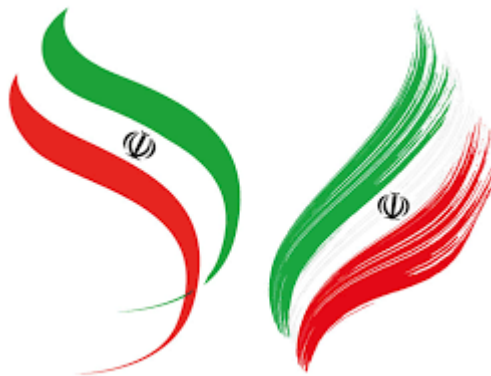


باسمه تعالی



خبرنامه هفتگی مدیریت بدهی های عمومی

در این شماره می خوانید:

- وضعیت کلان بدهی ها و مطالبات دولت
- روند فصلی نسبت بدهی دولت و شرکتهای دولتی به تولید ناخالص داخلی
- وضعیت بدهی ها و مطالبات دولت و شرکتهای دولتی به تفکیک اشخاص و نهادهای عملکرد مربوط به انتشار و تسویه اوراق بهادار دولت
- وضعیت شفافن های اثرگذار بر بازارهای پولی و مالی کشور
- گزیره اطلاعات مربوط به بازار بدهی طی هفته
- اهم اخبار و رفتارها
- نکته آموزشی هفته
- فرصت های سرمایه گذاری در اسناد خزانه اسلامی دولت



تهیه و تدوین: اداره مدیریت ریسک، تدوین راهبردها و پایش پایداری بدهی های دولت

هفته منتهی به پنجشنبه ۲۶ خرداد ۱۴۰۱



<https://iridmo.mefa.ir>



Riskmgn@mefa.gov.ir



<https://sokhan.mefa.ir/۸۰۸۲>

۱ مقدمه

گزارش حاضر در راستای ایفای وظایف مرکز مدیریت بدهی‌های عمومی و روابط مالی دولت در حوزه اطلاع‌رسانی، شفاف‌سازی و ارتقای دانش عمومی در زمینه مدیریت بدهی‌های عمومی تهیه شده است. مخاطبین محترم می‌توانند از طریق وبگاه مرکز و یا راه‌اندازی سامانه "سخن" بر روی تلفن همراه، نسخ قبلی خبرنامه را دریافت و همچنین از طریق پست الکترونیکی که در صفحات اول و آخر خبرنامه درج شده است، نظرات و پیشنهادات سازنده خود را ارسال نمایند. عمده اقلام و داده‌های اطلاعاتی در این خبرنامه از ادارات داخلی مرکز (ادارات گزارشگری بدهی‌ها و مطالبات عمومی، حسابداری کل و روابط مالی دولت، تامین مالی و اوراق بهادار اسلامی، مدیریت نقدینگی و بازاریابی اوراق مالی اسلامی، ساماندهی و تهاتر بدهی‌ها و مطالبات دولتی و اداره حسابرسی داخلی و بررسی‌های ویژه) دریافت شده است.

