

Reporte de deuda BCCR 13 de setiembre de 2023

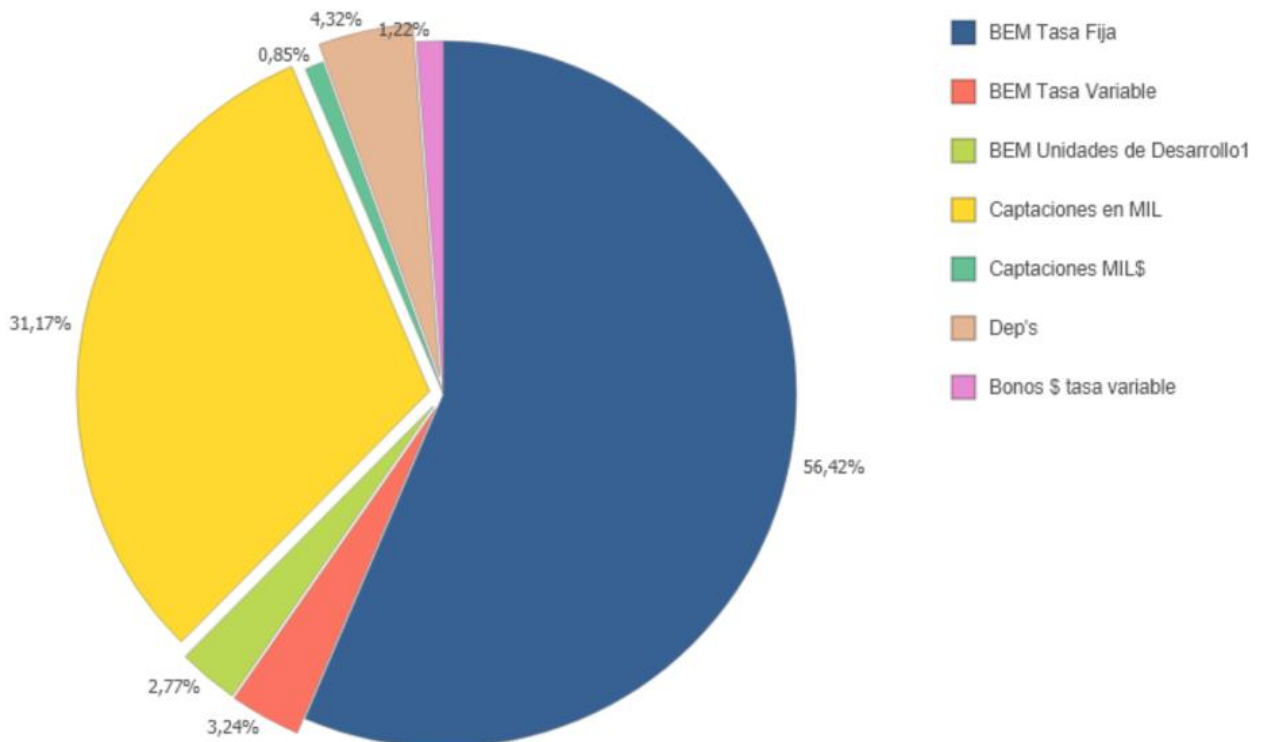
Montos en Colones

Informe Semanal de Deuda - Montos en Colones

| Distribución por tipo de instrumento | | |
|---|---------------------------|----------------|
| | Monto | Porcentaje |
| BEM Tasa Fija | ₡1.553.863.650.000 | 56,42% |
| BEM Tasa Variable | ₡89.333.700.000 | 3,24% |
| BEM Cero Cupón | ₡0 | 0,00% |
| BEM Unidades de Desarrollo ¹ | ₡76.191.461.141 | 2,77% |
| Captaciones en MIL | ₡858.520.000.000 | 31,17% |
| Dep's | ₡119.093.051.662 | 4,32% |
| Bonos en dólares tasa fija | ₡0 | 0,00% |
| Bonos en dólares tasa variable | ₡33.733.402.110 | 1,22% |
| Bonos en dólares cero cupón | ₡0 | 0,00% |
| Captaciones en MIL dólares | ₡23.296.033.000 | 0,85% |
| Total | ₡2.754.031.297.913 | 100,00% |

