

Statistiques

nov. 2016

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 2016	Novembre 2015	% VAR	Octobre 2016	% VAR	2016	2015	% VAR	Total 2015	Novembre 2016	Novembre 2015	% VAR	Octobre 2016	% VAR	Novembre 2016	A-à-D 2016
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2 423 332	1 435 135	68,86%	2 616 072	-7,37%	24 065 073	19 715 528	22,06%	21 746 698	928 172	689 180	34,68%	768 838	20,72%	139 797	1 536 155
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	2 423 332	1 435 135	68,86%	2 616 072	-7,37%	24 065 073	19 715 528	22,06%	21 746 698	928 172	689 180	34,68%	768 838	20,72%	139 797	1 536 155
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	73 640	35 456	107,69%	120 191	-38,73%	492 077	550 217	-10,57%	580 007	147 613	101 280	45,75%	102 160	44,49%	94	990
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	2 840	-100%	2 840	0	0	N/D	0	N/D	0	0
CGF	23 317	18 291	27,48%	2 720	757,24%	92 254	172 739	-46,59%	176 269	3 858	4 852	-20,49%	2 237	72,46%	960	3 870
CGB	2 901 876	2 019 881	43,67%	1 438 900	101,67%	19 599 363	16 769 838	16,87%	17 913 516	435 534	383 744	13,5%	401 363	8,51%	816 758	7 166 715
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 925 193	2 038 172	43,52%	1 441 620	102,91%	19 691 617	16 945 417	16,21%	18 092 625	439 392	388 596	13,07%	403 600	8,87%	817 718	7 170 585
Options sur obligations - OGB	1 394	685	103,5%	0	N/D	4 371	3 677	18,87%	3 677	1 394	685	103,5%	364	282,97%	5	15
Contrats à terme sur indices																
SXF	367 725	270 141	36,12%	349 076	5,34%	5 279 825	4 601 992	14,73%	5 474 698	258 652	216 873	19,26%	249 159	3,81%	306 416	3 319 121
SXM	858	2 234	-61,59%	1 544	-44,43%	16 971	42 557	-60,12%	45 867	1 447	587	146,51%	1 205	20,08%	523	7 218
SCF	10	1	900%	2	400%	129	107	20,56%	115	2	0	N/D	2	0%	4	60
SXA	0	0	N/D	0	N/D	0	20	-100%	20	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	21	-100%	0	N/D	66	187	-64,71%	189	0	117	-100%	0	N/D	0	11
EMF	0	0	N/D	0	N/D	0	2 626	-100%	2 626	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXK	0	760	-100%	0	N/D	2 746	2 496	10,02%	3 950	0	2 356	-100%	0	N/D	0	204
SXU	0	1 000	-100%	10	-100%	1 034	1 629	-36,53%	1 629	10	1 625	-99,39%	10	0%	0	16
Total	368 593	274 157	34,45%	350 632	5,12%	5 300 771	4 651 614	13,96%	5 529 094	260 111	221 558	17,4%	250 376	3,89%	306 943	3 326 630
Options sur indices																
SXJ	2	1	100%	2	0%	4	201	-98,01%	202	0	1	-100%	2	-100%	1	2
SXO	31 258	57 933	-46,05%	70 836	-55,87%	667 179	488 167	36,67%	541 759	114 320	143 229	-20,18%	137 950	-17,13%	223	2 426
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	31 260	57 934	-46,04%	70 838	-55,87%	667 183	488 368	36,62%	541 961	114 320	143 230	-20,18%	137 952	-17,13%	224	2 428
Options sur FNB	1 263 312	618 191	104,36%	685 956	84,17%	10 031 302	7 182 296	39,67%	8 719 474	1 622 519	1 664 456	-2,52%	1 333 824	21,64%	5 362	46 312
Options sur actions	2 311 320	1 937 682	19,28%	2 029 335	13,9%	23 512 402	19 650 965	19,65%	21 457 412	3 170 507	3 083 380	2,83%	2 953 328	7,35%	103 380	986 920
Options sur devises - USX	372	135	175,56%	535	-30,47%	18 567	2 324	698,92%	2 491	2 040	339	501,77%	2 085	-2,16%	51	597
Total contrats à terme	5 717 118	3 747 464	52,56%	4 408 324	29,69%	49 057 461	41 312 559	18,75%	45 368 417	1 627 675	1 299 334	25,27%	1 422 814	14,4%	1 264 458	12 033 370
Total options	3 681 298	2 650 083	38,91%	2 906 855	26,64%	34 725 902	27 877 847	24,57%	31 305 022	5 058 393	4 993 370	1,3%	4 529 713	11,67%	109 116	1 037 262
Grand total	9 398 416	6 397 547	46,91%	7 315 179	28,48%	83 783 363	69 190 406	21,09%	76 673 439	6 686 068	6 292 704	6,25%	5 952 527	12,32%	1 373 574	13 070 632

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2016	Novembre 2015	% VAR	Octobre 2016	% VAR	2016	2015	% VAR	Total 2015
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	115 396	71 756	60,82%	130 803	-11,78%	104 630	86 094	21,53%	86 986
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	115 396	71 756	60,82%	130 803	-11,78%	104 630	86 094	21,53%	86 986
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	3 506	1 772	97,86%	6 009	-41,65%	2 139	2 402	-10,95%	2 320
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	12	-100%	11
CGF	1 110	914	21,44%	136	716,18%	401	754	-46,82%	705
CGB	138 184	100 994	36,82%	71 945	92,07%	85 214	73 230	16,37%	71 654
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	139 294	101 908	36,69%	72 081	93,25%	85 615	73 997	15,7%	72 370
Options sur obligations - OGB	66	34	94,12%	0	N/D	19	16	18,75%	14
Contrats à terme sur indices									
SXF	16 714	12 863	29,94%	17 453	-4,23%	22 856	20 008	14,23%	21 811
SXM	39	106	-63,21%	77	-49,35%	73	185	-60,54%	182
SCF	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
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	1	-100%	0	N/D	0	0	N/D	0
EMF	0	0	N/D	0	N/D	0	11	-100%	10
SXK	0	36	-100%	0	N/D	11	29	-62,07%	37
SXU	0	47	-100%	0	N/D	4	19	-78,95%	15
Total	16 754	13 055	28,33%	17 531	-4,43%	22 947	20 224	13,46%	22 028
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	2	-100%	1
SXO	1 420	2 758	-48,51%	3 541	-59,9%	2 888	2 122	36,1%	2 158
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	1 420	2 758	-48,51%	3 541	-59,9%	2 888	2 123	36,03%	2 159
Options sur FNB	57 423	29 437	95,07%	34 297	67,43%	43 425	31 227	39,06%	34 738
Options sur actions	105 060	92 270	13,86%	101 466	3,54%	101 785	85 438	19,13%	85 487
Options sur devises - USX	16	6	166,67%	26	-38,46%	80	10	700%	9
Total contrats à terme	259 869	178 450	45,63%	220 416	17,9%	212 369	179 619	18,23%	180 750
Total options	167 331	126 194	32,6%	145 342	15,13%	150 328	121 208	24,03%	124 721
Grand total	427 200	304 645	40,23%	365 758	16,8%	362 698	300 827	20,57%	305 471

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.