

déc. 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	
	Décembre 2013	Décembre 2012	% VAR	Novembre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012	Décembre 2013	Décembre 2012	% VAR	Novembre 2013	% VAR	Décembre 2013	A-à-D 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 722 050	1 391 997	23,71%	1 608 895	7,03%	22 578 143	20 718 268	8,98%	20 718 268	667 149	451 821	47,66%	779 235	-14,38%	44 492	798 413
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	1 722 050	1 391 997	23,71%	1 608 895	7,03%	22 578 143	20 718 418	8,98%	20 718 418	667 149	451 821	47,66%	779 235	-14,38%	44 492	798 413
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	55 456	12 122	357,48%	33 233	66,87%	588 279	493 047	19,32%	493 047	111 929	55 150	102,95%	185 453	-39,65%	100	1 334
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	2 557	5 899	-56,65%	2 594	-1,43%	79 349	71 699	10,67%	71 699	1 686	1 117	50,94%	1 493	12,93%	36	1 990
CGF	15 653	8 952	74,86%	26 051	-39,91%	276 610	153 598	80,09%	153 598	6 079	1 844	229,66%	7 412	-17,98%	460	6 911
CGB	954 558	610 526	56,35%	1 573 379	-39,33%	13 824 451	9 946 872	38,98%	9 946 872	269 522	249 254	8,13%	275 973	-2,34%	353 997	4 295 075
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	972 768	625 377	55,55%	1 602 024	-39,28%	14 180 410	10 172 169	39,4%	10 172 169	277 287	252 215	9,94%	284 878	-2,67%	354 493	4 303 976
Options sur obligations - OGB	0	3	-100%	1 435	-100%	4 669	4 767	-2,06%	4 767	1 435	913	57,17%	1 435	0%	0	11
Contrats à terme sur indices																
SXF	549 747	480 895	14,32%	199 696	175,29%	3 994 992	3 826 895	4,39%	3 826 895	136 352	146 716	-7,06%	150 433	-9,36%	211 311	2 199 496
SXM	10 117	5 289	91,28%	6 765	49,55%	100 194	132 549	-24,41%	132 549	1 229	755	62,78%	2 726	-54,92%	3 876	33 401
SCF	0	32	-100%	9	-100%	406	539	-24,68%	539	0	0	N/D	0	N/D	0	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	559 864	486 216	15,15%	206 470	171,16%	4 095 592	3 959 983	3,42%	3 959 983	137 581	147 471	-6,71%	153 159	-10,17%	215 187	2 232 959
Options sur indices - SXO	90 513	79 649	13,64%	23 531	284,65%	511 384	314 631	62,54%	314 631	129 029	99 837	29,24%	123 411	4,55%	346	3 354
Options sur FNB	151 776	627 146	-75,8%	173 133	-12,34%	2 905 949	4 405 147	-34,03%	4 405 147	311 161	612 909	-49,23%	473 830	-34,33%	2 824	29 258
Options sur actions	1 647 004	1 526 530	7,89%	1 562 911	5,38%	21 335 465	24 151 035	-11,66%	24 151 035	2 693 007	2 610 992	3,14%	2 787 180	-3,38%	51 114	804 013
Options sur devises - USX	244	924	-73,59%	251	-2,79%	6 931	5 235	32,4%	5 235	484	619	-21,81%	628	-22,93%	27	372
Total contrats à terme	3 254 682	2 503 590	30%	3 417 389	-4,76%	40 854 145	34 850 570	17,23%	34 850 570	1 082 017	851 507	27,07%	1 217 272	-11,11%	614 172	7 335 348
Total options	1 944 993	2 246 374	-13,42%	1 794 494	8,39%	25 352 677	29 406 979	-13,79%	29 406 979	3 247 045	3 380 450	-3,95%	3 571 937	-9,1%	54 411	838 342
Grand total	5 199 675	4 749 964	9,47%	5 211 883	-0,23%	66 206 822	64 257 549	3,03%	64 257 549	4 329 062	4 231 957	2,3%	4 789 209	-9,61%	668 583	8 173 690

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Décembre 2013	Décembre 2012	% VAR	Novembre 2013	% VAR	2013	2012	% VAR	Total 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	86 102	73 263	17,53%	80 444	7,03%	90 312	82 542	9,41%	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	86 102	73 263	17,53%	80 444	7,03%	90 312	82 543	9,41%	82 543
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	2 772	638	334,48%	1 661	66,89%	2 353	1 964	19,81%	1 964
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	127	310	-59,03%	129	-1,55%	317	285	11,23%	285
CGF	782	471	66,03%	1 302	-39,94%	1 106	611	81,02%	611
CGB	47 727	32 132	48,53%	78 668	-39,33%	55 297	39 628	39,54%	39 628
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	48 638	32 914	47,77%	80 101	-39,28%	56 721	40 526	39,96%	40 526
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	71	-100%	18	18	0%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	27 487	25 310	8,6%	9 509	189,06%	15 916	15 246	4,4%	15 246
SXM	505	278	81,66%	322	56,83%	399	528	-24,43%	528
SCF	0	1	-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	27 993	25 590	9,39%	9 831	184,74%	16 317	15 776	3,43%	15 776
Options sur indices - SXO	4 525	4 192	7,94%	1 120	304,02%	2 037	1 253	62,57%	1 253
Options sur FNB	7 588	33 007	-77,01%	8 244	-7,96%	11 577	17 550	-34,03%	17 550
Options sur actions	82 350	80 343	2,5%	74 424	10,65%	85 001	96 219	-11,66%	96 219
Options sur devises - USX	12	48	-75%	11	9,09%	27	20	35%	20
Total contrats à terme	162 734	131 767	23,5%	162 732	0%	162 765	138 846	17,23%	138 846
Total options	97 249	118 230	-17,75%	85 452	13,81%	101 006	117 159	-13,79%	117 159
Grand total	259 983	249 998	3,99%	248 184	4,75%	263 772	256 006	3,03%	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.