

jan. 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	
	Janvier 2014	Janvier 2013	% VAR	Décembre 2013	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013	Janvier 2014	Janvier 2013	% VAR	Décembre 2013	% VAR	Janvier 2014	A-à-D 2014
<b>Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme</b>																
BAX	2 670 759	2 179 970	22,51%	1,722,050	55,09%	2 670 759	2 179 970	22,51%	22 578 143	832 841	538 041	54,79%	667,149	24,84%	70 434	70 434
ONX	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
OIS	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
<b>Total</b>	<b>2 670 759</b>	<b>2 179 970</b>	<b>22,51%</b>	<b>1,722,050</b>	<b>55,09%</b>	<b>2 670 759</b>	<b>2 179 970</b>	<b>22,51%</b>	<b>22 578 143</b>	<b>832 841</b>	<b>538 041</b>	<b>54,79%</b>	<b>667,149</b>	<b>24,84%</b>	<b>70 434</b>	<b>70 434</b>
<b>Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX</b>	<b>75 826</b>	<b>57 417</b>	<b>32,06%</b>	<b>55,456</b>	<b>36,73%</b>	<b>75 826</b>	<b>57 417</b>	<b>32,06%</b>	<b>588 279</b>	<b>133 554</b>	<b>89 500</b>	<b>49,22%</b>	<b>111,929</b>	<b>19,32%</b>	<b>144</b>	<b>144</b>
<b>Contrats à terme sur obligations</b>																
CGZ	1 707	4 358	-60,83%	2,557	-33,24	1 707	4 358	-60,83%	79 349	1 921	1 069	79,7%	1,686	13,94%	21	21
CGF	18 724	9 183	103,9%	15,653	19,62%	18 724	9 183	103,9%	276 610	5 794	3 767	53,81%	6,079	-4,69%	590	590
CGB	1 062 240	800 870	32,64%	954,558	11,26%	1 062 240	800 870	32,64%	13 824 451	304 244	273 715	11,15%	269,522	12,88%	399 185	399 185
LGB	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
<b>Total</b>	<b>1 082 671</b>	<b>814 411</b>	<b>32,94%</b>	<b>972,768</b>	<b>11,30%</b>	<b>1 082 671</b>	<b>814 411</b>	<b>32,94%</b>	<b>14 180 410</b>	<b>311 959</b>	<b>278 551</b>	<b>11,99%</b>	<b>277,287</b>	<b>12,50%</b>	<b>399 796</b>	<b>399 796</b>
<b>Options sur obligations - OGB</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>0</b>	<b>N/A</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>4 669</b>	<b>1 435</b>	<b>913</b>	<b>57,17%</b>	<b>1,435</b>	<b>0,00%</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Contrats à terme sur indices</b>																
SXF	252 531	202 788	24,53%	549,747	-54,06%	252 531	202 788	24,53%	3 994 992	145 500	152 158	-4,38%	136,352	6,71%	187 774	187 774
SXM	8 963	6 193	44,73%	10,117	-11,41%	8 963	6 193	44,73%	100 194	1 408	1 519	-7,31%	1,229	14,56%	3 462	3 462
SCF	50	32	56,25%	0	N/A	50	32	56,25%	406	20	0	N/D	0	N/A	4	4
SXA	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
SXB	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
SXH	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
SXY	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/A	0	0
<b>Total</b>	<b>261 544</b>	<b>209 013</b>	<b>25,13%</b>	<b>559,864</b>	<b>-53,28%</b>	<b>261 544</b>	<b>209 013</b>	<b>25,13%</b>	<b>4 095 592</b>	<b>146 928</b>	<b>153 677</b>	<b>-4,39%</b>	<b>137,581</b>	<b>6,79%</b>	<b>191 240</b>	<b>191 240</b>
<b>Options sur indices - SXO</b>	<b>101 139</b>	<b>68 084</b>	<b>48,55%</b>	<b>90,513</b>	<b>11,74%</b>	<b>101 139</b>	<b>68 084</b>	<b>48,55%</b>	<b>511 384</b>	<b>116 770</b>	<b>127 754</b>	<b>-8,6%</b>	<b>129,029</b>	<b>-9,50%</b>	<b>431</b>	<b>431</b>
<b>Options sur FNB</b>	<b>146 203</b>	<b>210 630</b>	<b>-30,59%</b>	<b>151,776</b>	<b>-3,67%</b>	<b>146 203</b>	<b>210 630</b>	<b>-30,59%</b>	<b>2 905 949</b>	<b>387 568</b>	<b>689 348</b>	<b>-43,78%</b>	<b>311,161</b>	<b>24,56%</b>	<b>3 956</b>	<b>3 956</b>
<b>Options sur actions</b>	<b>1 898 463</b>	<b>2 250 405</b>	<b>-15,64%</b>	<b>1,647,004</b>	<b>15,27%</b>	<b>1 898 463</b>	<b>2 250 405</b>	<b>-15,64%</b>	<b>21 335 465</b>	<b>2 327 518</b>	<b>2 209 826</b>	<b>5,33%</b>	<b>2,693,007</b>	<b>-13,57%</b>	<b>76 912</b>	<b>76 912</b>
<b>Options sur devises - USX</b>	<b>490</b>	<b>506</b>	<b>-3,16%</b>	<b>244</b>	<b>100,82%</b>	<b>490</b>	<b>506</b>	<b>-3,16%</b>	<b>6 931</b>	<b>774</b>	<b>728</b>	<b>6,32%</b>	<b>484</b>	<b>59,92%</b>	<b>46</b>	<b>46</b>
Total contrats à terme	4 014 974	3 203 394	25,34%	3,254,682	23,36%	4 014 974	3 203 394	25,34%	40 854 145	1 291 728	970 269	33,13%	1,082,017	19,38%	661 470	661 470
Total options	2 222 121	2 587 042	-14,11%	1,944,993	14,25%	2 222 121	2 587 042	-14,11%	25 352 677	2 967 619	3 118 069	-4,83%	3,247,045	-8,61%	81 489	81 489
<b>Grand total</b>	<b>6 237 095</b>	<b>5 790 436</b>	<b>7,71%</b>	<b>5,199,675</b>	<b>19,95%</b>	<b>6 237 095</b>	<b>5 790 436</b>	<b>7,71%</b>	<b>66 206 822</b>	<b>4 259 347</b>	<b>4 088 338</b>	<b>4,18%</b>	<b>4,329,062</b>	<b>-1,61%</b>	<b>742 959</b>	<b>742 959</b>