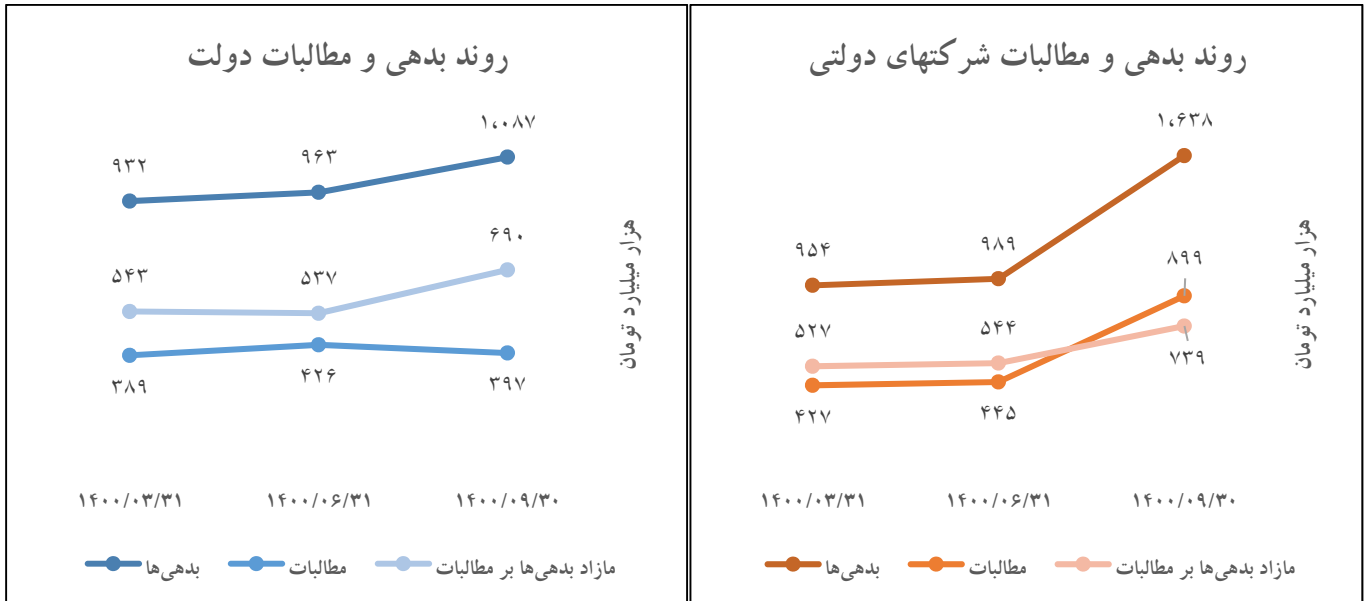
۲ وضعیت کلان بدهی‌ها و مطالبات دولت و شرکت‌های دولتی در پایان پاییز ۱۴۰۰

در راستای انجام تکالیف قانونی مندرج در بند (الف) ماده (۱) قانون رفع موانع تولید رقابت‌پذیر و ارتقای نظام مالی کشور مصوب اردیبهشت ماه سال ۱۳۹۴ و ماده (۳) آیین نامه اجرایی آن موضوع تصویب‌نامه شماره ۶۱۲۴۰/ت/۵۲۲۳۰ هـ مورخ ۱۳۹۴/۵/۱۷ هیات محترم وزیران، گزارش جامع بدهی‌ها و مطالبات دولت و شرکت‌های دولتی می‌باید در مقاطع فصلی و سالانه براساس آخرین اطلاعات درج شده توسط دستگاه‌های اجرایی در سامانه مدیریت اطلاعات بدهی‌ها و مطالبات دولت (سمد) تهیه و به مراجع قانونی ذیربط ارائه شود. اضافه می‌نماید، از آبان ماه ۱۳۹۴ تاکنون بالغ بر ۳۱ گزارش جامع فصلی و سالانه تهیه و برای ارایه به مراجع ذیربط برای رییس جمهور محترم ارسال شده است. این گزارش‌ها بر مبنای اطلاعات ثبت شده (بیش از ۱۵۱,۰۰۰ فقره گزارش) توسط بیش از ۳۵۰۰ دستگاه‌های اجرایی (نقطه گزارشگری) از سراسر کشور و مستند به تراز مالی آنها، پس از بررسی و پالایش تهیه و تجمیع شده است. شایان ذکر است براساس اطلاعات ثبت شده در سامانه فوق‌الذکر تا پایان شهریور ماه سال جاری، بدهی‌ها و مطالبات دولت برحسب طبقات مندرج در ماده (۱) قانون مذکور به ترتیب مبلغ ۱,۰۸۶,۵۵۳ میلیارد تومان و مبلغ ۳۹۶,۹۶۹ میلیارد تومان می‌باشد که جزئیات آن به شرح ذیل ارایه شده است:

