

fév. 2014

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	
	Février 2014	Février 2013	% VAR	Janvier 2014	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013	Février 2014	Février 2013	% VAR	Janvier 2014	% VAR	Février 2014	A-à-D 2014
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 926 015	1 821 704	5,73%	2 670 759	-27,89%	4 596 774	4 001 674	14,87%	22 578 143	848 397	619 144	37,03%	832 841	1,87%	58 240	128 674
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	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 926 015	1 821 704	5,73%	2 670 759	-27,89%	4 596 774	4 001 674	14,87%	22 578 143	848 397	619 144	37,03%	832 841	1,87%	58 240	128 674
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	58 858	30 250	94,57%	75 826	-22,38%	134 684	87 667	53,63%	588 279	168 000	105 700	58,94%	133 554	25,79%	126	270
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	2 354	12 276	-80,82%	1 707	37,9%	4 061	16 634	-75,59%	79 349	1 527	2 106	-27,49%	1 921	-20,51%	47	68
CGF	24 274	19 279	25,91%	18 724	29,64%	42 998	28 462	51,07%	276 610	4 900	4 830	1,45%	5 794	-15,43%	608	1 198
CGB	1 513 957	1 350 336	12,12%	1 062 240	42,53%	2 576 197	2 151 206	19,76%	13 824 451	296 095	275 385	7,52%	304 244	-2,68%	364 618	763 803
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 540 585	1 381 891	11,48%	1 082 671	42,3%	2 623 256	2 196 302	19,44%	14 180 410	302 522	282 321	7,16%	311 959	-3,03%	365 273	765 069
Options sur obligations - OGB	1 435	904	58,74%	0	N/D	1 435	904	58,74%	4 669	1 435	904	58,74%	1 435	0%	1	1
Contrats à terme sur indices																
SXF	211 041	224 999	-6,2%	252 531	-16,43%	463 572	427 787	8,37%	3 994 992	146 960	146 948	0,01%	145 500	1%	163 045	350 819
SXM	8 218	6 029	36,31%	8 963	-8,31%	17 181	12 222	40,57%	100 194	2 550	1 016	150,98%	1 408	81,11%	3 086	6 548
SCF	164	0	N/D	50	228%	214	32	568,75%	406	2	0	N/D	20	-90%	18	22
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	219 423	231 028	-5,02%	261 544	-16,11%	480 967	440 041	9,3%	4 095 592	149 512	147 964	1,05%	146 928	1,76%	166 149	357 389
Options sur indices - SXO	27 980	33 093	-15,45%	101 139	-72,34%	129 119	101 177	27,62%	511 384	112 425	118 133	-4,83%	116 770	-3,72%	244	675
Options sur FNB	220 446	596 902	-63,07%	146 203	50,78%	366 649	807 532	-54,6%	2 905 949	363 725	699 292	-47,99%	387 568	-6,15%	3 559	7 515
Options sur actions	1 763 573	1 674 148	5,34%	1 898 463	-7,11%	3 662 036	3 924 553	-6,69%	21 335 465	2 606 157	2 500 995	4,21%	2 327 518	11,97%	69 313	146 225
Options sur devises - USX	310	188	64,89%	490	-36,74%	800	694	15,27%	6 931	786	649	21,11%	774	1,55%	33	79
Total contrats à terme	3 686 023	3 434 623	7,32%	4 014 974	-8,19%	7 700 997	6 638 017	16,01%	40 854 145	1 300 431	1 049 429	23,92%	1 291 728	0,67%	589 662	1 251 132
Total options	2 072 602	2 335 485	-11,26%	2 222 121	-6,73%	4 294 723	4 922 527	-12,75%	25 352 677	3 252 528	3 425 673	-5,05%	2 967 619	9,6%	73 276	154 765
Grand total	5 758 625	5 770 108	-0,2%	6 237 095	-7,67%	11 995 720	11 560 544	3,76%	66 206 822	4 552 959	4 475 102	1,74%	4 259 347	6,89%	662 938	1 405 897

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Février 2014	Février 2013	% VAR	Janvier 2014	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	101 369	95 879	5,73%	121 398	-16,5%	112 116	97 601	14,87%	90 312
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	101 369	95 879	5,73%	121 398	-16,5%	112 116	97 601	14,87%	90 312
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	3 097	1 592	94,54%	3 446	-10,13%	3 284	2 138	53,6%	2 353
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	123	646	-80,96%	77	59,74%	99	405	-75,56%	317
CGF	1 277	1 014	25,94%	851	50,06%	1 048	694	51,01%	1 106
CGB	79 681	71 070	12,12%	48 283	65,03%	62 834	52 468	19,76%	55 297
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	81 083	72 731	11,48%	49 212	64,76%	63 981	53 568	19,44%	56 721
Options sur obligations - OGB	75	47	59,57%	0	N/D	35	22	59,09%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	11 107	11 842	-6,21%	11 478	-3,23%	11 306	10 433	8,37%	15 916
SXM	432	317	36,28%	407	6,14%	419	298	40,6%	399
SCF	8	0	N/D	2	300%	5	0	N/D	1
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	11 548	12 159	-5,03%	11 888	-2,86%	11 730	10 732	9,3%	16 317
Options sur indices - SXO	1 472	1 741	-15,45%	4 597	-67,98%	3 149	2 467	27,65%	2 037
Options sur FNB	11 602	31 415	-63,07%	6 645	74,6%	8 942	19 695	-54,6%	11 577
Options sur actions	92 819	88 113	5,34%	86 293	7,56%	89 317	95 720	-6,69%	85 001
Options sur devises - USX	16	9	77,78%	22	-27,27%	19	16	18,75%	27
Total contrats à terme	194 001	180 769	7,32%	182 498	6,3%	187 829	161 902	16,01%	162 765
Total options	109 084	122 920	-11,26%	101 005	8%	104 749	120 061	-12,75%	101 006
Grand total	303 085	303 689	-0,2%	283 504	6,91%	292 578	281 964	3,76%	263 772

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.