

novembre 2012

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 2012	Novembre 2011	% VAR	Octobre 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011	Novembre 2012	Novembre 2011	% VAR	Octobre 2012	% VAR	Novembre 2012	A-à-D 2012
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	1 181 581	1 281 450	-7,79%	1 940 359	-39,11%	19 326 271	19 628 089	-1,54%	20 790 678	508 423	487 729	4,24%	505 972	0,48%	52 958	867 948
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	150	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	3
Total	1 181 581	1 281 450	-7,79%	1 940 359	-39,11%	19 326 421	19 628 089	-1,54%	20 790 678	508 423	487 729	4,24%	505 972	0,48%	52 958	867 951
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	16 753	22 014	-23,9%	47 367	-64,63%	480 925	613 046	-21,55%	635 046	137 392	144 128	-4,67%	132 790	3,47%	32	989
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	4 193	7 884	-46,82%	5 001	-16,16%	65 800	57 247	14,94%	59 650	1 359	4 806	-71,72%	1 001	35,76%	81	1 016
CGF	11 698	14 413	-18,84%	10 060	16,28%	144 646	87 311	65,67%	105 580	2 929	4 199	-30,25%	3 144	-6,84%	222	3 252
CGB	1 246 041	839 854	48,36%	650 836	91,45%	9 336 346	7 350 432	27,02%	7 782 924	299 778	186 412	60,82%	215 354	39,2%	255 075	2 983 024
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 261 932	862 151	46,37%	665 897	89,51%	9 546 792	7 494 990	27,38%	7 948 154	304 066	195 417	55,6%	219 499	38,53%	255 378	2 987 292
Options sur obligations - OGB	910	1 181	-22,95%	8	11 275%	4 764	8 775	-45,71%	8 775	910	1 181	-22,95%	1 198	-24,04%	2	9
Contrats à terme sur indices																
SXF	221 853	241 124	-7,99%	208 506	6,4%	3 346 000	3 734 442	-10,4%	4 226 332	150 585	139 349	8,06%	147 188	2,31%	165 613	1 847 420
SXM	7 359	8 508	-13,51%	10 655	-30,93%	127 260	91 266	39,44%	100 554	2 371	2 860	-17,1%	1 821	30,2%	3 002	53 439
SCF	60	50	20%	15	300%	507	192	164,06%	232	8	5	60%	3	166,67%	9	72
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	229 272	249 682	-8,17%	219 176	4,61%	3 473 767	3 825 900	-9,2%	4 327 118	152 964	142 214	7,56%	149 012	2,65%	168 624	1 900 931
Options sur indices - SXO	45 524	5 371	747,59%	41 566	9,52%	234 982	88 357	165,95%	93 045	147 348	16 440	796,28%	140 402	4,95%	354	4 203
Options sur FNB	218 247	455 277	-52,06%	175 543	24,33%	3 778 001	3 629 656	4,09%	3 862 981	770 259	692 725	11,19%	751 512	2,5%	3 261	37 789
Options sur actions	1 945 779	2 413 048	-19,36%	2 066 288	-5,83%	22 624 505	21 122 644	7,11%	23 161 967	2 715 876	3 030 907	-10,39%	2 712 433	0,13%	76 193	897 836
Options sur devises - USX	325	1 006	-67,69%	323	0,62%	4 311	15 993	-73,04%	16 947	825	1 378	-40,13%	715	15,39%	37	372
Total contrats à terme	2 672 785	2 393 283	11,68%	2 825 432	-5,4%	32 346 980	30 948 979	4,52%	33 065 950	965 453	825 360	16,97%	874 483	10,4%	476 960	5 756 174
Total options	2 227 538	2 961 942	-24,8%	2 331 095	-4,44%	27 160 605	26 480 586	2,57%	28 822 603	3 772 640	3 993 836	-5,54%	3 739 080	0,9%	79 879	942 169
Grand total	4 900 323	5 355 225	-8,5%	5 156 527	-4,97%	59 507 585	57 429 565	3,62%	61 888 553	4 738 093	4 819 196	-1,68%	4 613 563	2,7%	556 839	6 698 343

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Novembre 2012	Novembre 2011	% VAR	Octobre 2012	% VAR	2012	2011	% VAR	Total 2011
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	53 708	58 247	-7,79%	88 198	-39,11%	83 302	85 339	-2,39%	83 162
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	53 708	58 247	-7,79%	88 198	-39,11%	83 303	85 339	-2,39%	83 162
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	761	1 000	-23,9%	2 153	-64,65%	2 072	2 665	-22,25%	2 540
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	190	358	-46,93%	227	-16,3%	283	248	14,11%	238
CGF	531	655	-18,93%	457	16,19%	623	379	64,38%	422
CGB	56 638	38 175	48,36%	29 583	91,46%	40 242	31 958	25,92%	31 131
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	57 360	39 188	46,37%	30 268	89,51%	41 149	32 586	26,28%	31 792
Options sur obligations - OGB	41	53	-22,64%	0	N/D	20	38	-47,37%	35
Contrats à terme sur indices									
SXF	10 084	10 960	-7,99%	9 477	6,41%	14 422	16 236	-11,17%	16 905
SXM	334	386	-13,47%	484	-30,99%	548	633	-13,43%	613
SCF	2	2	0%	0	N/D	2	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	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	10 421	11 349	-8,18%	9 962	4,61%	14 973	16 634	-9,99%	17 308
Options sur indices - SXO	2 069	244	747,95%	1 889	9,53%	1 012	384	163,54%	372
Options sur FNB	9 920	20 694	-52,06%	7 979	24,33%	16 284	15 781	3,19%	15 451
Options sur actions	88 444	109 684	-19,37%	93 922	-5,83%	97 519	91 837	6,19%	92 647
Options sur devises - USX	14	45	-68,89%	14	0%	18	69	-73,91%	67
Total contrats à terme	121 490	108 785	11,68%	128 428	-5,4%	139 426	134 560	3,62%	132 263
Total options	101 251	134 633	-24,8%	105 958	-4,44%	117 071	115 132	1,68%	115 290
Grand total	222 741	243 419	-8,5%	234 387	-4,97%	256 498	249 693	2,73%	247 554

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.