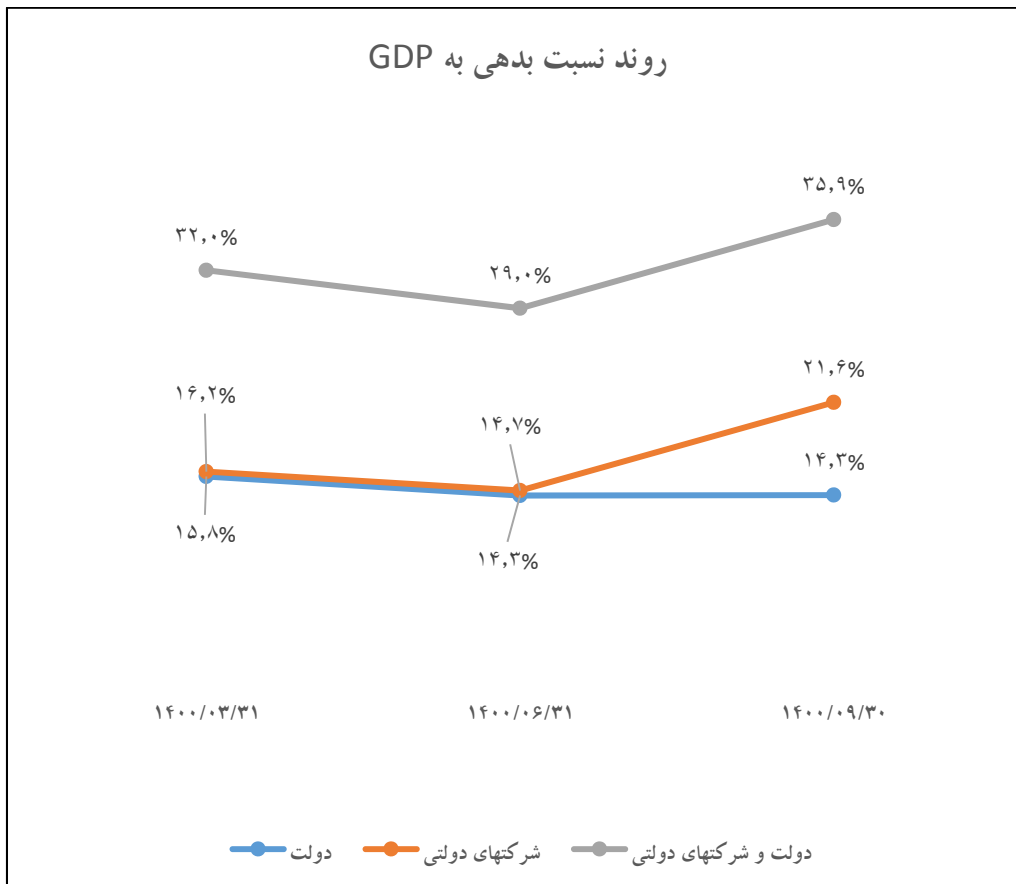
۲,۱ گزارش بدهی‌ها و مطالبات دولت و شرکت‌های دولتی (میلیون ریال)

عنوان	۱۴۰۰/۹/۳۰	۱۴۰۰/۶/۳۱	افزایش (کاهش)
بدهی‌های دولت	۱۰,۸۶۵,۵۳۰,۴۶۳	۹,۶۲۵,۵۱۳,۳۷۸	۱,۲۴۰,۰۱۷,۰۸۵
مطالبات دولت	۳,۹۶۹,۶۹۴,۳۰۵	۴,۲۵۶,۷۴۶,۴۱۷	(۲۸۷,۰۵۲,۱۱۲)
مازاد بدهی‌ها بر مطالبات دولت	۶,۸۹۵,۸۳۶,۱۵۹	۵,۳۶۸,۷۶۶,۹۶۱	۱,۵۲۷,۰۶۹,۱۹۷
بدهی‌های شرکت‌های دولتی	۱۶,۳۸۰,۷۴۹,۶۳۵	۹,۸۸۷,۰۷۷,۴۲۰	۶,۴۹۳,۶۷۲,۲۱۵
مطالبات شرکت‌های دولتی	۸,۹۸۶,۴۵۱,۵۷۹	۴,۴۴۵,۶۶۵,۵۹۴	۴,۵۴۰,۷۸۵,۹۸۵
مازاد بدهی‌ها بر مطالبات شرکت‌های دولتی	۷,۳۹۴,۲۹۸,۰۵۷	۵,۴۴۱,۴۱۱,۸۲۶	۱,۹۵۲,۸۸۶,۲۳۱

