

RELEVÉ DE SITUATION FINANCIÈRE

PIJENSITFI 0577

DATE DE BOURSE 02/07/92

DATE :02/07/92

0577
 FERRI SA
 53, rue Vivienne
 75002 PARIS

MONSIEUR LABORIE
 65628
 2 RUE DE LA FORGE
 31650 SAINT-ORENS

COUVERTURE REQUISE	:	805380.00 DB

GARANTIES DEPOSEES		

BONS DU TRESOR	:	
ESPECES	:	147829.88 CR
TITRES-SUPPORTS	:	
O.P.C.V.M.	:	172918.59 CR
8 VIVCOURT TERME		

TOTAL COUVERTURES EN PLACE :		320748.47 CR
POSITION NETTE	:	484631.53 DB

0577
 FERRI SA
 53, rue Vivienne
 75002 PARIS

MONSIEUR LABORIE
 65628
 2 RUE DE LA FORGE
 31650 SAINT-ORENS

N.REF	C L A S S E			O P	BOURSE DU	LOTS A/V	PREMIUM	VALORISATION	COURTAGE	COMB. COMPENS	TVA
	ECHN	PRIX D EX	TYPE								
	INDICE CAC 40 PX1										
051971/B	Ju192	1900.00	Call	O		20V	35.00	140000.00CR	2800.00DB	250.00DB	567.30DB
052142/B	Ju192	1900.00	Call	O		2V	30.00	12000.00CR	240.00DB	25.00DB	49.29DB
052169/B	Ju192	1900.00	Call	O		1V	30.00	6000.00CR	120.00DB	12.50DB	24.64DB
052170/B	Ju192	1900.00	Call	O		12V	30.00	72000.00CR	1440.00DB	150.00DB	295.74DB
052424/B	Ju192	1975.00	Call	O		2V	4.50	1800.00CR	36.00DB	16.00DB	9.56DB
051229/B	Aou92	1950.00	Call	O		1V	28.00	5600.00CR	112.00DB	12.50DB	23.15DB
051235/B	Aou92	1950.00	Call	O		19V	28.00	106400.00CR	2128.00DB	237.50DB	439.97DB
051647/B	Aou92	2000.00	Call	F		2A	17.00	6800.00DB	136.00DB	25.00DB	29.94DB
052083/B	Aou92	2025.00	Call	O		50A	10.00	100000.00DB	2000.00DB	625.00DB	488.25DB
052089/B	Aou92	2025.00	Call	O		10A	10.00	20000.00DB	400.00DB	125.00DB	97.65DB
051493/B	Ju192	1800.00	Put	O		10A	9.30	18600.00DB	372.00DB	125.00DB	92.44DB
051496/B	Ju192	1800.00	Put	O		10A	9.30	18600.00DB	372.00DB	125.00DB	92.44DB
052319/B	Ju192	1800.00	Put	O		2A	13.00	5200.00DB	25.00DB	25.00DB	4.65DB
052340/B	Ju192	1800.00	Put	O		1A	12.00	2400.00DB	12.50DB	12.50DB	2.32DB
288781/F	Ju192	1800.00	Put	O		17A	12.00	40800.00DB	816.00DB	212.50DB	191.29DB
479211/F	Ju192	1800.00	Put	O		10A	12.50	25000.00DB	500.00DB	125.00DB	116.25DB
052293/B	Ju192	1825.00	Put	O		5A	17.00	17000.00DB	340.00DB	62.50DB	74.86DB
051272/B	Ju192	1850.00	Put	O		20V	20.00	80000.00CR	1600.00DB	250.00DB	344.10DB
051295/B	Ju192	1850.00	Put	O		10V	19.00	38000.00CR	760.00DB	125.00DB	164.61DB
051301/B	Ju192	1850.00	Put	O		5V	19.00	19000.00CR	380.00DB	62.50DB	82.30DB
051311/B	Ju192	1850.00	Put	O		5V	19.00	19000.00CR	380.00DB	62.50DB	82.30DB
051366/B	Ju192	1850.00	Put	O		10V	18.50	37000.00CR	740.00DB	125.00DB	160.89DB
051479/B	Ju192	1850.00	Put	O		5V	21.00	21000.00CR	420.00DB	62.50DB	89.74DB
051480/B	Ju192	1850.00	Put	O		5V	21.00	21000.00CR	420.00DB	62.50DB	89.74DB
421525/F	Ju192	1850.00	Put	O		10V	19.00	38000.00CR	760.00DB	125.00DB	164.61DB
051478/B	Ju192	1850.00	Put	F		10V	21.50	43000.00CR	860.00DB	125.00DB	183.21DB
051277/B	Ju192	1875.00	Put	O		5A	31.00	31000.00DB	620.00DB	62.50DB	126.94DB
051279/B	Ju192	1875.00	Put	O		5A	31.00	31000.00DB	620.00DB	62.50DB	126.94DB
051355/B	Ju192	1875.00	Put	O		5A	28.00	28000.00DB	560.00DB	62.50DB	115.78DB
051356/B	Ju192	1875.00	Put	O		5A	28.00	28000.00DB	560.00DB	62.50DB	115.78DB
051528/B	Ju192	1875.00	Put	O		10A	31.00	62000.00DB	1240.00DB	125.00DB	253.89DB
051530/B	Ju192	1875.00	Put	O		10A	31.00	62000.00DB	1240.00DB	125.00DB	253.89DB
							SOLDES :				

NET A VOTRE COMPTE :

Type d operation :
 "O" : ouverture (achat ou vente d options)

"F" : fermeture (revente ou rachat d options)

