

مرکز مدیریت بدهی ها و دارایی های مالی عمومی  
گزارش بازدهی اسناد خزانه اسلامی در تابلوی معاملاتی فرابورس ایران  
(چهارشنبه مورخ ۱۳۹۷/۱۰/۲۶)

ردیف	وضعیت	بند قانونی	نماد معاملاتی	تاریخ انتشار	تاریخ سرسید	زمان تا سرسید (از تاریخ انتشار)	زمان تا سرسید (از تاریخ ۱۳۹۷/۱۰/۲۶)	مبلغ انتشار (میلیون ریال)	قیمت پایانی (ریال)	معادل بازده سالانه (ساده - ۳۶۵ روز)
۱	فعال	بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۰۴	۱۳۹۶/۰۷/۲۰	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۲۵ ماه	روز ۲۹۹	۱۹,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۷,۴۴۹	۲۰.۳٪
۲			اخزا ۶۰۶	۱۳۹۶/۰۷/۲۲	۱۳۹۸/۰۷/۲۲	۲۴ ماه	روز ۲۷۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۹,۵۰۱	۲۰.۲٪
۳			اخزا ۶۰۸	۱۳۹۶/۰۸/۱۱	۱۳۹۸/۰۴/۱۱	۲۰ ماه	روز ۱۶۷	۱۶,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۶,۸۸۷	۱۹.۸٪
۴			اخزا ۶۰۹	۱۳۹۶/۰۸/۱۱	۱۳۹۸/۰۴/۱۱	۲۰ ماه	روز ۱۶۷	۸,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۶,۹۵۱	۱۹.۸٪
۵			اخزا ۶۱۰	۱۳۹۶/۰۸/۱۱	۱۳۹۸/۰۹/۱۱	۲۵ ماه	روز ۲۲۰	۱۷,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۷,۰۶۰	۲۰.۶٪
۶			اخزا ۶۱۲	۱۳۹۶/۰۸/۱۴	۱۳۹۸/۱۱/۱۴	۲۷ ماه	روز ۳۸۳	۱۸,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۱,۴۲۲	۲۰.۷٪
۷			اخزا ۶۱۳	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۲۶ ماه	روز ۳۵۵	۱۷,۶۲۵,۹۷۰	۸۳۱,۰۰۵	۲۰.۹٪
۸			اخزا ۶۱۴	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۲۶ ماه	روز ۳۵۵	۱۰,۳۷۴,۰۳۰	۸۳۱,۲۰۵	۲۰.۹٪
۹			اخزا ۶۱۵	۱۳۹۶/۰۸/۲۰	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۲۴ ماه	روز ۲۹۹	۷,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۷,۴۹۶	۲۰.۳٪
۱۰		اخزا ۶۲۲	۱۳۹۶/۱۲/۲۳	۱۳۹۸/۰۵/۲۳	۱۷ ماه	روز ۲۱۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۹۷,۵۷۴	۱۹.۸٪	
۱۱		اخزا ۶۲۳	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۵/۲۸	۲۹ ماه	روز ۵۸۰	۱۵,۲۴۶,۴۳۳	۷۳۱,۴۲۴	۲۳.۱٪	
۱۲		اخزا ۶۲۴	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۶/۲۵	۳۰ ماه	روز ۶۰۸	۱۲,۷۵۳,۵۶۷	۷۲۱,۰۹۵	۲۳.۲٪	
۱۴		بند (ب) و (هـ) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۳	۱۳۹۷/۰۳/۲۱	۱۳۹۹/۰۷/۲۱	۲۸ ماه	روز ۶۳۵	۴۰,۳۹۳,۱۲۸	۷۱۰,۷۰۴	۲۳.۴٪
۱۵			اخزا ۷۰۴	۱۳۹۷/۰۳/۲۲	۱۳۹۹/۱۰/۲۲	۳۱ ماه	روز ۷۲۶	۲۴,۴۴۱,۴۶۶	۶۷۹,۰۴۶	۲۳.۸٪
۱۶		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۵	۱۳۹۷/۰۳/۲۳	۱۳۹۸/۰۵/۲۳	۱۴ ماه	روز ۲۱۰	۱۴,۳۶۰,۰۰۰	۸۹۶,۹۹۵	۲۰.۰٪
۱۷		بند (ب) و (هـ) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۶	۱۳۹۷/۰۳/۲۳	۱۳۹۹/۰۴/۲۳	۲۵ ماه	روز ۵۴۴	۲۷,۸۶۸,۱۳۷	۷۴۲,۷۳۷	۲۳.۰۲٪
۱۸			اخزا ۷۰۷	۱۳۹۷/۰۳/۲۷	۱۳۹۸/۰۶/۲۷	۱۵ ماه	روز ۴۵	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۷۸,۰۵۴	۲۰.۷٪
۱۹		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۸	۱۳۹۷/۰۴/۲۳	۱۳۹۸/۰۷/۲۳	۱۵ ماه	روز ۲۷۲	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۷,۹۶۲	۲۰.۴٪
۲۰			اخزا ۷۰۹	۱۳۹۷/۰۵/۱۳	۱۳۹۹/۰۵/۱۳	۲۴ ماه	روز ۱۶۵	۲۳,۰۰۰,۰۰۰	۳۳۶,۹۲۳	۲۳.۱٪
۲۱		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۱	۱۳۹۷/۰۵/۳۰	۱۳۹۸/۰۴/۳۰	۱۱ ماه	روز ۱۸۶	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۸۵,۰۰۰	۲۵.۵٪
۲۲			اخزا ۷۱۲	۱۳۹۷/۰۵/۳۰	۱۳۹۸/۰۵/۳۰	۱۲ ماه	روز ۲۱۷	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۹۳,۹۰۶	۲۰.۰٪
۲۳			اخزا ۷۱۴	۱۳۹۷/۰۷/۲۲	۱۳۹۸/۰۷/۲۲	۱۲ ماه	روز ۲۷۱	۶,۰۳۰,۴۰۰	۸۶۷,۹۱۱	۲۰.۶٪
۲۴			سخاب ۷	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۷/۱۲/۲۸	۲۴ ماه	روز ۶۲	۳۵,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۷,۱۶۱	۲۰.۰٪
جمع اسناد خزانه اسلامی فعال در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۳۹۲,۰۹۳,۱۳۱										
۲۴	غیر فعال	بند (و) تبصره (۱۶) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵	۱۳۹۸/۱۱/۱۵	۲۴ ماه	روز ۳۸۴	۲,۶۲۰,۰۰۰	-	-
۲۵		بند (م) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۰	۱۳۹۷/۰۵/۲۷	۱۳۹۸/۰۳/۲۷	۱۰ ماه	روز ۱۵۲	۳,۳۱۴,۱۲۹	-	-
۲۶		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۳	۱۳۹۷/۰۷/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	۳۴ ماه	روز ۹۳۶	۱۷,۶۶۳,۲۶۳	-	-
۲۸		بند (م) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۵	۱۳۹۷/۰۷/۲۴	۱۴۰۰/۰۳/۲۴	۳۲ ماه	روز ۸۸۰	۵,۵۸۰,۹۰۲	-	-
۲۹		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۶	۱۳۹۷/۰۹/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	۳۱ ماه	روز ۸۹۴	۱۰,۶۷۹,۱۶۹	-	-
۳۰		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۷	۱۳۹۷/۰۹/۱۷	۱۳۹۸/۱۰/۱۷	۱۳ ماه	روز ۳۵۶	۲۰۰,۰۰۰	-	-
جمع اسناد خزانه اسلامی غیر فعال در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۴۰,۳۲۷,۴۶۳										
<b>۴۳۲,۴۲۰,۵۹۴</b>										