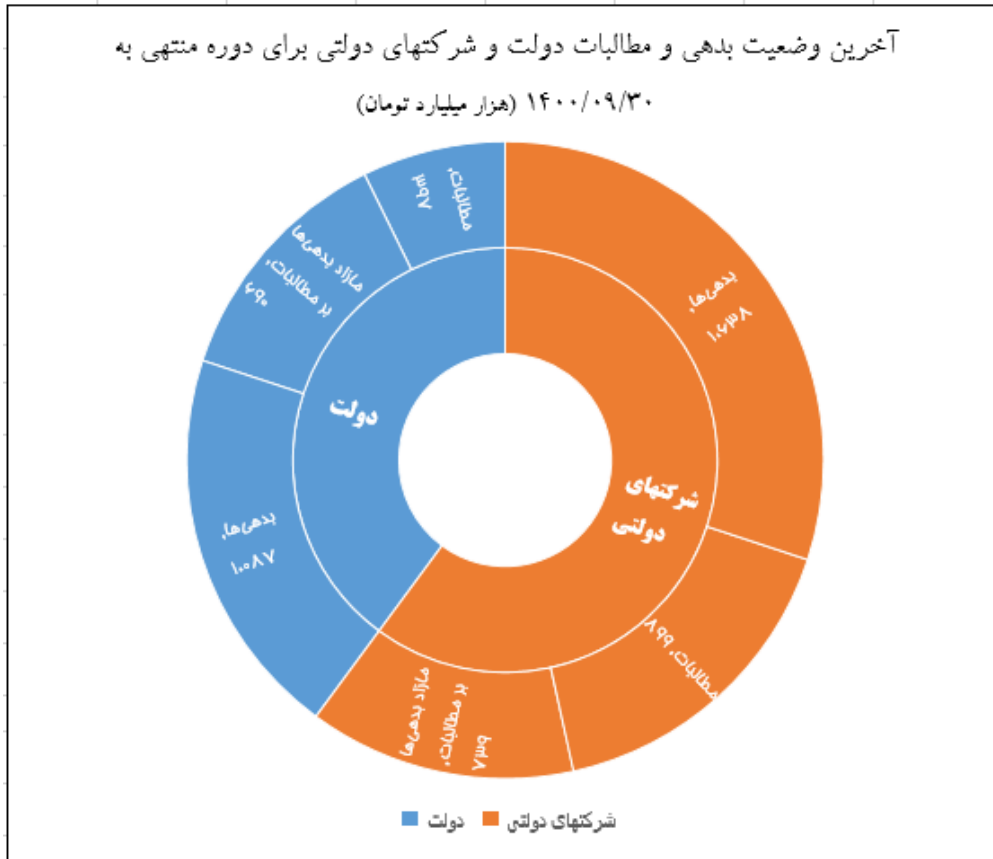
۲,۲ روند بدهی‌ها و مطالبات دولت و شرکتهای دولتی



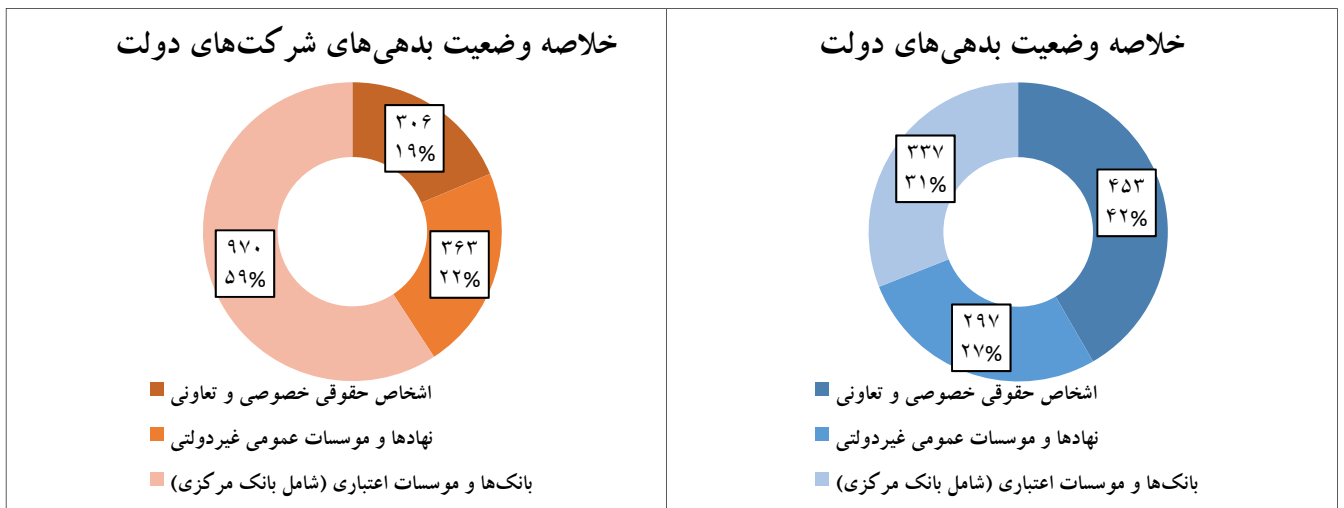
۲,۳ روند نسبت بدهی دولت و شرکتهای دولتی به تولید ناخالص داخلی



