

مرکز مدیریت بدهی‌ها و دارایی‌های مالی عمومی
گزارش بازدهی اسناد خزانه اسلامی در تابلوی معاملاتی فرابورس ایران
(۴شنبه مورخ ۱۳۹۸/۰۷/۱۰)

ردیف	وضعیت	بند قانونی	نماد معاملاتی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	زمان تا سررسید (از تاریخ ۹۸/۰۷/۱۰)	مبلغ انتشار (میلیون ریال)	قیمت باستانی (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	۴۰ روز	۱۹,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۹,۸۰۱	۱۸.۸٪
۲		بند (و) تبصره (۱۶) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۰۶	۱۳۹۶/۰۷/۲۲	۱۳۹۸/۰۷/۲۲	۱۲ روز	۱,۰۰۰,۰۰۰	۹۹۴,۳۳۹	۱۷.۳٪
۳			اخزا ۶۱۰	۱۳۹۶/۰۸/۱۱	۱۳۹۸/۰۹/۱۱	۶۱ روز	۱۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۹,۱۷۵	۱۹.۰٪
۴			اخزا ۶۱۲	۱۳۹۶/۰۸/۱۴	۱۳۹۸/۱۱/۱۴	۱۲۴ روز	۱۸,۰۰۰,۰۰۰	۹۳۹,۶۸۴	۱۸.۹٪
۵			اخزا ۶۱۳	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۹۶ روز	۱۷,۶۲۵,۹۷۰	۹۵۱,۱۶۹	۱۹.۵٪
۶			اخزا ۶۱۴	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۹۶ روز	۱۰,۳۷۴,۰۳۰	۹۵۱,۱۸۵	۱۹.۵٪
۷			اخزا ۶۱۵	۱۳۹۶/۰۸/۲۰	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۴۰ روز	۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۹,۲۰۱	۱۹.۴٪
۸	بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۶		اخزا ۶۲۳	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۵/۲۸	۳۲۱ روز	۱۵,۲۴۶,۴۳۳	۸۵۱,۲۰۳	۱۹.۹٪
۹		اخزا ۶۲۴	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۶/۲۵	۳۴۹ روز	۱۲,۷۵۳,۵۶۷	۸۳۸,۹۵۳	۲۰.۱٪	
۱۰	بند (ب) و (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۳	۱۳۹۷/۰۲/۲۱	۱۳۹۹/۰۷/۲۱	۳۷۶ روز	۴۰,۳۶۹,۱۲۸	۸۲۷,۰۱۹	۲۰.۳٪	
۱۱		اخزا ۷۰۴	۱۳۹۷/۰۲/۲۲	۱۳۹۹/۱۰/۲۲	۶۶۷ روز	۲۴,۴۴۱,۴۶۶	۷۸۷,۱۰۹	۲۱.۱٪	
۱۲	بند (ب) و (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۶	۱۳۹۷/۰۲/۲۳	۱۳۹۹/۰۴/۲۳	۲۸۵ روز	۲۷,۷۸۸,۱۳۷	۸۶۵,۹۵۸	۱۹.۸٪	
۱۳		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۸	۱۳۹۷/۰۲/۲۳	۱۳۹۸/۰۲/۲۳	۱۳ روز	۱,۰۰۰,۰۰۰	۹۹۵,۰۰۰	۱۴.۱٪
۱۴	در تابلو معاملات فرابورس ایران	بند (د) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۹	۱۳۹۷/۰۵/۱۳	۱۳۹۹/۰۵/۱۳	۳۰۶ روز	۲۳,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۷,۹۲۴	۱۹.۸٪
۱۵		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۳	۱۳۹۷/۰۷/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	۶۷۷ روز	۱۴,۲۹۱,۳۰۸	۶۹۲,۹۵۴	۲۳.۹٪
۱۶	بند (د) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۴	۱۳۹۷/۰۷/۲۲	۱۳۹۸/۰۷/۲۲	۱۲ روز	۶,۰۳۰,۴۰۰	۹۹۴,۳۴۹	۱۷.۳٪	
۱۷		بند (م) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۵	۱۳۹۷/۰۷/۲۴	۱۳۹۹/۰۲/۲۴	۲۲۴ روز	۵,۸۵۰,۰۰۲	۸۹۲,۲۸۱	۱۹.۵٪
۱۸	بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۶	۱۳۹۷/۰۹/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	۳۳۵ روز	۱۰,۱۳۹,۱۶۹	۷۰۷,۴۲۹	۲۳.۸٪	
۱۹		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۷	۱۳۹۷/۰۹/۱۷	۱۳۹۸/۱۰/۱۷	۹۷ روز	۲,۸۶۴,۱۵۴	۹۵۰,۲۰۱	۱۹.۷٪
۲۰	بند (د) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۸	۱۳۹۷/۱۱/۲۵	۱۴۰۰/۰۵/۲۵	۶۸۴ روز	۲۴,۵۹۸,۹۱۸	۶۹۱,۲۷۵	۲۳.۸٪	
۲۱		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۹	۱۳۹۸/۰۸/۲۷	۱۳۹۷/۱۱/۲۷	۴۷ روز	۷,۳۱۱,۹۵۵	۹۷۵,۶۵۱	۱۹.۴٪
۲۲	بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۲۰	۱۳۹۷/۱۱/۲۴	۱۴۰۰/۰۳/۲۴	۶۲۱ روز	۹,۸۳۲,۷۵۱	۷۱۴,۲۰۰	۲۳.۵٪	
۲۳		بند (ب) و (م) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۲۱	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۷/۲۸	۷۴۹ روز	۳۹,۸۹۱,۹۹۱	۶۶۵,۲۰۹	۲۴.۵٪
۲۴	بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۲۲	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	۶۵۵ روز	۲۰,۱۵۱,۵۲۵	۷۰۱,۴۶۶	۲۳.۷٪	
