

oct 2018

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	
	Octobre 2018	Octobre 2017	% VAR	Septembre 2018	% VAR	2018	2017	% VAR	Total 2017	Octobre 2018	Octobre 2017	% VAR	Septembre 2018	% VAR	Octobre 2018	A-à-D 2018
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme																
BAX	3 020 305	2 111 808	43,02%	2 007 675	50,44%	23 591 443	24 903 570	-5,27%	28 962 355	1 104 882	817 863	35,09%	816 980	35,24%	164 724	1 434 754
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	3 020 305	2 111 808	43,02%	2 007 675	50,44%	23 591 443	24 903 570	-5,27%	28 962 355	1 104 882	817 863	35,09%	816 980	35,24%	164 724	1 434 754
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	221 250	84 789	160,94%	49 903	343,36%	942 042	700 704	34,44%	801 051	312 184	208 097	50,02%	183 586	70,05%	334	1 460
Contrats à terme sur obligations																
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
CGF	26 274	21 994	19,46%	21 410	22,72%	261 804	306 957	-14,71%	358 078	4 263	4 211	1,24%	3 229	32,02%	1 260	11 605
CGB	2 413 386	1 266 627	90,54%	1 547 031	56%	22 877 942	20 026 377	14,24%	23 946 703	606 427	527 365	14,99%	612 280	-0,96%	991 594	7 703 928
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	2 439 660	1 288 621	89,32%	1 568 441	55,55%	23 139 746	20 333 334	13,8%	24 304 781	610 690	531 576	14,88%	615 509	-0,78%	992 854	7 715 533
Options sur obligations - OGB	405	650	-37,69%	1 029	-60,64%	36 786	9 292	295,89%	11 650	12 426	3 241	283,4%	12 021	3,37%	7	49
Contrats à terme sur indices																
SXF	615 729	281 781	118,51%	934 998	-34,15%	6017864	4 893 827	22,97%	6 144 651	287 959	266 964	7,86%	270 059	6,63%	503 422	3 677 769
SXM	6 793	3 544	91,68%	7 748	-12,33%	61 097	80 032	-23,66%	97 432	2 398	1 150	108,52%	708	238,7%	1 161	11 643
SCF	0	2	-100%	0	N/D	51	162	-68,52%	164	0	0	N/D	0	N/D	0	22
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	1	-100%	21	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	20
SXH	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXY	4	0	N/D	8	-50%	65	51	27,45%	51	4	0	N/D	0	N/D	4	65
EMF	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXX	0	0	N/D	0	N/D	3 092	839	268,53%	1 679	0	420	-100%	0	N/D	0	13
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	622 526	285 327	118,18%	942 755	-33,97%	6 082 190	4 974 911	22,26%	6 243 977	290 361	268 534	8,13%	270 767	7,24%	504 782	3 689 971
Options sur indices																
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
SXO	33 130	7 131	364,59%	24 702	34,12%	122 541	187 683	-34,71%	193 038	111 077	115 058	-3,46%	116 567	-4,71%	32	231
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0	0	0	N/D	0	N/D	0	0
Total	33 130	7 131	364,59%	24 702	34,12%	122 541	187 683	-34,71%	193 038	111 077	115 058	-3,46%	116 567	-4,71%	32	231
Contrats à terme sur FNB	10 000	0	N/D	0	N/D	10 000	0	N/D	N/D	10 000	0	N/D	0	N/D	2	2
Options sur FNB	1 415 781	684 179	106,93%	790 964	78,99%	12 760 898	9 963 993	28,07%	11 424 930	1 599 174	1 301 270	22,89%	1 324 559	20,73%	5 820	42 205
Contrats à terme sur actions	92 230	116 813	-21,05%	95 839	-3,77%	653 760	869 259	-24,79%	1 145 427	137 153	280 489	-51,1%	116 586	17,64%	306	3 540
Options sur actions	3 077 922	2 241 676	37,3%	2 296 498	34,03%	24 662 476	18 493 034	33,36%	23 171 286	3 667 217	2 858 221	28,3%	3 579 073	2,46%	164 101	1 312 630
Options sur devises - USX	0	381	-100%	14	-100%	128	8 071	-98,41%	9 008	0	520	-100%	0	N/D	0	29
Total contrats à terme	6 184 721	3 802 569	62,65%	4 614 710	34,02%	53 477 139	51 081 074	4,69%	60 656 540	2 153 086	1 898 462	13,41%	1 819 842	18,31%	1 662 668	12 843 800
Total options	4 748 488	3 018 806	57,3%	3 163 110	50,12%	38 524 871	29 362 777	31,2%	35 610 963	5 702 078	4 486 407	27,1%	5 215 806	9,32%	170 294	1 356 604
Grand total	10 933 209	6 821 375	60,28%	7 777 820	40,57%	92 002 010	80 443 851	14,37%	96 267 503	7 855 164	6 384 869	23,03%	7 035 648	11,65%	1 832 962	14 200 404

	Volume moyen quotidien					Volume moyen quotidien A-à-D			
	Octobre 2018	Octobre 2017	% VAR	Septembre 2018	% VAR	2018	2017	% VAR	Total 2017
Contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme									
BAX	137 286	100 562	36,52%	105 667	29,92%	112 340	119 155	-5,72%	116 314
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	137 286	100 562	36,52%	105 667	29,92%	112 340	119 155	-5,72%	116 314
Options sur taux d'intérêt à court terme - OBX	10 056	4 037	149,1%	2 626	282,94%	4 485	3 352	33,8%	3 217
Contrats à terme sur obligations									
CGZ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
CGF	1 194	1 047	14,04%	1 126	6,04%	1 246	1 468	-15,12%	1 438
CGB	109 699	60 315	81,88%	81 422	34,73%	108 942	95 819	13,7%	96 171
LGB	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	110 893	61 362	80,72%	82 549	34,34%	110 189	97 288	13,26%	97 609
Options sur obligations - OGB	18	30	-40%	54	-66,67%	175	44	297,73%	46
Contrats à terme sur indices									
SXF	27 988	13 418	108,59%	48 873	-42,73%	28 658	23 415	22,39%	24 578
SXM	308	168	83,33%	407	-24,32%	290	382	-24,08%	389
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	0	N/D	0
SXK	0	0	N/D	0	N/D	14	4	250%	6
SXU	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	28 296	13 587	108,26%	49 618	-42,97%	28 962	23 803	21,67%	24 975
Options sur indices									
SXJ	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
SXO	1 505	339	343,95%	1 300	15,77%	583	898	-35,08%	772
SXV	0	0	N/D	0	N/D	0	0	N/D	0
Total	1 505	339	343,95%	1 300	15,77%	583	898	-35,08%	772
Contrats à terme sur FNB	454	0	N/D	0	N/D	106	0	N/D	N/D
Options sur FNB	64 353	32 579	97,53%	41 629	54,59%	60 766	47 674	27,46%	45 699
Contrats à terme sur actions	4 192	5 562	-24,63%	5 044	-16,89%	3 113	4 159	-25,15%	4 581
Options sur actions	139 905	106 746	31,06%	120 868	15,75%	117 440	88 483	32,73%	92 685
Options sur devises - USX	0	18	-100%	0	N/D	0	38	-100%	36
Total contrats à terme	281 123	181 074	55,25%	242 879	15,75%	254 653	244 407	4,19%	242 626
Total options	215 840	143 752	50,15%	166 479	29,65%	183 451	140 491	30,58%	142 443
Grand total	496 964	324 827	52,99%	409 358	21,4%	438 104	384 898	13,82%	385 070

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.