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Janvier 2014	Janvier 2013	% VAR	Décembre 2013	% VAR	2014	2013	% VAR	Total 2013
<b>Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme</b>									
BAX	121 398	99 089	22,51%	86,102	40,99%	121 398	99 089	22,51%	90 312
ONX	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
OIS	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
<b>Total</b>	<b>121 398</b>	<b>99 089</b>	<b>22,51%</b>	<b>86,102</b>	<b>40,99%</b>	<b>121 398</b>	<b>99 089</b>	<b>22,51%</b>	<b>90 312</b>
<b>Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX</b>	<b>3 446</b>	<b>2 609</b>	<b>32,08%</b>	<b>2,772</b>	<b>24,31%</b>	<b>3 446</b>	<b>2 609</b>	<b>32,08%</b>	<b>2 353</b>
<b>Contrats à terme sur obligations</b>									
CGZ	77	198	-61,11%	127	-39,37%	77	198	-61,11%	317
CGF	851	417	104,08%	782	8,82%	851	417	104,08%	1 106
CGB	48 283	36 403	32,64%	47,727	1,16%	48 283	36 403	32,64%	55 297
LGB	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
<b>Total</b>	<b>49 212</b>	<b>37 018</b>	<b>32,94%</b>	<b>48,638</b>	<b>1,18%</b>	<b>49 212</b>	<b>37 018</b>	<b>32,94%</b>	<b>56 721</b>
<b>Options sur obligations - OGB</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>0</b>	<b>-100%</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>N/D</b>	<b>18</b>
<b>Contrats à terme sur indices</b>									
SXF	11 478	9 217	24,53%	27,487	-58,24%	11 478	9 217	24,53%	15 916
SXM	407	281	44,84%	505	-19,41%	407	281	44,84%	399
SCF	2	1	100%	0	N/A	2	1	100%	1
SXA	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
SXB	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
SXH	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
SXY	0	0	N/D	0	N/A	0	0	N/D	0
<b>Total</b>	<b>11 888</b>	<b>9 500</b>	<b>25,14%</b>	<b>27,993</b>	<b>-57,53%</b>	<b>11 888</b>	<b>9 500</b>	<b>25,14%</b>	<b>16 317</b>
<b>Options sur indices - SXO</b>	<b>4 597</b>	<b>3 094</b>	<b>48,58%</b>	<b>4,525</b>	<b>1,59%</b>	<b>4 597</b>	<b>3 094</b>	<b>48,58%</b>	<b>2 037</b>
<b>Options sur FNB</b>	<b>6 645</b>	<b>9 574</b>	<b>-30,59%</b>	<b>7,588</b>	<b>-12,43%</b>	<b>6 645</b>	<b>9 574</b>	<b>-30,59%</b>	<b>11 577</b>
<b>Options sur actions</b>	<b>86 293</b>	<b>102 291</b>	<b>-15,64%</b>	<b>82,350</b>	<b>4,79%</b>	<b>86 293</b>	<b>102 291</b>	<b>-15,64%</b>	<b>85 001</b>
<b>Options sur devises - USX</b>	<b>22</b>	<b>23</b>	<b>-4,35%</b>	<b>12</b>	<b>83,33%</b>	<b>22</b>	<b>23</b>	<b>-4,35%</b>	<b>27</b>
Total contrats à terme	182 498	145 608	25,34%	162,734	12,14%	182 498	145 608	25,34%	162 765
Total options	101 005	117 592	-14,11%	97,249	3,86%	101 005	117 592	-14,11%	101 006
<b>Grand total</b>	<b>283 504</b>	<b>263 201</b>	<b>7,71%</b>	<b>259,983</b>	<b>9,05%</b>	<b>283 504</b>	<b>263 201</b>	<b>7,71%</b>	<b>263 772</b>

## 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<sup>MD</sup>, ONX<sup>MD</sup>, OBX<sup>MD</sup>, CGZ<sup>MD</sup>, CGF<sup>MD</sup>, CGB<sup>MD</sup>, LGB<sup>MD</sup>, OGB<sup>MD</sup> et USX<sup>MD</sup> sont des marques enregistrées de Bourse de Montréal Inc.

OIS-MX<sup>MC</sup>, SXF<sup>MC</sup>, SXM<sup>MC</sup>, SCF<sup>MC</sup>, SXA<sup>MC</sup>, SXB<sup>MC</sup>, SXH<sup>MC</sup>, SXY<sup>MC</sup> et SXO<sup>MC</sup> sont des marques de commerce de Bourse de Montréal Inc.