

مرکز مدیریت بدهی‌ها و دارایی‌های مالی عمومی  
گزارش بازدهی اسناد خزانه اسلامی در تابلوی معاملاتی فرابورس ایران  
(شنبه مورخ ۱۳۹۸/۰۷/۲۰)

ردیف	وضعیت	بند قانونی	نماد معاملاتی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	زمان تا سررسید (از تاریخ ۱۳۹۸/۰۷/۲۰)	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	۳۰ روز	۱۹,۰۰۰,۰۰۰	۹۸۴,۲۵۱	۱۹.۵%	
۳			اخزا ۶۱۰	۱۳۹۶/۰۸/۱۱	۱۳۹۸/۰۹/۱۱	۵۱ روز	۱۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۳,۰۰۰	۱۹.۹%	
۴			اخزا ۶۱۲	۱۳۹۶/۰۸/۱۴	۱۳۹۸/۱۱/۱۴	۱۱۴ روز	۱۸,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۴,۴۰۰	۱۸.۸%	
۵			بند (و) تبصره (۱۶) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۱۳	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۸۶ روز	۱۷,۶۲۵,۹۷۰	۹۵۵,۸۷۴	۱۹.۶%
۶		اخزا ۶۱۴	۱۳۹۶/۰۸/۱۶	۱۳۹۸/۱۰/۱۶	۸۶ روز	۱۰,۳۷۴,۰۳۰	۹۵۶,۰۰۱	۱۹.۵%		
۷		اخزا ۶۱۵	۱۳۹۶/۰۸/۲۰	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۳۰ روز	۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۸۳,۹۰۰	۱۹.۹%		
۸		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۲۳	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۵/۲۸	۳۱۱ روز	۱۵,۲۴۶,۴۳۳	۸۵۶,۰۰۶	۱۹.۷%	
۹		اخزا ۶۲۴	۱۳۹۶/۱۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۶/۲۵	۳۳۹ روز	۱۲,۷۵۳,۵۶۷	۸۴۲,۹۳۶	۲۰.۱%		
۱۰		بند (ب) و (هـ) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۲	۱۳۹۷/۰۲/۲۱	۱۳۹۹/۰۷/۲۱	۳۶۶ روز	۴۰,۳۶۹,۱۲۸	۸۳۲,۱۶۲	۲۰.۰%	
۱۱			اخزا ۷۰۴	۱۳۹۷/۰۲/۲۲	۱۳۹۹/۱۰/۲۲	۴۵۷ روز	۲۴,۴۴۱,۴۶۶	۷۸۸,۳۹۱	۲۱.۴%	
۱۲		بند (ب) و (هـ) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۶	۱۳۹۷/۰۲/۲۳	۱۳۹۹/۰۴/۲۳	۲۷۵ روز	۲۷,۷۸۸,۱۳۷	۸۶۹,۴۳۱	۱۹.۹%	
۱۳		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۰۹	۱۳۹۷/۰۵/۱۳	۱۳۹۹/۰۵/۱۳	۲۹۶ روز	۲۳,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۲,۵۲۴	۱۹.۷%	
۱۴		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۳	۱۳۹۷/۰۹/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	۲۶۷ روز	۱۴,۲۹۱,۳۰۸	۸۳۲,۱۶۲	۲۰.۰%	
۱۵		در تابلو معاملات فرابورس ایران	بند (د) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۵	۱۳۹۷/۰۷/۲۴	۱۳۹۹/۰۲/۲۴	۲۱۴ روز	۵,۸۵۰,۹۰۲	۸۱۵,۸۱۷	۱۹.۸%
۱۶			بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۶	۱۳۹۷/۰۹/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	۲۱۵ روز	۱۰,۱۳۹,۱۶۹	۷۲۱,۷۹۶	۲۲.۵%
۱۷		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۷	۱۳۹۷/۰۹/۱۷	۱۳۹۸/۱۰/۱۷	۸۷ روز	۲,۸۶۴,۱۵۴	۹۵۵,۲۰۰	۱۹.۷%	
۱۸		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۸	۱۳۹۷/۱۱/۲۵	۱۴۰۰/۰۵/۲۵	۲۶۴ روز	۲۶,۵۹۸,۱۸۱	۷۰۲,۲۱۱	۲۰.۰%	
۱۹		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۱۹	۱۳۹۷/۱۱/۲۷	۱۳۹۸/۰۸/۲۷	۳۷ روز	۷,۳۳۱,۹۵۵	۹۸۰,۴۱۸	۱۹.۷%	
۲۰			اخزا ۷۲۰	۱۳۹۷/۱۱/۲۴	۱۴۰۰/۰۳/۲۴	۶۱۱ روز	۹,۸۳۲,۷۵۱	۷۲۷,۱۴۳	۲۲.۴%	
۲۱		بند (ب) و (م) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۲۱	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۷/۲۸	۷۳۹ روز	۳۹,۸۹۱,۵۹۱	۶۷۸,۳۲۰	۲۳.۴%	
۲۲		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۷	اخزا ۷۲۲	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	۲۰۰ روز	۲۰,۱۵۱,۵۲۵	۷۱۲,۱۷۹	۲۲.۷%	
۲۳			اخزا ۷۲۳	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۸/۲۴	۲۶۵ روز	۲۰,۰۹۴,۴۵۸	۶۷۱,۱۸۲	۲۳.۴%	
۲۴		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۲	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	۲۸۲ روز	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۶,۸۲۸	۱۹.۹%	
