



# FRAIS – Clearing Services

## Commodities

## 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 20 bps.

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

### **LCH.Clearnet SA :**

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

A titre d'exemple, depuis le 1<sup>er</sup> novembre 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	€STR	21.5	6.5	11.5
GBP	SONIA	35	20	
USD	FEDFUND	30	15	

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

Sur les autres marchés, CACEIS applique à ses clients un taux d'intérêt de référence par devise minoré de 50 bps.

**CBOT :** application du taux USD (SOFRRATE Index) – 50 bps

## **B/ Frais de marché**

### **LCH.Clearnet SA :**

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

### **Euronext :**

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

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**

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

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

#### ■ Agricultural contracts:

<b>FUTURES AND OPTIONS CONTRACT</b>	<b>TRADING</b>
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

<b>FUTURES CONTRACT - WHOLESALE TRADES</b>	<b>TRADING</b>
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](https://www.theice.com/publicdocs/futures/IFEu_Fees_Energy_Softs_Commodities_Products.pdf)

### **CBOT :**

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