



**FRAIS – Clearing Services**  
**Commodities**

**JUILLET 2024**



## **A/ Rémunération des collatéraux**

**Sur le périmètre des Contreparties Centrales (CCP) européennes**, CACEIS applique à ses clients la rémunération de la Chambre de Compensation, **minorée de 30 bps**.

Les frais des différentes Chambres sont disponibles en suivant les liens suivants :

### **Euronext Clearing :**

<https://www.euronext.com/en/post-trade/euronext-clearing/membership>

A titre d'exemple, à partir du 15 juillet 2024, la rémunération appliquée par Euronext Clearing sur le Matif est la suivante :

#### **ECB depo rate\* moins 35bps**

\*au 1<sup>er</sup> juillet 2024, le ECB depo rate est égal au taux €STR + 8.5bps

**ICE Clear Europe :** <https://www.theice.com/clear-europe/treasury-and-banking>

**Sur les autres marchés**, CACEIS applique à ses client un taux d'intérêts de référence par devise minoré de 75 bps.

**CBOT :** application du taux USD (SOFRRATE Index) – 75 bps

## **B/ Frais de charge de capital (actifs pondérés des risques également dits « RWA »)**

En plus des taux d'intérêt mentionnés ci-dessus, afin de se conformer à la réglementation applicable relative à ses exigences en matière de capital basées sur le risque, CACEIS Bank applique à ses Clients un taux d'intérêt de **25 bps** sur le montant total des Dépôts transférés à titre de garantie.

## **C/ Frais de marché**

Au 15 juillet 2024, pour 1 lot de MATIF, les frais de marchés s'élèvent à 1,08 €uro H.T à concurrence de 0,83 € pour Euronext Clearing et 0,25 € pour Euronext.

### **Euronext Clearing :**

<https://www.euronext.com/en/post-trade/euronext-clearing>



Les frais appliqués par Euronext Clearing sur le Matif sont les suivants au 15 juillet 2024 :

	Brokers		Market Makers
	Client	House	
<b>Commodity futures</b>	€ 0.83		N/A
<b>Commodity options</b>	€ 0.83		N/A
<b>Fishpool contracts</b>	€ 8.00		N/A

A specific fee scheme is applied for multi-leg commodity options strategies with each leg being discounted to a clearing fee of €0.59 per contract.

### Euronext :

<https://www.euronext.com/fr/trade/fees-charges>

Les frais appliqués par Euronext sont les suivants au 1<sup>er</sup> juillet 2024 :

#### ■ Agricultural contracts:

FUTURES AND OPTIONS CONTRACT	TRADING
Futures – Milling Wheat, Durum Wheat, Rapeseed, Rapeseed Meal, Rapeseed Oil, Corn, Skimmed Milk Powder, Unsalted Lactic Butter, Sweet Whey Food Grade Powder, Residential Wood Pellets	€0.25
Options – Milling Wheat, Rapeseed, Rapeseed Meal, Rapeseed Oil, Corn	€0.25

FUTURES CONTRACT - WHOLESALE TRADES	TRADING
Exchange for Swaps, Against Actuals, Exchange of Options for Options	€0.25

#### Notes:

Milling Wheat, Rapeseed, Corn, Dairy and Residential Wood Pellets contracts are often settled using “alternative delivery procedures” – see contract terms for further details.

### ICE Clear Europe :

[https://www.theice.com/publicdocs/futures/IFEu\\_Fees\\_Energy\\_Softs\\_Commodities\\_Products.pdf](https://www.theice.com/publicdocs/futures/IFEu_Fees_Energy_Softs_Commodities_Products.pdf)

### CBOT :

<https://www.cmegroup.com/company/clearing-fees.html>