۲۵		اخزا ۷۲۳	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۸/۲۴	۲۷۵ روز	۴۰,۹۴۰,۶۵۸	۶۵۷,۲۲۹	۲۴.۶٪	
۲۶	بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۲	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	۴۲ روز	۲,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۷,۲۳۷	۲۰.۸٪	
۲۷		بند (د) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۱	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۱۳	۸۲۴ روز	۳,۰۰۰,۰۰۰	۶۳۴,۱۱۲	۲۵.۶٪
<p>جمع اسناد خزانه اسلامی فعال در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۴۱۳,۶۶۵,۸۶۲ میانگین نرخ اسناد خزانه اسلامی: ۲۲.۷٪</p>									
۲۸	غیر فعال	بند (و) تبصره (۱۶) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵	۱۳۹۸/۱۱/۱۵	۱۲۵ روز	۲,۶۲۰,۰۰۰	-	-
۲۹		بند (ف) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۱	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۴/۲۳	۲۸۵ روز	۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۰		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۳	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۵/۲۱	۳۱۴ روز	۱,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۱			اخزا ۸۰۴	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۴/۲۱	۶۴۹ روز	۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۲			اخزا ۸۰۵	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۴/۲۲	۶۵۰ روز	۲,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۳		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۶	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۹	۶۷۸ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۴			اخزا ۸۰۷	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	۷۴۰ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۵	اخزا ۸۰۸		۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۸/۱۷	۷۶۸ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۶	اخزا ۸۰۹		۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۹/۲۳	۸۰۴ روز	۲۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۷	اخزا ۸۱۰		۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۰۶	۸۱۷ روز	۱,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۸	بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۲	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۱/۱۱	۸۵۲ روز	۴,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۹		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۳	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۱/۰۲/۱۹	۹۵۰ روز	۱,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۴۰	بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۴	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۹۸۰ روز	۳,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۴۱		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۵	۱۳۹۸/۰۴/۰۶	۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۹۹۹ روز	۴,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۴۲	اخزا ۸۱۶		۱۳۹۸/۰۵/۰۳	۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۱۰۲۷ روز	۲,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
<p>جمع اسناد خزانه اسلامی غیر فعال در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۲۶۲,۶۲۰,۰۰۰</p>									
<p>۶۷۶,۲۸۵,۸۶۲</p>									

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 **لذعان صدور حواله تسخیل 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 ۸۵۷,۱۳۸ میلیارد ریال بوده و میانگین موزون زمان تا سررسید (ATM) این اوراق ۱.۲۹ سال است.