۲۵		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۱	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۱۳	۸۱۴ روز	۳,۰۰۰,۰۰۰	۶۵۲,۹۰۰	۲۲.۹%	
۲۶			اخزا ۸۰۳	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۵/۲۱	۳۰۴ روز	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۶,۹۴۱	۲۰.۰%	
۲۷		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۷	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	۷۳۰ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۶۸۰,۴۴۸	۲۲.۵%	
۲۸			اخزا ۸۱۵	۱۳۹۸/۰۴/۰۶	۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۹۸۹ روز	۴,۰۰۰,۰۰۰	۶۰۲,۳۸۰	۲۴.۳%	
<p>جمع اسناد خزانه اسلامی <b>فعال</b> در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۵۰۲,۶۳۵,۴۶۲ میانگین نرخ اسناد خزانه اسلامی: ۲۲.۳%</p>										
۲۹	غیرفعال در تابلو معاملات فرابورس ایران	بند (و) تبصره (۱۶) قانون بودجه سال ۱۳۹۶	اخزا ۶۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵	۱۳۹۸/۱۱/۱۵	۱۱۵ روز	۲,۶۲۰,۰۰۰	-	-	
۳۰			بند (ف) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۱	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۳۹۹/۰۴/۲۳	۲۷۵ روز	۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۱			بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۴	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۴/۲۱	۶۳۹ روز	۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۲				اخزا ۸۰۵	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۴/۲۲	۶۴۰ روز	۲,۰۰۰,۰۰۰	-	-
۳۳		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۰۶	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۹	۶۶۸ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۴			اخزا ۸۰۸	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۸/۱۷	۷۵۸ روز	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۵			اخزا ۸۰۹	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۹/۲۳	۷۹۴ روز	۲۵,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۶			اخزا ۸۱۰	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۰۶	۸۰۷ روز	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۷		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۲	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۱/۱۱	۸۲۴ روز	۴,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۸		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۳	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۱/۰۲/۱۹	۹۴۰ روز	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۳۹		بند (ه) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۴	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۹۷۰ روز	۳,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
۴۰		بند (ب) تبصره (۵) قانون بودجه سال ۱۳۹۸	اخزا ۸۱۶	۱۳۹۸/۰۵/۰۳	۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۱۰۱۷ روز	۲,۰۰۰,۰۰۰	-	-	
<p>جمع اسناد خزانه اسلامی <b>غیرفعال</b> در تابلو معاملات فرابورس ایران: ۱۹۷,۶۲۰,۰۰۰</p>										

۷۰۰,۲۵۵,۴۶۲

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 تاخیر در پرداخت طلب طلبکاران از نفع صدور حواله تسلیط 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 تاخیر 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 ۸۴۸,۲۳۸ میلیارد ریال بوده و میانگین موزون زمان تا سررسید (ATM) این اوراق ۱.۲۸ سال است.