

REPORTE RENTA FIJA

Fecha: 03 de febrero del 2010

Elaborado por: GRUPO INTERBOLSA

Instrumento	Serie	Vencimiento	Per.	Monto transado	Precio apertura	Precio Máximo	Precio Mínimo	Precio cierre	Rendimiento cierre	Fecha última negociación	Tasa facial neta	Precio vector	Rendimiento Vector	Δ Precio Vector	Duración modificada
BANCO CENTRAL DE COSTA RICA COLONES															
BCCR bem0	BCCR070410AC	07-Abr-10	1	732,015,141.62	98.96	98.96	98.96	98.96	6.10%	04-Feb-10	0.00%	98.96	6.01%	0.145	0.162
BCCR bem	BCCR290910	29-Sep-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	05-Nov-09	17.54%	106.57	7.01%	-0.234	0.591
BCCR bem0	BCCR290910AC	29-Sep-10	1	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	23-Dic-08	0.00%	95.21	7.70%	0.164	0.604
BCCR bem0	BCCR171110AC	17-Nov-10	1	26,468,586.41	94.53	94.53	94.53	94.53	7.39%	04-Feb-10	0.00%	94.55	7.34%	0.104	0.729
BCCR bem	BCCR060411AC	06-Abr-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	24-Jun-09	6.48%	98.21	8.10%	0.017	1.079
BCCR bem	BCCR280911	28-Sep-11	2	496,694,190.00	108.49	108.49	108.49	108.49	8.38%	04-Feb-10	14.03%	108.49	8.39%	-0.010	1.410
BCCR bem	BCCR241012AC	24-Oct-12	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	7.30%	94.22	9.76%	0.054	2.343
BCCR bem	BCCR030713AC	03-Jul-13	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	23-Dic-08	7.06%	92.45	9.70%	0.224	2.915
BCCR bem	BCCR191114AC	19-Nov-14	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	05-Ene-10	7.47%	87.61	10.85%	-0.887	3.784
BCCR bemv	BCCR220616	22-Jun-16	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	10.12%	94.75	8.49%	-0.079	-0.117
BCCR bemv	BCCR180117AC	18-Ene-17	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	11.04%	94.65	8.39%	-0.067	-0.544
BCCR bemv	BCCR280317AC	28-Mar-17	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	02-Nov-09	10.81%	94.68	8.45%	-0.153	-0.350
BCCR bemv	BCCR050917AC	05-Sep-17	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	11.04%	94.50	8.40%	-0.083	-0.414
BCCR bemv	BCCR280819AC	28-Ago-19	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.d.	11.04%	93.38	8.41%	-0.196	-0.433
BCCR bemv	BCCR220921	22-Sep-21	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	11.27%	92.25	8.48%	-0.178	-0.367
BCCR bemv	BCCR040522AC	04-May-22	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	01-Abr-09	10.58%	92.25	8.41%	-0.084	-0.250
MINISTERIO DE HACIENDA COLONES															
G tp	G230310	23-Mar-10	2	205,656,444.44	100.15	100.15	100.15	100.15	6.06%	04-Feb-10	7.36%	100.15	6.15%	-0.040	0.129
G tp	D072003	26-Mar-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	18-Jun-08	18.76%	101.88	5.35%	-0.312	0.138
G tp0	N070410	07-Abr-10	1	396,661,429.08	98.92	98.92	98.91	98.91	6.40%	04-Feb-10	0.00%	98.92	6.24%	0.110	0.162
G tp0	N070710	07-Jul-10	1	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	23-Dic-08	0.00%	97.35	6.42%	0.293	0.397
G tp	G290910	29-Sep-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	16.75%	105.56	7.80%	-0.231	0.590
G tp	D032001	08-Feb-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	22-Dic-08	18.00%	109.63	7.91%	-0.270	0.862
G tp	G230311	23-Mar-11	2	107,514,244.44	98.50	98.50	98.50	98.50	8.40%	04-Feb-10	7.00%	98.60	8.30%	0.164	1.039
G tp	D062001	12-May-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.d.	16.50%	111.13	7.15%	-0.212	1.125
G tp	D092001	26-Jul-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.d.	16.50%	111.88	7.85%	-0.136	1.318
G tp	G210911	21-Sep-11	2	96,934,336.22	107.65	107.65	107.65	107.65	8.56%	04-Feb-10	13.71%	107.65	8.56%	-0.050	1.393
G tp	G280312	28-Mar-12	2	1,686,750,208.33	104.55	104.56	104.55	104.55	9.59%	04-Feb-10	12.00%	104.56	9.59%	0.520	1.801
G tp	G260912	26-Sep-12	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	17-Jun-09	17.30%	116.27	10.11%	0.357	2.048
G tp	G240914	24-Sep-14	2	413,455,000.00	89.07	89.07	89.00	89.00	10.88%	04-Feb-10	7.80%	89.06	10.86%	-0.038	3.616
