

nov 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	
	Novembre 2014	Novembre 2013	% VAR	Octobre 2014	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013	Novembre 2014	Novembre 2013	% VAR	Octobre 2014	% VAR	Novembre 2014	A-à-D 2014
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 552 697	1 608 895	-3,49%	2 707 815	-42,66%	22 453 092	20 856 093	7,66%	22 578 143	749 318	779 235	-3,84%	676 330	10,79%	74 164	741 086
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	1 552 697	1 608 895	-3,49%	2 707 815	-42,66%	22 453 092	20 856 093	7,66%	22 578 143	749 318	779 235	-3,84%	676 330	10,79%	74 164	741 086
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	17 491	33 233	-47,37%	16 613	5,29%	368 722	532 823	-30,8%	588 279	103 313	185 453	-44,29%	108 011	-4,35%	57	918
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	1 402	2 594	-45,95%	560	150,36%	13 873	76 792	-81,93%	79 349	469	1 493	-68,59%	642	-26,95%	24	259
CGF	33 020	26 051	26,75%	36 292	-9,02%	273 748	260 957	4,9%	276 610	9 316	7 412	25,69%	16 192	-42,47%	799	7 611
CGB	1 815 443	1 573 379	15,39%	1 200 779	51,19%	14 000 597	12 869 893	8,79%	13 824 451	401 090	275 973	45,34%	357 978	12,04%	342 348	4 361 059
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 849 865	1 602 024	15,47%	1 237 631	49,47%	14 288 218	13 207 642	8,18%	14 180 410	410 875	284 878	44,23%	374 812	9,62%	343 171	4 368 929
Options sur obligations - OGB	590	1 435	-58,89%	192	207,29%	5 130	4 669	9,87%	4 669	590	1 435	-58,89%	1 061	-44,39%	1	6
Contrats à terme sur indices																
SXF	224 582	199 696	12,46%	359 631	-37,55%	3 725 740	3 445 245	8,14%	3 994 992	130 951	150 433	-12,95%	137 729	-4,92%	180 542	2 311 562
SXM	7 432	6 765	9,86%	10 038	-25,96%	82 846	90 077	-8,03%	100 194	2 242	2 726	-17,76%	3 039	-26,23%	1 908	26 104
SCF	25	9	177,78%	42	-40,48%	571	406	40,64%	406	1	0	N/D	12	-91,67%	6	111
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
EMF	578	0	N/D	716	-19,27%	2 632	0	N/D	0	88	0	N/D	62	41,94%	80	495
Total	232 617	206 470	12,66%	370 427	-37,2%	3 811 789	3 535 728	7,81%	4 095 592	133 282	153 159	-12,98%	140 842	-5,37%	182 536	2 338 272
Options sur indices - SXO	14 371	23 531	-38,93%	34 834	-58,74%	365 624	420 871	-13,13%	511 384	106 016	123 411	-14,1%	109 056	-2,79%	85	2 258
Options sur FNB	357 153	173 133	106,29%	634 335	-43,7%	3 329 379	2 754 173	20,89%	2 905 949	735 846	473 830	55,3%	738 664	-0,38%	3 996	33 721
Options sur actions	1 758 003	1 562 911	12,48%	1 956 341	-10,14%	18 635 047	19 688 461	-5,35%	21 335 465	2 971 982	2 787 180	6,63%	2 873 188	3,44%	73 479	757 697
Options sur devises - USX	70	251	-72,11%	113	-38,05%	1 885	6 687	-71,81%	6 931	350	628	-44,27%	391	-10,49%	7	218
Total contrats à terme	3 635 179	3 417 389	6,37%	4 315 873	-15,77%	40 553 099	37 599 463	7,86%	40 854 145	1 293 475	1 217 272	6,26%	1 191 984	8,51%	599 871	7 448 287
Total options	2 147 678	1 794 494	19,68%	2 642 428	-18,72%	22 705 787	23 407 684	-3%	25 352 677	3 918 097	3 571 937	9,69%	3 830 371	2,29%	77 625	794 818
Grand total	5 782 857	5 211 883	10,96%	6 958 301	-16,89%	63 258 886	61 007 147	3,69%	66 206 822	5 211 572	4 789 209	8,82%	5 022 355	3,77%	677 496	8 243 105

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2014	Novembre 2013	% VAR	Octobre 2014	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	81 720	80 444	1,59%	123 082	-33,61%	98 048	90 678	8,13%	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	81 720	80 444	1,59%	123 082	-33,61%	98 048	90 678	8,13%	90 312
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	920	1 661	-44,61%	755	21,85%	1 610	2 316	-30,48%	2 353
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	73	129	-43,41%	25	192%	60	333	-81,98%	317
CGF	1 737	1 302	33,41%	1 649	5,34%	1 195	1 134	5,38%	1 106
CGB	95 549	78 668	21,46%	54 580	75,06%	61 137	55 956	9,26%	55 297
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	97 361	80 101	21,55%	56 255	73,07%	62 393	57 424	8,65%	56 721
Options sur obligations - OGB	31	71	-56,34%	8	287,5%	22	20	10%	18
Contrats à terme sur indices									
SXF	11 229	9 509	18,09%	16 346	-31,3%	16 198	14 914	8,61%	15 916
SXM	371	322	15,22%	456	-18,64%	360	389	-7,46%	399
SCF	1	0	N/D	1	0%	2	1	100%	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
EMF	28	0	N/D	32	-12,5%	22	0	N/D	0
Total	11 630	9 831	18,3%	16 837	-30,93%	16 572	15 306	8,27%	16 317
Options sur indices - SXO	718	1 120	-35,89%	1 583	-54,64%	1 589	1 821	-12,74%	2 037
Options sur FNB	17 857	8 244	116,61%	28 833	-38,07%	14 475	11 922	21,41%	11 577
Options sur actions	87 900	74 424	18,11%	88 924	-1,15%	81 021	85 231	-4,94%	85 001
Options sur devises - USX	3	11	-72,73%	5	-40%	8	28	-71,43%	27
Total contrats à terme	181 758	162 732	11,69%	196 176	-7,35%	176 317	162 768	8,32%	162 765
Total options	107 383	85 452	25,67%	120 110	-10,6%	98 720	101 331	-2,58%	101 006
Grand total	289 142	248 184	16,5%	316 286	-8,58%	275 038	264 100	4,14%	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.