

REPORTE RENTA FIJA

Fecha: 09 de marzo 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	298,366,443.72	99.46	99.46	99.46	99.46	7.24%	09-Mar-10	0.00%	99.46	7.24%	0.500	0.070
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%	105.54	7.12%	-1.036	0.497
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%	95.92	7.70%	0.704	0.513
BCCR bem0	BCCR171110AC	17-Nov-10	1	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	0.00%	95.23	7.30%	0.681	0.639
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%	97.61	8.85%	-0.596	0.981
BCCR bem	BCCR280911	28-Sep-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	14.03%	107.83	8.52%	-0.663	1.315
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%	94.21	9.85%	-0.007	2.249
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%	92.22	9.86%	-0.231	2.819
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%	87.31	11.00%	-0.304	3.687
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%	94.48	8.77%	-0.269	-0.214
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%	94.66	8.62%	0.014	-0.642
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%	94.53	8.67%	-0.158	-0.447
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%	94.07	8.66%	-0.430	-0.511
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%	93.04	8.67%	-0.338	-0.531
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%	92.54	8.64%	0.289	-0.464
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%	92.48	8.61%	0.232	-0.347
MINISTERIO DE HACIENDA COLONES															
G tp	G230310	23-Mar-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	7.36%	100.02	6.61%	-0.127	0.035
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%	100.59	5.13%	-1.291	0.043
G tp0	N070410	07-Abr-10	1	434,953,882.51	99.46	99.47	99.46	99.47	7.10%	09-Mar-10	0.00%	99.46	7.24%	0.540	0.070
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%	97.72	7.17%	0.378	0.303
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%	104.80	7.69%	-0.755	0.497
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%	108.18	8.46%	-1.448	0.836
G tp	G230311	23-Mar-11	2	44,724,777.78	98.40	98.40	98.40	98.40	8.64%	09-Mar-10	7.00%	98.32	8.73%	-0.285	0.945
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%	109.71	7.64%	-1.421	1.028
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%	110.70	8.14%	-1.183	1.223
G tp	G210911	21-Sep-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	13.71%	107.33	8.50%	-0.322	1.300
G tp	G280312	28-Mar-12	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	12.00%	103.85	9.87%	-0.710	1.705
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%	115.20	10.34%	-1.076	1.952
G tp	G240914	24-Sep-14	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	7.80%	89.06	10.92%	-0.001	3.522
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%	100.58	0.67%	-0.223	-0.283
BCCR c\$a10	CERTD\$-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%	109.49	2.64%	0.102	1.784
BCCR c\$b10	CERTD\$-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%	113.00	3.34%	0.459	2.542
MINISTERIO DE HACIENDA DOLARES															
G bde11	USP3699PAB33	01-Mar-11	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	9.00%	107.28	1.45%	-0.451	0.947
G bde12	USP3699PAC16	01-Feb-12	2	870,980.53	110.50	110.50	110.50	110.50	2.40%	09-Mar-10	8.11%	110.50	2.40%	-0.083	1.763
G bde13	USP3699PAE71	31-Ene-13	2	701,850.94	113.60	113.60	113.60	113.60	3.09%	09-Mar-10	8.05%	113.60	3.09%	0.253	2.594
G bde14	USP3699PEM51	20-Mar-14	2	278,386.15	108.71	108.71	108.70	108.70	3.52%	09-Mar-10	5.86%	108.71	4.18%	0.215	3.512
G bde20	USP3699PAA59	01-Ago-20	2	367,563.50	132.10	132.10	131.75	131.75	5.87%	09-Mar-10	10.00%	132.10	5.83%	1.100	6.942
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%	101.63	1.25%	-0.633	0.436
G tp\$	G\$241110	24-Nov-10	2	139,898.88	103.97	103.97	103.97	103.97	0.64%	09-Mar-10	6.29%	103.97	1.17%	-0.730	0.688
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%	106.31	1.77%	-0.425	0.922
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%	107.16	1.81%	-0.495	0.965
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%	108.35	1.97%	-0.168	1.400
G tp\$	G\$020512	02-May-12	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	5.29%	105.69	2.54%	-0.063	1.998
G tp\$	G\$270515	27-May-15	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	6.98%	112.99	4.75%	-0.012	4.321
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%	122.71	6.02%	1.057	6.950
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%	91.13	3.05%	0.477	5.951
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%	78.98	3.14%	-3.282	10.895
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%	104.17	2.05%	-0.138	0.733
FTCB bft13	B	09-Sep-13	4	101,793.40	110.62	110.62	110.62	110.62	5.63%	09-Mar-10	9.00%	110.62	5.63%	0.576	3.023
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%	110.06	6.07%	0.053	4.585
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%	108.98	6.85%	0.536	5.380
FTCB bft18	E	03-Oct-18	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	8.28%	109.19	6.85%	0.287	6.140
FTCB bft20	F	06-Ene-20	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	7.06%	101.95	6.78%	0.447	6.991
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%	108.40	4.63%	0.084	3.275
ICE ice 14	XS0185150165	03-Feb-14	2	106,162.92	105.50	105.50	105.50	105.50	4.38%	09-Mar-10	5.93%	105.50	4.88%	0.000	3.453
FIDEICOMISO DE TITULARIZACION PT GARABITO DOLARES															
FPTG bpgc\$	Serie C	18-Sep-17	4	47,541.56	116.69	116.69	116.69	116.69	6.66%	09-Mar-10	9.50%	116.01	6.77%	1.171	5.440
FPTG bpgc\$	Serie D	18-Dic-19	4	47,131.73	115.67	115.67	115.67	115.67	7.10%	09-Mar-10	9.48%	115.33	7.27%	0.782	6.510
FPTG bpgc\$	Serie E	17-Jun-22	4	2,365.42	116.00	116.00	116.00	116.00	7.81%	09-Mar-10	9.85%	117.04	7.70%	0.640	7.338