Grand total	248 184	222 741	11,42%	244 137	1,66%	264 100	256 498	2,96%	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.