

jan 2015

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	
	Janvier 2015	Janvier 2014	% VAR	Décembre 2014	% VAR	2015	2014	% VAR	Total 2014	Janvier 2015	Janvier 2014	% VAR	Décembre 2014	% VAR	Janvier 2015	A-à-D 2015
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2 729 283	2 670 759	2,19%	2 187 137	24,79%	2 729 283	2 670 759	2,19%	24 640 229	641 342	832 841	-22,99%	622 094	3,09%	156 321	156 321
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	2 729 283	2 670 759	2,19%	2 187 137	24,79%	2 729 283	2 670 759	2,19%	24 640 229	641 342	832 841	-22,99%	622 094	3,09%	156 321	156 321
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	59 321	75 826	-21,77%	23 939	147,80%	59 321	75 826	-21,77%	392 661	105 151	133 554	-21,27%	65 757	59,91%	137	137
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	300	1 707	-82,43%	396	-24,24%	300	1 707	-82,43%	14 269	473	1 921	-75,38%	473	0,00%	6	6
CGF	18 338	18 724	-2,06%	27 278	-32,77%	18 338	18 724	-2,06%	301 026	5 895	5 794	1,74%	6 710	-12,15%	608	608
CGB	1 281 068	1 062 240	20,6%	955 609	34,06%	1 281 068	1 062 240	20,6%	14 956 206	355 752	304 244	16,93%	401 470	-11,39%	531 093	531 093
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 299 706	1 082 671	20,05%	983 283	32,18%	1 299 706	1 082 671	20,05%	15 271 501	362 120	311 959	16,08%	408 653	-11,39%	531 707	531 707
Options sur obligations - OGB	3	0	N/D	0	N/D	3	0	N/D	5 130	593	1 435	-58,68%	590	N/D	1	1
Contrats à terme sur indices																
SXF	342 418	252 531	35,59%	679 999	-49,64%	342 418	252 531	35,59%	4 405 739	152 589	145 500	4,87%	133 625	14,19%	282 185	282 185
SXM	12 116	8 963	35,18%	15 921	-23,90%	12 116	8 963	35,18%	98 767	618	1 408	-56,11%	1 327	-53,43%	2 843	2 843
SCF	50	50	0%	26	92,31%	50	50	0%	597	1	20	-95%	3	-66,67%	13	13
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	590	0	N/D	676	-12,72%	590	0	N/D	3 308	117	0	N/D	84	39,29%	70	70
Total	355 174	261 544	35,8%	696 622	-49,01%	355 174	261 544	35,8%	4 508 411	153 325	146 928	4,35%	135 039	13,54%	285 111	285 111
Options sur indices - SXO	25 873	101 139	-74,42%	62 966	-58,91%	25 873	101 139	-74,42%	428 590	80 726	116 770	-30,87%	71 073	13,58%	322	322
Options sur FNB	432 007	146 203	195,48%	734 845	-41,21%	432 007	146 203	195,48%	4 064 224	747 705	387 563	92,93%	631 734	18,36%	5 249	5 249
Options sur actions	2 036 417	1 898 463	7,27%	2 039 493	-0,15%	2 036 417	1 898 463	7,27%	20 674 540	2 431 461	2 325 928	4,54%	3 207 828	-24,20%	93 573	93 573
Options sur devises - USX	188	490	-61,63%	285	-34,04%	188	490	-61,63%	2 170	314	774	-59,43%	212	48,11%	34	34
Total contrats à terme	4 384 163	4 014 974	9,2%	3 867 042	13,37%	4 384 163	4 014 974	9,2%	44 420 141	1 156 787	1 291 728	-10,45%	1 165 786	-0,77%	973 139	973 139
Total options	2 553 809	2 222 121	14,93%	2 861 528	-10,75%	2 553 809	2 222 121	14,93%	25 567 315	3 365 950	2 966 024	13,48%	3 977 194	-15,37%	99 316	99 316
Grand total	6 937 972	6 237 095	11,24%	6 728 570	3,11%	6 937 972	6 237 095	11,24%	69 987 456	4 522 737	4 257 752	6,22%	5 142 980	-12,06%	1 072 455	1 072 455

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Janvier 2015	Janvier 2014	% VAR	Décembre 2014	% VAR	2015	2014	% VAR	Total 2014
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	129 965	121 398	7,06%	104 149	24.79%	129 965	121 398	7,06%	98 560
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	129 965	121 398	7,06%	104 149	24.79%	129 965	121 398	7,06%	98 560
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	2 824	3 446	-18,05%	1 139	147.94%	2 824	3 446	-18,05%	1 570
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	14	77	-81,82%	18	-22.22%	14	77	-81,82%	57
CGF	873	851	2,59%	1 298	-32.74%	873	851	2,59%	1 204
CGB	61 003	48 283	26,35%	45 505	34.06%	61 003	48 283	26,35%	59 824
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	61 890	49 212	25,76%	46 823	32.18%	61 890	49 212	25,76%	61 086
Options sur obligations - OGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	20
Contrats à terme sur indices									
SXF	16 305	11 478	42,05%	32 380	-49.64%	16 305	11 478	42,05%	17 552
SXM	576	407	41,52%	758	-24.01%	576	407	41,52%	393
SCF	2	2	0%	1	100.00%	2	2	0%	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
EMF	28	0	N/D	32	-12.50%	28	0	N/D	23
Total	16 913	11 888	42,27%	33 172	-49.01%	16 913	11 888	42,27%	17 961
Options sur indices - SXO	1 232	4 597	-73,2%	2 998	-58.91%	1 232	4 597	-73,2%	1 707
Options sur FNB	20 571	6 645	209,57%	34 992	-41.21%	20 571	6 645	209,57%	16 192
Options sur actions	96 972	86 293	12,38%	97 118	-0.15%	96 972	86 293	12,38%	82 368
Options sur devises - USX	8	22	-63,64%	13	-38.46%	8	22	-63,64%	8
Total contrats à terme	208 769	182 498	14,4%	184 144	13.37%	208 769	182 498	14,4%	176 972
Total options	121 609	101 005	20,4%	136 263	-10.75%	121 609	101 005	20,4%	101 861
Grand total	330 379	283 504	16,53%	320 408	3.11%	330 379	283 504	16,53%	278 834

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.