

Statistiques

novembre 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	
	Novembre 2015	Novembre 2014	% VAR	Octobre 2015	% VAR	2015	2014	% VAR	Total 2014	Novembre 2015	Novembre 2014	% VAR	Octobre 2015	% VAR	Novembre 2015	A-à-D 2015
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 435 135	1 552 697	-7,57%	1 924 063	-25,41%	19 715 528	22 453 092	-12,19%	24 640 229	689 180	749 318	-8,03%	694 609	-0,78%	93 401	1 343 112
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	1 435 135	1 552 697	-7,57%	1 924 063	-25,41%	19 715 528	22 453 092	-12,19%	24 640 229	689 180	749 318	-8,03%	694 609	-0,78%	93 401	1 343 112
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	35 456	17 491	102,71%	16 880	110,05%	550 217	368 722	49,22%	392 661	101 280	103 313	-1,97%	72 053	40,56%	61	1 474
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	0	1 402	-100%	0	N/D	2 840	13 873	-79,53%	14 269	0	469	-100%	0	N/D	0	44
CGF	18 291	33 020	-44,61%	5 463	234,82%	172 739	273 748	-36,9%	301 026	4 852	9 316	-47,92%	6 599	-26,47%	282	7 304
CGB	2 019 881	1 815 443	11,26%	1 256 288	60,78%	16 769 838	14 000 597	19,78%	14 956 206	383 744	401 090	-4,33%	384 990	-0,32%	470 905	5 954 825
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 038 172	1 849 865	10,18%	1 261 751	61,54%	16 945 417	14 288 218	18,6%	15 271 501	388 596	410 875	-5,42%	391 589	-0,76%	471 187	5 962 173
Options sur obligations - OGB	685	590	16,1%	1 200	-42,92%	3 677	5 130	-28,32%	5 130	685	590	16,1%	2 030	-66,26%	2	13
Contrats à terme sur indices																
SXF	270 141	224 582	20,29%	356 630	-24,25%	4 601 992	3 725 740	23,52%	4 405 739	216 873	130 951	65,61%	222 400	-2,49%	224 483	2 963 956
SXM	2 234	7 432	-69,94%	2 641	-15,41%	42 557	82 846	-48,63%	98 767	587	2 242	-73,82%	728	-19,37%	1 341	14 930
SCF	1	25	-96%	2	-50%	107	571	-81,26%	597	0	1	-100%	1	-100%	1	48
SXA	0	0	N/D	0	N/D	20	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	3
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	21	0	N/D	162	-87,04%	187	0	N/D	0	117	0	N/D	115	1,74%	7	53
EMF	0	578	-100%	0	N/D	2 626	2 632	-0,23%	3 308	0	88	-100%	0	N/D	0	677
SXK	760	0	N/D	1 696	-55,19%	2 496	0	N/D	0	2 356	0	N/D	1 656	42,27%	26	52
SXU	1 000	0	N/D	629	58,98%	1 629	0	N/D	0	1 625	0	N/D	625	160%	4	10
Total	274 157	232 617	17,86%	361 760	-24,22%	4 651 614	3 811 789	22,03%	4 508 411	221 558	133 282	66,23%	225 525	-1,76%	225 862	2 979 729
Options sur indices																
SXJ	1	0	N/D	0	N/D	201	0	N/D	0	1	0	N/D	0	N/D	1	2
SXO	57 933	14 371	303,12%	48 341	19,84%	488 167	365 624	33,52%	428 590	143 229	106 016	35,1%	155 960	-8,16%	161	2 869
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	57 934	14 371	303,13%	48 341	19,84%	488 368	365 624	33,57%	428 590	143 230	106 016	35,1%	155 960	-8,16%	162	2 871
Options sur FNB	618 191	357 153	73,09%	545 185	13,39%	7 182 296	3 329 379	115,73%	4 064 224	1 664 456	735 846	126,2%	1 718 412	-3,14%	2 549	36 156
Options sur actions	1 937 011	1 758 003	10,18%	2 120 944	-8,67%	19 650 254	18 635 047	5,45%	20 674 540	3 082 815	2 971 982	3,73%	3 095 217	-0,4%	65 537	795 556
Options sur devises - USX	135	70	92,86%	166	-18,68%	2 324	1 885	23,29%	2 170	339	350	-3,14%	280	21,07%	7	334
Total contrats à terme	3 747 464	3 635 179	3,09%	3 547 574	5,64%	41 312 559	40 553 099	1,87%	44 420 141	1 299 334	1 293 475	0,45%	1 311 723	-0,94%	790 450	10 285 014
Total options	2 650 083	2 147 678	23,39%	2 732 756	-3,03%	27 877 847	22 705 787	22,78%	25 567 315	4 993 370	3 918 097	27,44%	5 043 992	-1%	68 354	836 445
Grand total	6 397 547	5 782 857	10,63%	6 280 330	1,87%	69 190 406	63 258 886	9,38%	69 987 456	6 292 704	5 211 572	20,75%	6 355 715	-0,99%	858 804	11 121 459