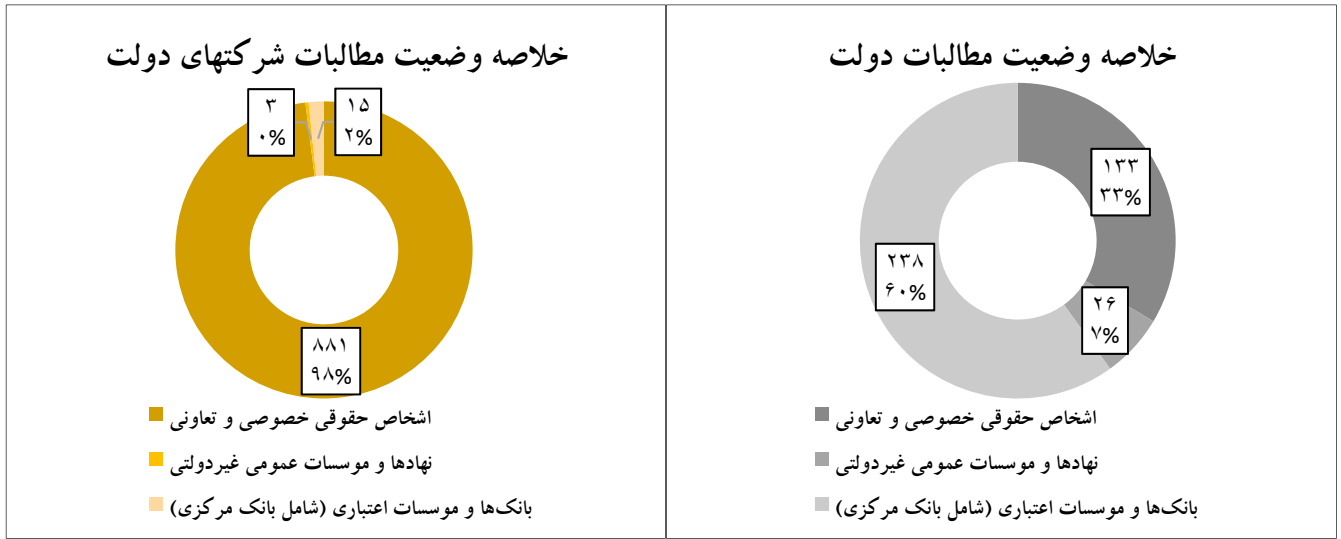
۲,۴ آخرین وضعیت بدهی‌ها و مطالبات دولت و شرکتهای دولتی



۲,۵ خلاصه وضعیت بدهی‌های دولت و شرکتهای دولتی به تفکیک طبقات مندرج در قانون رفع موانع تولید (هزار میلیارد تومان)



۲,۶ خلاصه وضعیت مطالبات دولت و شرکت‌های دولتی به تفکیک طبقات مندرج در قانون رفع موانع تولید (هزار میلیارد تومان)



۲,۷ خلاصه وضعیت بدهی‌ها و مطالبات دولت به تفکیک اشخاص و نهادهای (هزار میلیارد تومان)

وضعیت بدهی‌ها و مطالبات دولت به تفکیک اشخاص و نهادهای
تاریخ منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
(هزار میلیارد تومان)

