



A	Nidal Boutayeb ARENADOUR CAPITAL LCL	Tel		Fax	
		Mail	support.sdm@sdm.lcl.fr;		

Contacts Commerciaux

Salle des Marchés LCL	Salle-des-Marches-LCL@sdm.lcl.fr	Tel	-	Fax	
-----------------------	----------------------------------	-----	---	-----	--

Date 01/07/2025

Pages 3

Objet Mark-to-market au 30/06/2025

A votre demande, nous avons calculé une valorisation des produits dérivés traités entre ARENADOUR CAPITAL LCL et CREDIT LYONNAIS. La valorisation des transactions indiquées ci-dessus est déterminée selon les modèles et méthodes internes d'évaluation préétablies de CREDIT LYONNAIS. Elle reflète l'appréciation par CREDIT LYONNAIS de la valeur indicative moyenne du prix de marché des transactions à la date à laquelle la valorisation est donnée.

Les valorisations et informations présentées dans ce rapport sont exprimées dans le sens du client. Une valeur négative indique qu'en cas d'un rachat de la transaction avant l'échéance, le client devrait acquitter une soulte égale au montant(1) indiqué dans le rapport.

Pour toute information complémentaire, nous vous prions de bien vouloir contacter votre équipe commerciale présentée en en-tête.

(1) : Voir *CLAUSE DE DECHARGE* en dernière page.



Produits de taux structurés

MTM date : 30/06/2025

Produit	Ref.	Ss Jacent	Date de Trade	Début	Maturité	Notionnel Init. (Dev. Opé)	MTM Mid (Dev. Opé)	MTM Mid (Dev. Client)	Remarque
Custom Strategy	25197207	0.0067/EUR-EURIBOR 3M	29/07/2022	30/11/2022	29/05/2026	7,255,000 (EUR)	-25,905 (EUR)	-25,905 (EUR)	
Custom Strategy	25197164	0.0161/EUR-EURIBOR 3M	29/07/2022	30/11/2022	29/05/2026	7,255,000 (EUR)	15,206 (EUR)	15,206 (EUR)	
Total								-10,699 (EUR)	



CLAUSE DE DECHARGE

La valorisation des transactions indiquées ci-dessus est déterminée selon les modèles et méthodes internes d'évaluation préétablies de CREDIT LYONNAIS. Elle reflète l'appréciation par CREDIT LYONNAIS de la valeur indicative moyenne du prix de marché des transactions à la date à laquelle la valorisation est donnée.

Cette valorisation ne correspond pas nécessairement à celle que pourrait donner un autre intervenant de marché. Elle ne saurait servir de base à une demande de résiliation ou de modification des transactions de référence, dans l'hypothèse notamment où CREDIT LYONNAIS serait amené à calculer le solde de résiliation suite à la survenance d'un cas de défaut ou d'une circonstance nouvelle et ne produira pas nécessairement les mêmes résultats. Elle ne saurait non plus être utilisée comme étant le prix auquel une contrepartie pourrait conclure la même transaction ou une transaction équivalente avec CREDIT LYONNAIS.

La valorisation qui vous est transmise ne peut être considérée comme étant un conseil en investissement, une offre, ou une recommandation de conclure l'opération.

Toutes les valorisations données par CREDIT LYONNAIS revêtent un caractère purement indicatif. Il est ainsi recommandé à chaque client de procéder à sa propre valorisation de son portefeuille et de ne prendre aucune décision sur la base des valorisations indicatives de CREDIT LYONNAIS. Le client sera, en toute hypothèse, seul responsable de l'utilisation qu'il décidera de faire des informations fournies et CREDIT LYONNAIS ne pourra être tenu responsable pour quelque perte, dommage, coût ou dépense (notamment manque à gagner, dommages directs, indirects, accessoires ou consécutifs) liés à l'utilisation qu'un client aura fait de la valorisation fournie.

Ces valorisations sont strictement confidentielles et sont uniquement réservées à un usage interne.

Les autres informations financières transmises avec ces valorisations ne sont fournies que dans le but de vous permettre d'identifier les opérations que vous avez conclues avec CREDIT LYONNAIS. Elles sont susceptibles d'être complétées et/ou modifiées en cas d'erreur; CREDIT LYONNAIS ne pourra en être tenu pour responsable.

Ces informations financières ne constituent pas une Confirmation. Seule celle-ci reprend de manière complète et exhaustive les caractéristiques des transactions engageant les deux parties.

Les transactions mentionnées aux présentes ne constituent pas nécessairement l'intégralité de votre portefeuille dans les comptes de CREDIT LYONNAIS.

CREDIT LYONNAIS a bien noté votre accord sur le mode de transmission de ce document.