

REPORTE RENTA FIJA

Fecha: 23 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	2,129,443,986.10	98.74	98.81	98.74	98.81	39.41%	25-Mar-10	0.00%	99.27	7.56%	-0.190	0.022
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%	105.75	7.11%	0.218	0.454
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.	23-Dic-08	6.48%	97.84	8.58%	1.920	0.940
BCCR bem	BCCR280911	28-Sep-11	2	111,569,277.78	107.75	107.75	107.75	107.75	8.44%	25-Mar-10	14.03%	107.91	8.53%	12.683	1.273
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.	24-Jun-09	7.30%	94.17	9.85%	-3.443	2.207
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.	09-Mar-10	7.06%	92.21	9.85%	-15.618	2.777
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.	25-Ene-10	7.47%	87.67	10.88%	-6.537	3.649
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.	23-Dic-08	10.12%	94.62	8.52%	2.400	-0.258
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.	05-Ene-10	11.04%	94.58	8.41%	7.272	-0.686
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.	25-Ene-10	10.81%	94.53	8.44%	0.053	-0.492
BCCR bemv	BCCR050917AC	05-Sep-17	2	425,593,200.84	94.62	94.62	94.62	94.62	12.16%	25-Mar-10	11.04%	94.39	8.39%	-0.271	-0.556
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.	02-Nov-09	11.04%	92.97	8.45%	-1.559	-0.575
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%	92.53	8.41%	-1.542	-0.508
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.	n.d.	10.58%	92.36	8.39%	-0.673	-0.392
MINISTERIO DE HACIENDA COLONES															
G tp	G230310	23-Mar-10	2	10,215,577.78	100.05	100.05	100.05	100.05	#¡NUM!	25-Mar-10	7.36%	100.00	7.25%	7.518	#¡NUM!
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.	00-Ene-00	18.76%	100.83	5.87%	100.829	#¡NUM!
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.	09-Mar-10	16.75%	104.99	7.68%	4.967	0.454
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.	18-Jun-08	18.00%	108.53	8.30%	7.937	0.794
G tp	G230311	23-Mar-11	2	699,409,444.44	97.66	98.25	97.66	98.25	8.88%	25-Mar-10	7.00%	98.40	8.61%	-1.060	0.933
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.	23-Dic-08	16.50%	109.98	7.57%	12.258	0.986
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.	04-Feb-10	16.50%	110.90	8.11%	6.102	1.180
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.	22-Dic-08	13.71%	107.41	8.50%	-0.766	1.338
G tp	G280312	28-Mar-12	2	1,200,551,666.67	104.45	104.45	104.29	104.30	9.59%	25-Mar-10	12.00%	103.84	9.89%	5.521	1.666
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.	n.d.	17.30%	115.29	10.35%	5.576	2.053
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.	n.d.	7.80%	89.18	10.87%	-21.514	3.634
BANCO CENTRAL DE COSTA RICA DOLARES															
BCCR c\$V10	BCCR\$V270510	27-May-10	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	5.08%	100.63	0.68%	-3.212	-0.328
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.	17-Jun-09	7.13%	109.70	2.58%	-5.497	1.740
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.	09-Mar-10	7.54%	112.83	3.43%	23.768	2.497
MINISTERIO DE HACIENDA DOLARES															
G bde11	USP3699PAB33	01-Mar-11	2	257,989.25	107.60	107.60	107.60	107.60	0.79%	25-Mar-10	9.00%	107.50	1.40%	6.923	0.906
G bde12	USP3699PAC16	01-Feb-12	2	3,019,766.34	110.48	110.80	110.48	110.80	2.12%	25-Mar-10	8.11%	110.80	2.31%	1.312	1.722
G bde13	USP3699PAE71	31-Ene-13	2	1,159.88	112.50	112.50	112.50	112.50	3.40%	25-Mar-10	8.05%	113.30	3.22%	0.303	2.545
G bde14	USP3699PEM51	20-Mar-14	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	00-Ene-00	5.86%	108.72	4.18%	108.720	3.546
G bde20	USP3699PAA59	01-Ago-20	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	10.00%	131.50	5.90%	24.221	6.894
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.	24-Mar-10	4.60%	101.72	1.25%	-8.783	0.392
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.	24-Mar-10	6.29%	104.08	1.19%	-9.520	0.642
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.	24-Mar-10	8.50%	106.50	1.73%	-2.207	0.878
G tp\$	E032001	08-Mar-11	2	127,058.96	107.50	107.50	107.50	107.50	1.15%	25-Mar-10	9.11%	107.46	1.68%	-24.638	0.924
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-Feb-10	7.75%	108.59	1.89%	6.957	1.357
G tp\$	G\$020512	02-May-12	2	637,642.66	105.00	105.40	105.00	105.40	2.63%	25-Mar-10	5.29%	105.74	2.55%	1.771	1.953
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.	11-Jun-09	6.98%	112.99	4.76%	6.680	4.277
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.	07-Ene-10	9.00%	122.15	6.09%	14.991	7.024
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.	09-Mar-10	1.50%	91.10	3.05%	-14.597	5.907
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.	09-Mar-10	1.00%	82.14	2.78%	-30.848	10.890
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.	00-Ene-00	7.56%	104.18	2.18%	104.182	0.702
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.	25-Jun-09	9.00%	110.17	5.78%	19.035	2.977
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.	13-Feb-09	8.14%	109.96	6.09%	30.978	4.624
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.	00-Ene-00	8.45%	108.81	6.88%	108.808	5.334
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.	25-Ene-10	8.28%	109.38	6.83%	5.214	6.099
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.	24-Mar-10	7.06%	101.50	6.85%	-9.120	6.939
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.	21-Dic-09	6.53%	108.39	4.65%	-0.585	3.231
ICE ice 14	XS0185150165	03-Feb-14	2	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	09-Mar-10	5.93%	105.20	4.97%	-3.987	3.395
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.	00-Ene-00	9.50%	115.60	6.84%	115.603	5.494
FPTG bpgc\$	Serie D	18-Dic-19	4	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	n.s.n.	04-Feb-10	9.48%	114.70	7.36%	6.296	6.565
FPTG bpgc\$	Serie E	17-Jun-22	4	90,549.69	114.10	114.10	114.10	114.10	8.03%	25-Mar-10	9.85%	116.70	7.74%	11.196	7.406