■ مطالبات ■ بدهی‌ها

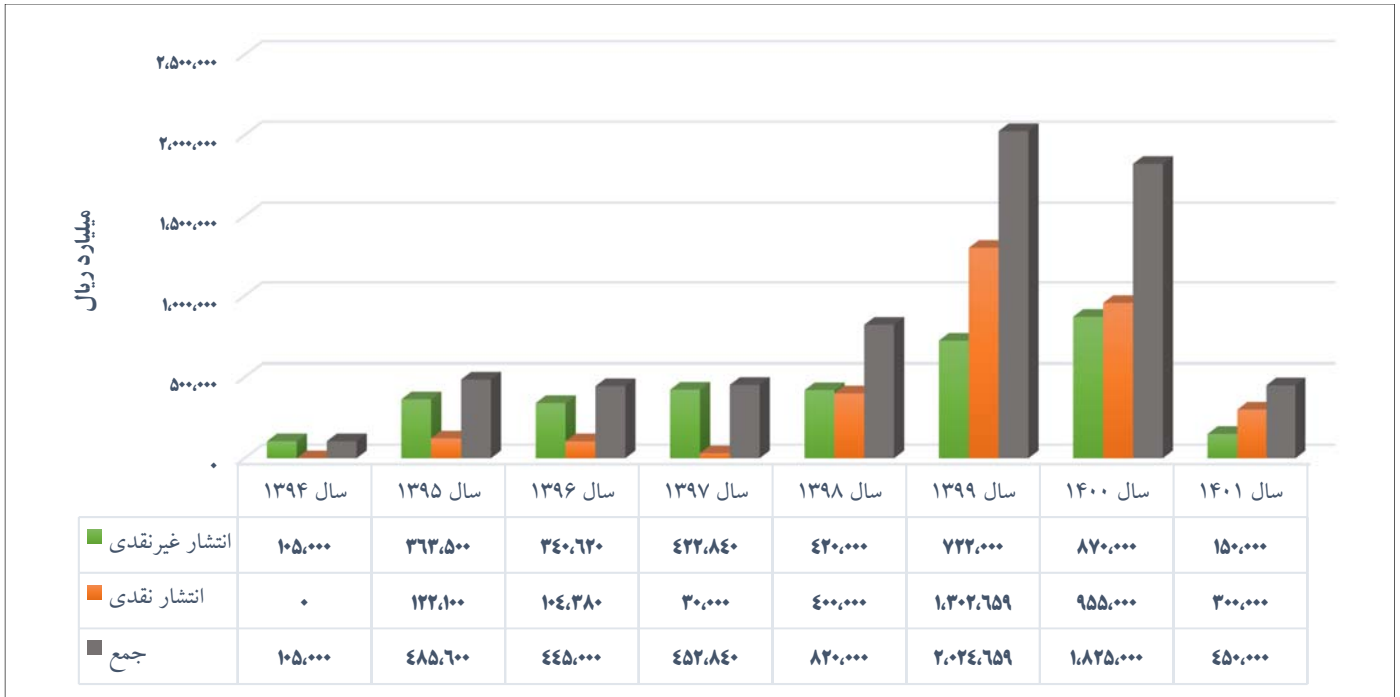
بدهی‌ها		مطالبات			
دارندگان اوراق مالی اسلامی: ۳۵۵	بانک مرکزی، ج.ا.ا بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی دولتی: ۲۹۸	موسسات و نهادهای عمومی غیردولتی: ۲۹۷		بانک مرکزی، ج.ا.ا بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی دولتی: ۱۵۳	
	سایر اشخاص حقوقی: ۹۸	بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی خصوصی: ۳۸	بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی خصوصی: ۸۵		سایر اشخاص حقوقی: ۲۶

۲,۸ خلاصه وضعیت بدهی‌ها و مطالبات شرکتهای دولتی به تفکیک اشخاص و نهادها (هزار میلیارد تومان)