BANCO CENTRAL DE COSTA RICA DOLARES															
BCCR c\$V10	BCCRSV270510	27-May-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	5.08%	100.80	0.82%	0.090	-0.186
BCCR c\$A10	CERTDS-A-10	07-Feb-12	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	7.13%	109.39	2.92%	-0.101	1.849
BCCR c\$b10	CERTDS-B-10	08-Ene-13	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	18-Jun-09	7.54%	112.54	3.64%	-0.047	2.633
MINISTERIO DE HACIENDA DOLARES															
G bde11	USP3699PAB33	01-Mar-11	2	131,634.90	107.73	107.73	107.73	107.73	1.69%	04-Feb-10	9.00%	107.73	1.71%	-0.020	1.003
G bde12	USP3699PAC16	01-Feb-12	2	524,465.34	110.57	110.60	110.50	110.60	2.61%	04-Feb-10	8.11%	110.58	2.62%	-0.117	1.857
G bde13	USP3699PAE71	31-Ene-13	2	1,395,256.16	113.32	113.40	113.32	113.40	3.30%	04-Feb-10	8.05%	113.35	3.32%	0.197	2.686
G bde14	USP3699PEM51	20-Mar-14	2	1,109.77	108.54	108.54	108.54	108.54	3.61%	04-Feb-10	5.86%	108.50	4.28%	-0.205	3.605
G bde20	USP3699PAA59	01-Ago-20	2	26,166.66	130.75	130.75	130.75	130.75	6.00%	04-Feb-10	10.00%	131.00	5.98%	0.492	7.016
G tp\$	G\$180810	18-Ago-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	4.60%	102.27	0.78%	-0.104	0.523
G tp\$	G\$241110	24-Nov-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	6.29%	104.70	0.97%	0.000	0.784
G tp\$	E082001	22-Feb-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	11-Jun-09	8.50%	106.73	1.99%	-0.002	0.980
G tp\$	E032001	08-Mar-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	07-Ene-10	9.11%	107.66	2.00%	0.008	1.020
G tp\$	E152001	30-Ago-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Dic-09	7.75%	108.52	2.20%	0.829	1.450
G tp\$	G\$020512	02-May-12	2	9,616.67	105.50	105.50	105.50	105.50	2.74%	04-Feb-10	5.29%	105.76	2.63%	-0.270	2.092
G tp\$	G\$270515	27-May-15	2	259,716.56	113.00	113.00	113.00	113.00	4.22%	04-Feb-10	6.98%	113.00	4.79%	0.740	4.438
G tp\$	X152000	15-Jun-20	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	05-Ene-10	9.00%	121.65	6.16%	-0.252	7.025
MINISTERIO DE HACIENDA UNIDADES DE DESARROLLO															
G tudes	U130716	13-Jul-16	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Jun-09	1.50%	90.66	3.11%	-3.171	6.044
G tudes	U120122	12-Ene-22	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	13-Feb-09	1.00%	82.26	2.76%	0.088	11.033
FIDEICOMIDO DE TITULARIZACION CARIBLANCO DOLARES															
FTCB bft10	FTPHC10	15-Dic-10	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	25-Ene-10	7.56%	104.30	2.51%	-0.206	0.829
FTCB bft13	B	09-Sep-13	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	02-Dic-09	9.00%	110.04	5.88%	0.021	3.054
FTCB bft15	C	21-Dic-15	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	8.14%	110.00	6.10%	0.402	4.679
FTCB bft17	D	01-May-17	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	21-Dic-09	8.45%	108.44	6.96%	0.691	5.468
FTCB bft18	E	03-Oct-18	4	227,971.04	108.81	108.90	108.81	108.90	6.91%	04-Feb-10	8.28%	108.90	6.91%	1.500	6.231
FTCB bft20	F	06-Ene-20	4	616,376.64	101.50	101.50	101.50	101.50	6.85%	04-Feb-10	7.06%	101.50	6.29%	2.686	7.078
INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD DOLARES															
ICE ice 13	XS0181980615	10-Dic-13	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	6.53%	108.32	4.71%	-0.192	3.368
ICE ice 14	XS0185150165	03-Feb-14	2	2,115.36	105.75	105.75	105.75	105.75	4.35%	04-Feb-10	5.93%	105.50	4.92%	0.199	3.549
FIDEICOMISO DE TITULARIZACION PT GARABITO DOLARES															
FPTG bpgc\$	Serie C	18-Sep-17	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	05-Ene-10	9.50%	114.84	6.98%	1.001	5.512
FPTG bpgc\$	Serie D	18-Dic-19	4	240,601.17	114.17	114.55	114.17	114.17	7.44%	04-Feb-10	9.48%	114.55	7.39%	1.864	6.560
FPTG bpgc\$	Serie E	17-Jun-22	4	442,499.26	115.40	116.40	116.40	116.40	7.78%	04-Feb-10	9.85%	116.40	7.78%	0.670	7.441