



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^{er} 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	
Commodity futures	€ 0.83		N/A
Commodity options	€ 0.83		N/A
Fishpool contracts	€ 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^{er} 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

CBOT :

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