1 Valor de la unidad de desarrollo al día del informe ¢ 1.012,99
 Monto de los BEM expresados en valor facial

Tipo de cambio de monex por dólar al día del informe = ¢ 533.09



Resultado del último evento de programa de corto 11 de setiembre de 2023

Recibido

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (colones) | Valor transado (colones) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|------------|--------------------------|--------------------------|---------|---------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| 90 | BCPF131223 | 12.837.100.000,00 | 12.848.306.730,00 | 100,07% | 100,26% | 4,47% | 5,17% | 5,24% |
| 180 | BCPF130324 | 21.298.300.000,00 | 21.321.170.160,00 | 99,94% | 100,40% | 4,71% | 5,31% | 5,65% |
| TOTAL | | 34.135.400.000,00 | 34.169.476.890,00 | | | | | |

Asignado

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (colones) | Valor transado (colones) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|------------|--------------------------|--------------------------|---------|---------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| 90 | BCPF131223 | 10.000.000.000,00 | 10.007.000.000,00 | 100,07% | 100,07% | 5,24% | 5,24% | 5,24% |
| 180 | BCPF130324 | 10.000.000.000,00 | 10.010.000.000,00 | 100,10% | 100,10% | 5,32% | 5,32% | 5,32% |
| TOTAL | | 20.000.000.000,00 | 20.017.000.000,00 | | | | | |

Resultado del último evento de mediano plazo 28 de agosto de 2023

Recibido

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (colones) | Valor transado (colones) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|--------------|---------------------------|---------------------------|---------|---------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| 772 | BCFIJA221025 | 115.522.000.000,00 | 126.359.567.711,08 | 105,60% | 106,89% | 5,88% | 6,28% | 6,50% |
| TOTAL | | 115.522.000.000,00 | 126.359.567.711,08 | | | | | |

Asignado

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (colones) | Valor transado (colones) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|--------------|---------------------------|---------------------------|---------|---------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| 772 | BCFIJA221025 | 100.000.000.000,00 | 109.024.444.444,41 | 105,70% | 105,70% | 6,45% | 6,45% | 6,45% |
| TOTAL | | 100.000.000.000,00 | 109.024.444.444,41 | | | | | |

Resultado del último evento en dólares 19 de diciembre de 2022

Dólares

Recibido

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (dólares) | Valor transado (dólares) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|---------------|-------------------------|--------------------------|--------|--------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| 870 | BCVAR\$210525 | 55.000,00 | 54.170,83 | 98,00% | 98,00% | 6,82% | 6,82% | 6,82% |
| Total | | 55.000,00 | 54.170,83 | | | | | |

No se recibieron ofertas en dólares en la serie BCVAR\$260527

Asignado

| Días al vencimiento | Serie | Monto nominal (dólares) | Valor transado (dólares) | Precio | | Tasas de interés | | |
|---------------------|-------|-------------------------|--------------------------|--------|--------|------------------|--------------------|--------|
| | | | | Mínimo | Máximo | Mínimo | Promedio ponderado | Máximo |
| n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. |

No se asignaron ofertas en dólares.

