



FRAIS – Clearing Services Commodities

Mars 2025

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>

Au 1^{er} septembre 2024, la rémunération appliquée par Euronext Clearing sur le Matif est la suivante :

ECB depo rate – 35bps

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 (SOFR RATE 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

A titre indicatif, au 1^{er} Janvier 2025, pour 1 lot de MATIF les frais de marchés s'élèvent à 1,16 € H.T à concurrence de 0,85 € pour Euronext Clearing et 0,31 € pour Euronext.

Euronext Clearing :

https://connect2.euronext.com/sites/default/files/documentation/clearing/fee-schedule-ccp-force-1-january-2025clean_0.pdf

Les frais appliqués par Euronext Clearing sur le Matif sont les suivants au 1^{er} janvier :

Brokers	
Client	House
Commodity futures (wheat, corn, rapeseed)	€ 0.85
Commodity options (wheat, corn, rapeseed)	€ 0.85
Fishpool contracts	€ 8.00
Spread contracts	€ 0.95

A specific fee scheme is applied for multi-leg commodity options strategies with each leg being discounted to a clearing fee of €0.61 per contract.

Euronext :

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

■ Agricultural contracts other than Corn, Durum Wheat, Salmon and Spread futures:

FUTURES AND OPTIONS CONTRACT	TRADING
Futures – Milling Wheat, Rapeseed	€0.31
Options – Milling Wheat, Rapeseed, Corn	€0.31

FUTURES AND OPTIONS CONTRACT - WHOLESALE TRADES	TRADING
Large in Scale, Exchange for Swaps, Against Actuals, Exchange of Options for Options	€0.31

■ Corn and Durum Wheat futures:

Volume per month per member per contract (lots)	TRADING
1 – 14,999	€0.31
15,000 – 19,999	€0.13
from 20,000	€0.06

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>