

Please note any valuations are indicative only

**Portfolio** : 12488 ARCA VITA CAPITAL TUTOR

**Portfolio date** : 2011/12/30

Branch name : 05672

Securities account : 0567200080124889

Asset manager : Thomas OBRINGER

Investment company : LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANA

Accounting currency : EUR

Editing currency : EUR

### COMMERCIAL PAPERS

Type	ISIN code	Internal code	Name	Maturity	Issuer	Nominal amount	Face rate	Amount converted in
FRA.	FR0119105767	FR0119105767	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/01/12	FRANCE-BONS DU TRESOR	3 000 000,000000	0.00000	3 000 000,000000
			dont au Porteur		-	3 000 000,000000	-	3 000 000,000000
FRA.	FR0119580126	FR0119580126	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/01/26	FRANCE-BONS DU TRESOR	100 000,000000	0.00000	100 000,000000
			dont au Porteur		-	100 000,000000	-	100 000,000000
FRA.	FR0119812024	FR0119812024	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/01/05	FRANCE-BONS DU TRESOR	3 000 000,000000	0.00000	3 000 000,000000
			dont au Porteur		-	3 000 000,000000	-	3 000 000,000000
FRA.	FR0119812040	FR0119812040	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/02/02	FRANCE-BONS DU TRESOR	3 350 000,000000	0.00000	3 350 000,000000
			dont au Porteur		-	3 350 000,000000	-	3 350 000,000000
FRA.	FR0120045549	FR0120045549	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/04/19	FRANCE-BONS DU TRESOR	2 870 000,000000	0.00000	2 870 000,000000
			dont au Porteur		-	2 870 000,000000	-	2 870 000,000000
FRA.	FR0120045564	FR0120045564	FRA.BT BNT PRE-CPT	2012/06/14	FRANCE-BONS DU TRESOR	1 100 000,000000	0.00000	1 100 000,000000
			dont au Porteur		-	1 100 000,000000	-	1 100 000,000000
								13 420 000,00 EUR

### DERIVATIVES CONTRACTS

Contract	Start date	End date	Face-value / Quantity	Received rate	Paid rate	Hedging operation	Amount converted in	Counterpart	Contracts type / Operation entry side / Client reference
GES54971	2010/08/03	2020/05/29	1,00 EUR	0,00000	EONIA +0,00000	No	1,00 EUR	SOCIETE GENERALE	SWAP DE GAP GEDS TRD EXO 18464
							1,00 EUR		

### FUTURES

By clearer	Inventory date	Market	Contract	Trade price	Maturity	Quantity	Balance	Currency appraisal	Amount converted in
NEWEDGE-Par	2011/12/30	CME CHICAG	EMINI S&P 500	1 220,1500	2012/03/01	25,00	B	40 562,50 USD	31 351,45 EUR
NEWEDGE-Par	2011/12/30	EUREX	EURX E-STXX 50	2 220,0000	2012/03/01	92,00	B	80 960,00 EUR	80 960,00 EUR
NEWEDGE-Par	2011/12/30	OSE TOKYO	OSK NIK 225	8 635,0000	2012/03/01	12,00	B	-2 220 000,00 JPY	-22 174,17 EUR
									90 137,28 EUR

### CASH CURRENT ACCOUNT

Currencies amount	Price	Amount converted in
186 297,45 EUR	0.0	186 297,45 EUR
-14 827 097,00 JPY	100.116500	-148 098,44 EUR
-88 859,81 USD	1.293800	-68 681,26 EUR

Please note any valuations are indicative only

**Portfolio** : 12488 ARCA VITA CAPITAL TUTOR

**Portfolio date** : 2011/12/30

-30 482,25 EUR

**CASH BROKER**

Inventory date	Contract	Class of asset (s)	Cash balance	Deposit amount in currency	Price	Cash balance	Deposit amount	Cash balance
2011/12/30	NEWEDGE-Par	FNX	104 420,00 EUR	-159 252,00 EUR	1,00000	104 420,00 EUR	-159 252,00 EUR	26 128,00 EUR
2011/12/30	NEWEDGE-Par	FNX	5 820 000,00 JPY	-3 600 000,00 JPY	0,00998	58 132,28 EUR	-35 958,11 EUR	7 191,62 EUR
2011/12/30	NEWEDGE-Par	FNX	58 937,50 USD	-125 000,00 USD	0,77291	45 553,80 EUR	-96 614,62 EUR	-17 004,17 EUR
								208 106,08 EUR

Asset position	Financial assets	% Of Assets
SECURITIES	0,00 EUR	0,00
SHARES	0,00 EUR	0,00
BONDS	0,00 EUR	0,00
OPCS	0,00 EUR	0,00
REGISTERED STOCKS	0,00 EUR	0,00
REAL ESTATE PROPERTIES	0,00 EUR	0,00
REAL ESTATE PROPERTIES	0,00 EUR	0,00
MONETARY PRODUCTS	13 420 000,00 EUR	98,69
COMMERCIAL PAPERS	13 420 000,00 EUR	98,69
MONETARY CONTRACTS	0,00 EUR	0,00
LENDINGS	0,00 EUR	0,00
REPURCHASE AGREEMENT	0,00 EUR	0,00
DERIVATIVES CONTRACTS	0,00 EUR	0,00
SWAPS	1,00 EUR	0,00
CROSS CURRENCY SWAP	0,00 EUR	0,00
DERIVATIVES	0,00 EUR	0,00
FUTURES	90 137,28 EUR	0,00
Options	0,00 EUR	0,00
FOREX	0,00 EUR	0,00
Cash	177 623,83 EUR	1,31
CASH CURRENT ACCOUNT	177 623,83 EUR	1,31
TERM DEPOSIT ACCOUNT	0,00 EUR	0,00
FORWARDS	0,00 EUR	0,00
TOTAL	13 597 623,83 EUR	100,00