Detalle de deuda BCCR

| Número de Emisión en Serie | Código ISIN | Nemotécnico | Fecha de vencimiento | Moneda | Fecha de Emisión | Monto Emisión | Monto Emitido | Saldo de la serie | Periodicidad | Tasa de Interés bruta | Plazo |
|----------------------------|--------------|-------------|----------------------|------------------------|------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------|----------------------------------|-----------|
| BCPF181023 | CRBCCR0B5236 | BEMS15 | 18/10/2023 | Colones | 18/07/2023 | 5.000.000.000,00 | 4.025.250.000,00 | 974.750.000,00 | Trimestral | 7,00% | 0,3 años |
| BCFJA251023 | CRBCCR0B5145 | BEMS15 | 25/10/2023 | Colones | 25/04/2021 | 400.000.000.000,00 | 269.609.150.000,00 | 130.388.850.000,00 | Semestral | 6,00% | 2,5 años |
| BCPF011123 | CRBCCR0B5251 | BEMS15 | 01/11/2023 | Colones | 01/08/2023 | 5.000.000.000,00 | 490.000.000,00 | 4.510.000.000,00 | Trimestral | 7,00% | 0,3 años |
| BCPF151123 | CRBCCR0C5284 | BEMS15 | 15/11/2023 | Colones | 15/08/2023 | 20.000.000.000,00 | 20.000.000.000,00 | 0,00 | Trimestral | 6,50% | 0,3 años |
| BCPF061223 | CRBCCR0C5326 | BEMS15 | 06/12/2023 | Colones | 06/09/2023 | 10.000.000.000,00 | 10.000.000.000,00 | 0,00 | Trimestral | 6,50% | 0,3 años |
| BCPF131223 | CRBCCR0C5342 | BEMS15 | 13/12/2023 | Colones | 13/09/2023 | 10.000.000.000,00 | 10.000.000.000,00 | 0,00 | Trimestral | 6,50% | 0,3 años |
| BCPF170124 | CRBCCR0B5269 | BEMS15 | 17/01/2024 | Colones | 17/07/2023 | 10.000.000.000,00 | 5.000.000.000,00 | 5.000.000.000,00 | Trimestral | 7,00% | 0,5 años |
| BCPF240124 | CRBCCR0B5244 | BEMS15 | 24/01/2024 | Colones | 24/07/2023 | 10.000.000.000,00 | 400.000.000,00 | 9.600.000.000,00 | Trimestral | 7,00% | 0,5 años |
| BCPF140224 | CRBCCR0C5276 | BEMS15 | 14/02/2024 | Colones | 14/08/2023 | 30.000.000.000,00 | 20.000.000.000,00 | 10.000.000.000,00 | Trimestral | 6,50% | 0,5 años |
| BCFJA140224 | CRBCCR0B4569 | BEMSM | 14/02/2024 | Colones | 14/02/2014 | 24.632.200.000,00 | 24.632.200.000,00 | 0,00 | Semestral | 9,22% | 10,0 años |
| BCPF060324 | CRBCCR0C5318 | BEMS15 | 06/03/2024 | Colones | 06/09/2023 | 10.000.000.000,00 | 10.000.000.000,00 | 0,00 | Trimestral | 6,50% | 0,5 años |
| BCPF130324 | CRBCCR0C5334 | BEMS15 | 13/03/2024 | Colones | 13/09/2023 | 10.000.000.000,00 | 10.000.000.000,00 | 0,00 | Trimestral | 6,50% | 0,5 años |
| BCREAL100424 | CRBCCR0B4056 | BEMUD | 10/04/2024 | Unidades de Desarrollo | 10/04/2009 | 30.156.500,00 | 30.156.500,00 | 0,00 | Semestral | 4,00% | 15,0 años |
| BCFJA030724 | CRBCCR0B5152 | BEMS15 | 03/07/2024 | Colones | 03/01/2022 | 400.000.000.000,00 | 167.186.750.000,00 | 232.813.250.000,00 | Semestral | 5,00% | 2,5 años |
| BCFJA231024 | CRBCCR0B5160 | BEMS15 | 23/10/2024 | Colones | 23/04/2022 | 400.000.000.000,00 | 213.526.050.000,00 | 186.473.950.000,00 | Semestral | 5,50% | 2,5 años |
