



Cartera: **DCNRV**
 Periodo: 20060331 - 20060415

Riesgo de Mercado

Actividad Reciente

Fecha impresion: 2006/05/19 17:51:54

Sumario

ENTRADAS	Cantidad	V.Nominal	Valor de Mercado	PnL
Options	25	908,089.57	16,773.25	-2,747.33
TOTAL:		908,089.57	16,773.25	-2,747.33
SALIDAS	Cantidad	V.Nominal	Valor de Mercado	PnL
TOTAL:				
TRADING	Cantidad	V.Nominal	Valor de Mercado	PnL
Futures	44.00	1,882,347.48	-6,666.95	-6,666.95
Options	62.00	0.00	-435.00	1,287.00
TOTAL:		1,882,347.48	-7,101.95	-5,379.95
TOTAL ENTRADAS/SALIDAS/TRADING:		2,790,437.05	9,671.30	-8,127.29

Entradas Cartera

Instrumento	Codigo	Divisa	Fec Adq.	Cantidad	V.Nominal	Pr Adq.	Pr mercado	Valor de Mercado	PnL
Options				25	908,090			16,773	-2,747.33
C MINI SPX 06/06 1300		USD	13/04/06	25	908,090	25.00	16.25	16,773	-2,747.33
TOTAL:					908,090			16,773	-2,747.33





Cartera: **DCNRV**
 Periodo: 20060331 - 20060415

Riesgo de Mercado

Actividad Reciente

Fecha impresion: 2006/05/19 17:51:54

Salidas Cartera

Instrumento	Codigo	Divisa	Fec.Cierre	Cantidad	V.Nominal	Pr Adq.	Pr Cierre.	Valor de Mercado	PnL
TOTAL:									

Transfers

Cuenta	Fecha	Hora	Cantidad Instrumento	Importe
--------	-------	------	----------------------	---------

Actividad de Trading

Instrumento	Codigo	Divisa	Fecha Ape	Fec Cierre	Cantidad	V.Nominal	Pr Adq.	Pr Cierre	Valor de Mercado	PnL
Futures					44.00	1,882,347			-6,667	-6,666.95
FUT SX5E 06/06		EUR	31/03/06	31/03/06	1	37,860	3,786.00	3,786.00	0	0.00
FUT SX5E 06/06		EUR	03/04/06	03/04/06	2	76,090	3,798.00	3,804.50	130	130.00
FUT SX5E 06/06		EUR	04/04/06	04/04/06	2	76,420	3,817.00	3,821.00	80	80.00
FUT SX5E 06/06		EUR	05/04/06	05/04/06	1	37,970	3,805.00	3,797.00	-80	-80.00
FUT SX5E 06/06		EUR	07/04/06	07/04/06	1	37,890	3,814.00	3,789.00	-250	-250.00
FUT SX5E 06/06		EUR	13/04/06	13/04/06	4	148,370	3,706.50	3,709.25	110	110.00
FUT IBEX 04/06		EUR	31/03/06	31/03/06	2	237,230	11,836.50	11,861.50	500	500.00
FUT IBEX 04/06		EUR	03/04/06	03/04/06	1	118,510	11,795.00	11,851.00	560	560.00
FUT IBEX 04/06		EUR	04/04/06	05/04/06	1	118,390	11,913.00	11,839.00	-740	-740.00





Cartera: **DCNRV**
 Periodo: 20060331 - 20060415

Riesgo de Mercado

Actividad Reciente

Fecha impresion: 2006/05/19 17:51:54

Instrumento	Codigo	Divisa	Fecha Ape	Fec Cierre	Cantidad	V.Nominal	Pr Adq.	Pr Cierre	Valor de Mercado	Pnl
FUT IBEX 04/06		EUR	05/04/06	05/04/06	1	118,390	11,857.00	11,839.00	-180	-180.00
FUT IBEX 04/06		EUR	06/04/06	06/04/06	1	118,970	11,880.00	11,897.00	170	170.00
FUT IBEX 04/06		EUR	07/04/06	07/04/06	2	237,720	11,905.00	11,886.00	-380	-380.00
FUT IBEX 04/06		EUR	10/04/06	10/04/06	2	237,500	11,882.00	11,875.00	-140	-140.00
FUT IBEX 04/06		EUR	13/04/06	13/04/06	2	232,220	11,605.50	11,611.00	110	110.00
FUT S&P 500 MINI 06/06		USD	07/04/06	10/04/06	10	539,144	1,317.75	1,307.00	-4,434	-4,434.43
FUT S&P 500 MINI 06/06		USD	10/04/06	10/04/06	-10	-541,207	1,307.00	1,312.00	-2,063	-2,062.53
FUT CAC 04/06		EUR	13/04/06	13/04/06	1	50,880	5,094.00	5,088.00	-60	-60.00
Options					62.00	0			-435	1,287.00
P RWE 04/06 66.00		EUR	31/03/06	31/03/06	12	0	0.44	0.45	540	12.00
P RWE 04/06 66.00		EUR	31/03/06	13/04/06	-25	0	0.45	0.08	-200	925.00
P RWE 04/06 66.00		EUR	31/03/06	03/04/06	-25	0	0.45	0.31	-775	350.00
TOTAL:						1,882,347			-7,102	-5,379.95

Dividendos

Cuenta	Fecha	Hora	Cantidad Instrumento	Importe
--------	-------	------	----------------------	---------





Cartera: **DCNRV**
Periodo: 20060331 - 20060415

Riesgo de Mercado

Actividad Reciente

Fecha impresion: 2006/05/19 17:51:54

Cupones

Cuenta	Fecha	Hora	Cantidad Instrumento	Importe
--------	-------	------	----------------------	---------

Vencimientos

Cuenta	Fecha	Hora	Cantidad Instrumento	Importe
--------	-------	------	----------------------	---------