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2015	Novembre 2014	% VAR	Octobre 2015	% VAR	2015	2014	% VAR	Total 2014
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	71 756	81 720	-12,19%	91 622	-21,68%	86 094	98 048	-12,19%	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	71 756	81 720	-12,19%	91 622	-21,68%	86 094	98 048	-12,19%	98 560
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	1 772	920	92,61%	803	120,67%	2 402	1 610	49,19%	1 570
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	73	-100%	0	N/D	12	60	-80%	57
CGF	914	1 737	-47,38%	260	251,54%	754	1 195	-36,9%	1 204
CGB	100 994	95 549	5,7%	59 823	68,82%	73 230	61 137	19,78%	59 824
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	101 908	97 361	4,67%	60 083	69,61%	73 997	62 393	18,6%	61 086
Options sur obligations - OGB	34	31	9,68%	57	-40,35%	16	22	-27,27%	20
Contrats à terme sur indices									
SXF	12 863	11 229	14,55%	16 982	-24,26%	20 008	16 198	23,52%	17 552
SXM	106	371	-71,43%	125	-15,2%	185	360	-48,61%	393
SCF	0	1	-100%	0	N/D	0	2	-100%	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	1	0	N/D	7	-85,71%	0	0	N/D	0
EMF	0	28	-100%	0	N/D	11	22	-50%	23
SXK	36	0	N/D	80	-55%	29	0	N/D	0
SXU	47	0	N/D	29	62,07%	19	0	N/D	0
Total	13 055	11 630	12,25%	17 226	-24,21%	20 224	16 572	22,04%	17 961
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	2	0	N/D	0
SXO	2 758	718	284,12%	2 301	19,86%	2 122	1 589	33,54%	1 707
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	2 758	718	284,12%	2 301	19,86%	2 123	1 589	33,61%	1 707
Options sur FNB	29 437	17 857	64,85%	25 961	13,39%	31 227	14 475	115,73%	16 192
Options sur actions	92 238	87 900	4,94%	100 997	-8,67%	85 435	81 021	5,45%	82 368
Options sur devises - USX	6	3	100%	7	-14,29%	10	8	25%	8
Total contrats à terme	178 450	181 758	-1,82%	168 932	5,63%	179 619	176 317	1,87%	176 972
Total options	126 194	107 383	17,52%	130 131	-3,03%	121 208	98 720	22,78%	101 861
Grand total	304 645	289 142	5,36%	299 063	1,87%	300 827	275 038	9,38%	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

EMF: Contrats à terme sur l'indice FTSE Marchés émergents

SXK: Contrats à terme sur l'Indice Composé S&P/TSX Banques (groupe industriel)

SXJ: Options sur l'Indice Composé S&P/TSX Banques (groupe industriel)

SXU: Contrats à terme sur l'Indice plafonné des services aux collectivités S&P/TSX

SXV: Options sur l'Indice plafonné des services aux collectivités S&P/TSX

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}, SXKMC, SXJMC, SXUMC, SXVMC, EMFMC et SXO^{MC} sont des marques de commerce de Bourse de Montréal Inc.