| BCFJA120325 | CRBCCR0B4338 | BEMSM | 12/03/2025 | Colones | 12/03/2013 | 94.690.400.000,00 | 94.547.400.000,00 | 0,00 | Semestral | 10,90% | 12,0 años |
| BCFJA230425 | CRBCCR0B5228 | BEMS15 | 23/04/2025 | Colones | 23/10/2022 | 400.000.000.000,00 | 376.336.250.000,00 | 23.663.750.000,00 | Semestral | 11,00% | 2,5 años |
| BCVAR\$210525 | CRBCCR0B5186 | BCVAR\$ | 21/05/2025 | Dólares | 21/05/2022 | 500.000.000,00 | 59.657.000,00 | 440.343.000,00 | Semestral | Flotante definida según nota 1y2 | 3,0 años |
| BCFJA221025 | CRBCCR0B5210 | BEMS15 | 22/10/2025 | Colones | 22/04/2023 | 400.000.000.000,00 | 200.000.000.000,00 | 200.000.000.000,00 | Semestral | 11,00% | 2,5 años |
| BCFJA110326 | CRBCCR0B4726 | BEMSM | 11/03/2026 | Colones | 11/03/2011 | 28.144.550.000,00 | 28.002.550.000,00 | 0,00 | Semestral | 11,90% | 15,0 años |
| BCREAL140427 | CRBCCR0B4031 | BEMUD | 14/04/2027 | Unidades de Desarrollo | 14/04/2012 | 45.058.000,00 | 45.058.000,00 | 0,00 | Semestral | 4,00% | 15,0 años |
| BCVAR\$260527 | CRBCCR0B5194 | BCVAR\$ | 26/05/2027 | Dólares | 26/05/2022 | 500.000.000,00 | 3.622.000,00 | 496.378.000,00 | Semestral | Flotante definida según nota 1y2 | 5,0 años |
| BCFJA080328 | CRBCCR0B4346 | BEMSM | 08/03/2028 | Colones | 08/03/2013 | 33.215.050.000,00 | 33.215.050.000,00 | 0,00 | Semestral | 11,00% | 15,0 años |
| BCFJA120331 | CRBCCR0B4577 | BEMSM | 12/03/2031 | Colones | 12/03/2011 | 28.900.600.000,00 | 24.369.000.000,00 | 0,00 | Semestral | 12,32% | 20,0 años |
| BCVAR160731 | CRBCCR0B4429 | BEMV | 16/07/2031 | Colones | 16/07/2011 | 89.333.700.000,00 | 89.333.700.000,00 | 0,00 | Semestral | Tasa Básica + 2% | 20,0 años |
| BCFJA080334 | CRBCCR0B4585 | BEMSM | 08/03/2034 | Colones | 08/03/2014 | 32.524.000.000,00 | 32.524.000.000,00 | 0,00 | Semestral | 12,48% | 20,0 años |

Nota: El saldo de cada serie excluye las compras realizadas en mercado secundario por parte de BCCR.

1/ La tasa flotante de la serie **BCVAR\$210525** será definida con base en un indicador de una tasa observada en el mercado, específicamente la tasa *bid* (la tasa bruta a la que los compradores puede adquirir dicho instrumento) de cierre del día del Treasury Bill (letra del Tesoro de 6 meses), consultado en Bloomberg bajo el identificados GB6 Govt y fuente BGN, vigente dos días antes del inicio de cada periodo de pago de intereses más un diferencial de 1,31%, dividido entre la siguiente expresión: uno menos 15%.

2/ La tasa flotante de la serie **BCVAR\$260527** será definida con base en un indicador de una tasa observada en el mercado, específicamente la tasa *bid* (la tasa bruta a la que los compradores puede adquirir dicho instrumento) de cierre del día del Treasury Bill (letra del Tesoro de 6 meses), consultado en Bloomberg bajo el identificados GB6 Govt y fuente BGN, vigente dos días antes del inicio de cada periodo de pago de intereses más un diferencial de 1,51%, dividido entre la siguiente expresión: uno menos 15%.