

Statistiques

déc. 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	
	Décembre 2016	Décembre 2015	% VAR	Novembre 2016	% VAR	2016	2015	% VAR	Total 2015	Décembre 2016	Décembre 2015	% VAR	Novembre 2016	% VAR	Décembre 2016	A-à-D 2016
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	2 251 464	2 031 170	10,85%	2 423 332	-7,09%	26 316 537	21 746 698	21,01%	21 746 698	936 688	613 542	52,67%	928 172	0,92%	135 355	1 671 510
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	2 251 464	2 031 170	10,85%	2 423 332	-7,09%	26 316 537	21 746 698	21,01%	21 746 698	936 688	613 542	52,67%	928 172	0,92%	135 355	1 671 510
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	191 170	29 790	541,73%	73 640	159,6%	683 247	580 007	17,8%	580 007	250 940	62 102	304,08%	147 613	70%	173	1 163
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	24 545	3 530	595,33%	23 317	5,27%	116 799	176 269	-33,74%	176 269	3 753	4 742	-20,86%	3 858	-2,72%	863	4 733
CGB	1 368 918	1 143 678	19,69%	2 901 876	-52,83%	20 968 281	17 913 516	17,05%	17 913 516	434 366	421 910	2,95%	435 534	-0,27%	609 928	7 776 643
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	1 393 463	1 147 208	21,47%	2 925 193	-52,36%	21 085 080	18 092 625	16,54%	18 092 625	438 119	426 652	2,69%	439 392	-0,29%	610 791	7 781 376
Options sur obligations - OGB	182	0	N/D	1 394	-86,94%	4 553	3 677	23,82%	3 677	1 576	685	130,07%	1 394	13,06%	1	16
Contrats à terme sur indices																
SXF	810 432	872 706	-7,14%	367 725	120,39%	6 090 257	5 474 698	11,24%	5 474 698	244 525	216 181	13,11%	258 652	-5,46%	283 899	3 603 020
SXM	2 959	3 310	-10,6%	858	244,87%	19 930	45 867	-56,55%	45 867	1 109	431	157,31%	1 447	-23,36%	896	8 114
SCF	14	8	75%	10	40%	143	115	24,35%	115	3	0	N/D	2	50%	8	68
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	2	-100%	0	N/D	66	189	-65,08%	189	0	0	N/D	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	8	1 454	-99,45%	0	N/D	2 754	3 950	-30,28%	3 950	0	2 340	-100%	0	N/D	2	206
SXU	0	0	N/D	0	N/D	1 034	1 629	-36,53%	1 629	0	1 625	-100%	10	-100%	0	16
Total	813 413	877 480	-7,3%	368 593	120,68%	6 114 184	5 529 094	10,58%	5 529 094	245 637	220 577	11,36%	260 111	-5,57%	284 805	3 611 435
Options sur indices																
SXJ	0	1	-100%	2	-100%	4	202	-98,02%	202	0	0	N/D	0	N/D	0	2
SXO	4 283	53 592	-92,01%	31 258	-86,3%	671 462	541 759	23,94%	541 759	40 447	90 923	-55,52%	114 320	-64,62%	66	2 492
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	4 283	53 593	-92,01%	31 260	-86,3%	671 466	541 961	23,9%	541 961	40 447	90 923	-55,52%	114 320	-64,62%	66	2 494
Options sur FNB	1 693 466	1 537 178	10,17%	1 263 312	34,05%	11 724 768	8 719 474	34,47%	8 719 474	1 745 245	988 578	76,54%	1 622 519	7,56%	4 495	50 807
Contrats à terme sur actions	608	0	N/D	0	N/D	608	0	N/D	0	571	0	N/D	0	N/D	322	322
Options sur actions	1 790 563	1 806 447	-0,88%	2 311 320	-22,53%	25 302 965	21 457 412	17,92%	21 457 412	3 073 153	3 145 313	-2,29%	3 170 507	-3,07%	82 632	1 069 552
Options sur devises - USX	439	167	162,87%	372	18,01%	19 006	2 491	662,99%	2 491	741	257	188,33%	2 040	-63,68%	43	640
Total contrats à terme	4 458 948	4 055 858	9,94%	5 717 118	-22,01%	53 516 409	45 368 417	17,96%	45 368 417	1 621 015	1 260 771	28,57%	1 627 675	-0,41%	1 031 273	13 064 643
Total options	3 680 103	3 427 175	7,38%	3 681 298	-0,03%	38 406 005	31 305 022	22,68%	31 305 022	5 112 102	4 287 858	19,22%	5 058 393	1,06%	87 410	1 124 672
Grand total	8 139 051	7 483 033	8,77%	9 398 416	-13,4%	91 922 414	76 673 439	19,89%	76 673 439	6 733 117	5 548 629	21,35%	6 686 068	0,7%	1 118 683	14 189 315

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Décembre 2016	Décembre 2015	% VAR	Novembre 2016	% VAR	2016	2015	% VAR	Total 2015
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	112 573	96 722	16,39%	115 396	-2,45%	105 266	86 986	21,02%	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	112 573	96 722	16,39%	115 396	-2,45%	105 266	86 986	21,02%	86 986
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	9 558	1 418	574,05%	3 506	172,62%	2 732	2 320	17,76%	2 320
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	11	-100%	11
CGF	1 227	168	630,36%	1 110	10,54%	467	705	-33,76%	705
CGB	68 445	54 460	25,68%	138 184	-50,47%	83 873	71 654	17,05%	71 654
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	69 673	54 628	27,54%	139 294	-49,98%	84 340	72 370	16,54%	72 370
Options sur obligations - OGB	9	0	N/D	66	-86,36%	18	14	28,57%	14
Contrats à terme sur indices									
SXF	40 521	41 557	-2,49%	16 714	142,44%	24 263	21 811	11,24%	21 811
SXM	147	157	-6,37%	39	276,92%	79	182	-56,59%	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	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
EMF	0	0	N/D	0	N/D	0	10	-100%	10
SXK	0	69	-100%	0	N/D	10	37	-72,97%	37
SXU	0	0	N/D	0	N/D	4	15	-73,33%	15
Total	40 670	41 784	-2,67%	16 754	142,75%	24 359	22 028	10,58%	22 028
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	1	-100%	1
SXO	214	2 552	-91,61%	1 420	-84,93%	2 675	2 158	23,96%	2 158
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	214	2 552	-91,61%	1 420	-84,93%	2 675	2 159	23,9%	2 159
Options sur FNB	84 673	73 198	15,68%	57 423	47,46%	46 712	34 738	34,47%	34 738
Contrats à terme sur actions	32	0	N/D	0	N/D	32	0	N/D	0
Options sur actions	89 528	86 021	4,08%	105 060	-14,78%	100 808	85 487	17,92%	85 487
Options sur devises - USX	21	7	200%	16	31,25%	75	9	733,33%	9
Total contrats à terme	222 947	193 136	15,44%	259 869	-14,21%	213 212	180 750	17,96%	180 750
Total options	184 005	163 198	12,75%	167 331	9,97%	153 011	124 721	22,68%	124 721
Grand total	406 952	356 334	14,21%	427 200	-4,74%	366 224	305 471	19,89%	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

Contrats à terme sur actions

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.