



FRAIS - Clearing Services

Commodities

Mars 2021



A/ rémunération des collatéraux.

CACEIS applique à ses clients lui déposant des collatéraux espèces, dans le cadre de la prestation de compensation sur dérivés de matière première, la rémunération octroyée par la Chambre de compensation auprès de laquelle le collatéral espèce est utilisé, minorée de 0.20 bp.

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

LCH.Clearnet SA :

<https://www.lch.com/membership/sa-membership/sa-fees>

A titre d'exemple, au 1^{er} Janvier 2021, la rémunération appliquée par LCH Clearnet sur le Matif est la suivante :

Currency	Unsecured overnight Index	Cash Collateral Fee / Spread (bps)		
		All Markets*	CDSClear Clients	Default funds**
EUR	EONIA	30	15	20
GBP	SONIA	35	20	
USD	FEDFUND	30	15	

* 'All markets' encompass CDSClear (House activity only), Listed Derivatives, Listed Commodities, EquityClear, RepoClear and €GCPlus (House & Clients activities).

ICE Clear Europe :

<https://www.theice.com/clear-europe/treasury-and-banking>

CBOT :

<https://www.cmegroup.com/clearing/financial-and-collateral-management/cash-interest-rates-and-non-cash-collateral-fees.html>

B/ Frais de marché

CACEIS applique à ses clients, dans le cadre de la prestation de compensation sur dérivés de matière première, les frais appliqués par la Chambre de compensation utilisée.

A date de publication, les frais des différentes Chambres sont disponibles en suivant les liens suivants.

LCH.Clearnet SA :

<https://www.lch.com/services/commodityclear/commodityclear-sa/fees>

Euronext :

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



A titre d'exemple, Au 1er Janvier 2021, pour 1 lot de MATIF, les frais de marchés s'élèvent à 0,95€ à concurrence de 0,70€ pour LCH et 0,25€ pour Euronext.

Les frais appliqués par LCH Clearnet sur le Matif sont les suivants :

Amsterdam and Paris

Product Type (fee per contract)	Brokers Client and House	Market Makers
Commodity futures	€0.70	
Commodity options	€0.70	N/A

Les frais appliqués par Euronext sont les suivants au 1er janvier 2021

■ Agricultural contracts:

FUTURES AND OPTIONS CONTRACT	TRADING
Futures – Milling 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

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>