\* اسناد خزانه اسلامی فاقد کوپن بوده و در سررسید معادل قیمت اسمی (یک میلیون ریال) هر ورقه به حساب آخرین دارنده واریز می‌شود.  
 \*\* ضمناً اسناد مذکور با درخواست دستگاه‌های اجرایی دارای سهمیه عنوان اشخاص ذینفع معادل اصل مبلغ بدهی و حفظ قدرت خرید محاسبه شده صادر می‌شود. شایان ذکر است در سال ۱۳۹۶ حفظ قدرت خرید معادل مبلغی حداکثر تا هشت درصد (۸٪) به ازای هر سال تأخیر در پرداخت طلب طلبکاران از زمان صدور جواله/تسجیل بدهی تا زمان سررسید اسناد خزانه اسلامی محاسبه به مبلغ بدهی مسجل اضافه می‌شد و در سال ۱۳۹۷ حفظ قدرت خرید مبلغی معادل پانزده درصد (۱۵٪) است که به ازای هر سال تأخیر در پرداخت طلب طلبکاران تا زمان سررسید اسناد خزانه اسلامی به مبلغ بدهی مسجل اضافه می‌شود.  
 \*\*\* مبلغ اصل بدهی‌های سررسید نشده اوراق بهادار اسلامی دولت تا این تاریخ ۶۶۸۶۸۲ میلیارد ریال بوده و میانگین موزون زمان تا سررسید (ATM) این اوراق ۱.۵۴ سال است.