"R" : regularisation

0577
 FERRI SA
 53, rue Vivienne
 75002 PARIS

MONSIEUR LABORIE
 65628
 2 RUE DE LA FORGE
 31650 SAINT-ORENS

N.REP	C L A S S E			O P	BOURSE DU	LOTS A/V	PREMIUM	VALORISATION	COURTAGE		COMM.COMPENS	TVA
	ECHN	PRIX D EX	TYPE									
052039/B	INDICE	CAC 40	PXI			5V	38.00	38000.00CR	760.00DB		62.50DB	152.98DB
052047/B	Ju192	1900.00	Put	O		5V	38.00	38000.00CR	760.00DB		62.50DB	152.98DB
052048/B	Ju192	1900.00	Put	O		5V	39.00	39000.00CR	780.00DB		62.50DB	156.70DB
							SOLDES :	278400.00CR	25272.00DB		3853.50DB	5417.22DB

NET A VOTRE COMPTE : 243857.28CR

Type d'operation
 "O": ouverture (achat ou vente d'options)

"P": fermeture (revente ou rachat d'options)

"R": régularisation

PIJENPERE

SIMON ICHN Informatique

0577
FERRI SA
53, rue Vivienne
75002 PARIS

65628
MONSIEUR LABORIE
2 RUE DE LA FORGE
31650 SAINT-ORENS

LES CLASSES PX1 ET PXL SONT JUMEEES POUR LE CALCUL DES COUVERTURES REQUISES.

COURS ACTUEL DE L'ACTION : 1873.52
COURS DE L'ACTION UTILISE POUR LE CALCUL DE COUVERTURE : 1933.52

INDICE CAC 40

SERIES	C/P	LOTS (NET)		VALEUR ACTUELLE			COUVERTURE REQUISE		
		A	Y	COURS CLOTURE	TOTAL (DB/CR)	COURS	TOTAL (DB/CR)		
PX1 07/92	P	70		13.00	18200.00	CR	4.53	63420.00	CR
PX1 07/92	P	26		20.50	10660.00	CR	8.00	41600.00	CR
PX1 07/92	P		70	30.00	42000.00	DB	19.69	275660.00	DB
PX1 07/92	C		34	23.00	156400.00	DB	60.16	409088.00	DB
PX1 07/92	P		15	58.00	174000.00	DB	36.08	108240.00	DB
PX1 07/92	C	2		16.00	6400.00	CR	38.49	15396.00	CR
PX1 07/92	C		2	4.50	1800.00	DB	19.52	7808.00	DB
PX1 07/92	C	113		2.50	56500.00	CR	7.46	168596.00	CR
PX1 07/92	C		60	1.45	17400.00	CR	3.23	38760.00	CR
PX1 07/92	C		10	1.15	2300.00	CR	1.37	2740.00	CR
PX1 08/92	C		20	22.70	90800.00	DB	52.96	211840.00	DB
PX1 08/92	C		38	9.50	72200.00	DB	30.26	229976.00	DB
PX1 08/92	C	40		8.00	64000.00	CR	14.96	119680.00	CR
VALEUR LIQUIDATIVE ACTUELLE CLASSE					480000.00	DB	RETENUE	792420.00	DB

COURS ACTUEL DE L'ACTION : 33.90
COURS DE L'ACTION UTILISE POUR LE CALCUL DE COUVERTURE : 35.26

EUROTUNNEL S.A. - P.L.C.

TNU 09/92	C		16	2.30	18400.00	DB	3.51	28080.00	DB
TNU 09/92	C		18	.85	7650.00	CR	1.08	9720.00	CR
TNU 09/92	C		30	.45	6750.00	CR	.29	4350.00	CR
TNU 09/92	C		42	.30	5300.00	CR	.05	1050.00	CR
VALEUR LIQUIDATIVE ACTUELLE CLASSE					2300.00	CR	RETENUE	12960.00	DB
VALEUR LIQUIDATIVE ACTUELLE CLIENT					477700.00	DB	A COUVRIR	805380.00	

0577
 FERRI SA
 53, rue Vivienne
 75002 PARIS

65628
 2 RUE DE LA FORGE
 31650 SAINT-ORENS

CLAS. ECHN	PRIX C/P D EX	REPORT		NEGOCIATIONS OUVERTURES FERM-COMPENS				TRANSFERTS		EXERCICE ACHAT	ASSIGN VENTE	ECHU / ABANDON		SOLDE	
		A	V	A	V	A	V	A	V			A	V		
PX1 07/92	1800.00P	20		50										70	
PX1 07/92	1825.00P	21		5										26	70
PX1 07/92	1850.00P	10			80	10	10								34
PX1 07/92	1875.00P		40	40		40	40								15
PX1 07/92	1900.00C	1			35	1	1								
PX1 07/92	1900.00P				15									2	
PX1 07/92	1925.00C	2													2
PX1 07/92	1975.00C				2									113	
PX1 07/92	2000.00C	113												60	
PX1 07/92	2025.00C	60												10	
PX1 07/92	2050.00C	10			20										20
PX1 08/92	1950.00C		40			2	2								38
PX1 08/92	2000.00C		20			60	20	20						40	
PX1 08/92	2025.00C														
TOTAL CLASSE :		237	100	157	152	73	73							321	179
TNU 09/92	35.00C		16												16
TNU 09/92	40.00C	18												18	
TNU 09/92	45.00C	30												30	
TNU 09/92	50.00C	42												42	
TOTAL CLASSE :		90	16											90	16
TOTAL CLIENT :		327	116	157	152	73	73							411	195