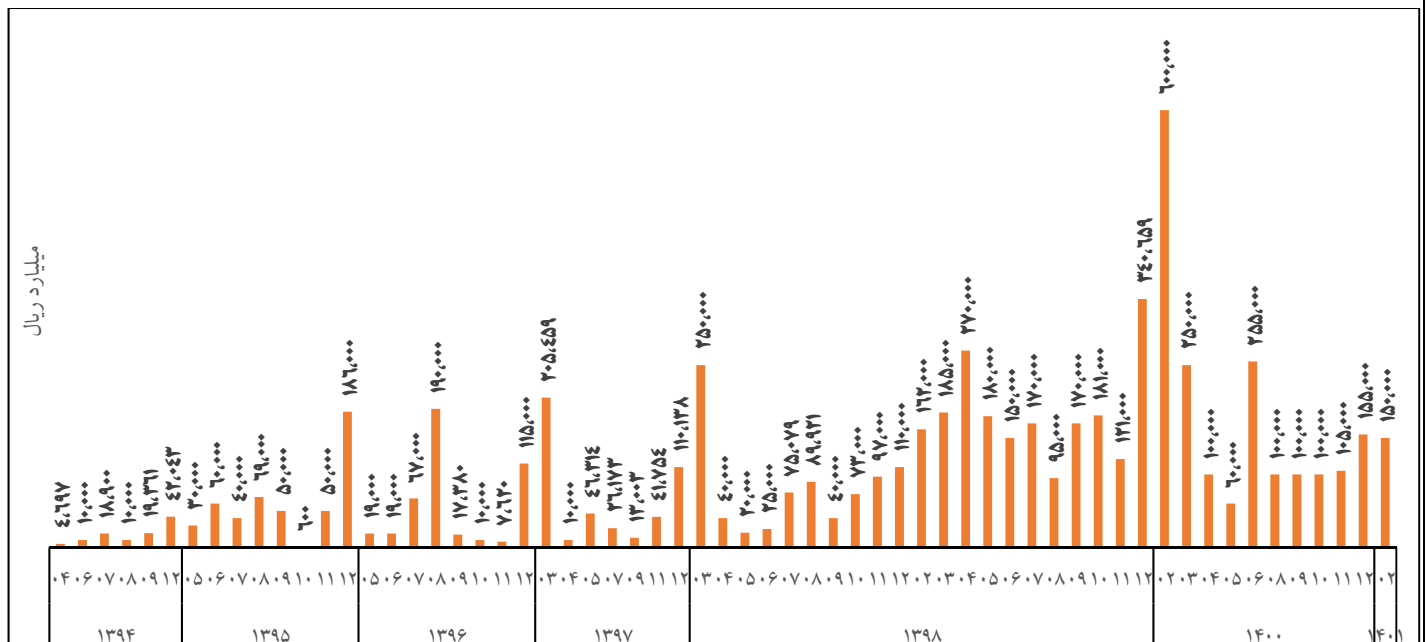


۳ عملکرد مربوط به انتشار و تسویه اوراق بهادار دولت

۳,۱ عملکرد انتشار سالانه اوراق مالی اسلامی با تضمین دولت به تفکیک نقدی و غیرنقدی

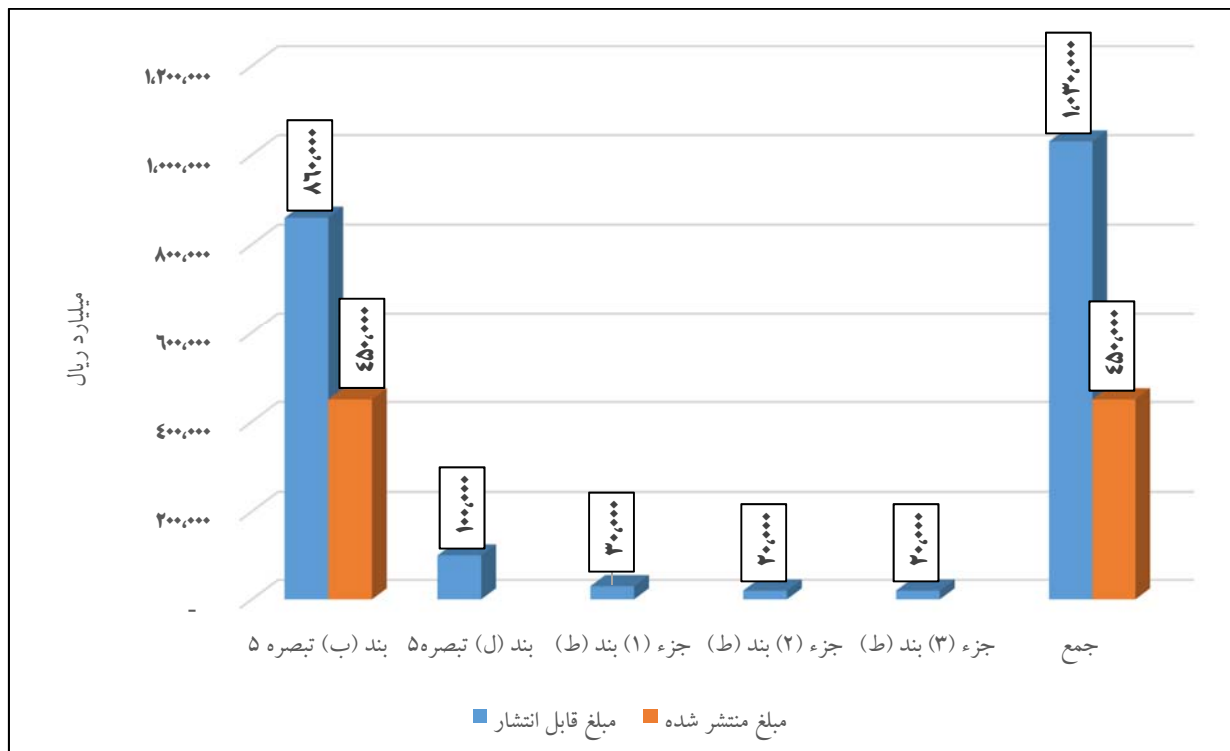


۳,۲ عملکرد انتشار ماهانه اوراق مالی اسلامی با تضمین دولت

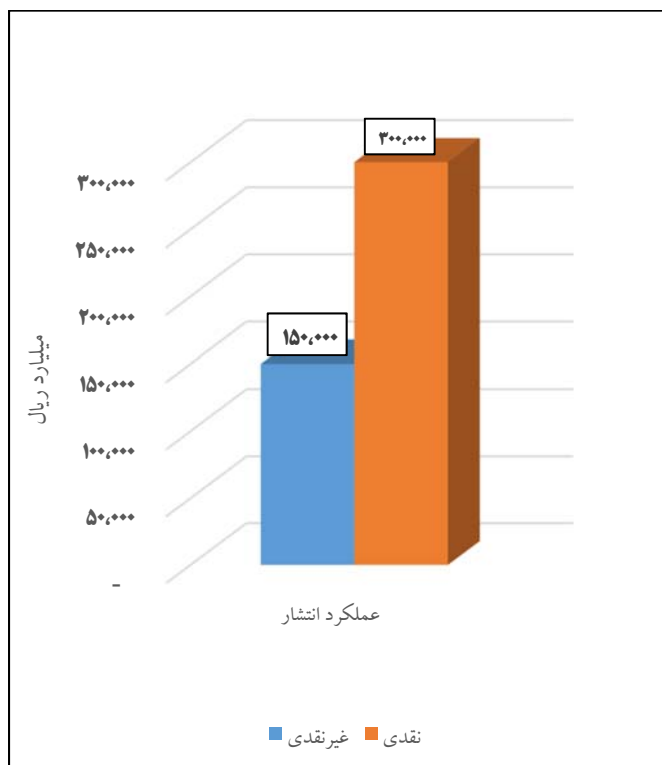


عملکرد بالای برخی ماه‌ها به دلیل انتشار اسناد خزانه اسلامی بوده است. اسناد مذکور به صورت یکجا منتشر و به تدریج از طریق دستگاه‌های اجرایی دارای سهمیه به طلبکاران دولت واگذار می‌شود و لذا از محل انتشار اوراق مذکور وجوه نقد به حساب خزانه‌داری کل کشور واریز نمی‌گردد. با توجه به واگذاری تدریجی، طلبکاران دولت نیز به مرور و در صورت نیاز به تامین منابع مالی نقدی، اقدام به فروش اسناد خود در بازار سرمایه می‌نمایند.

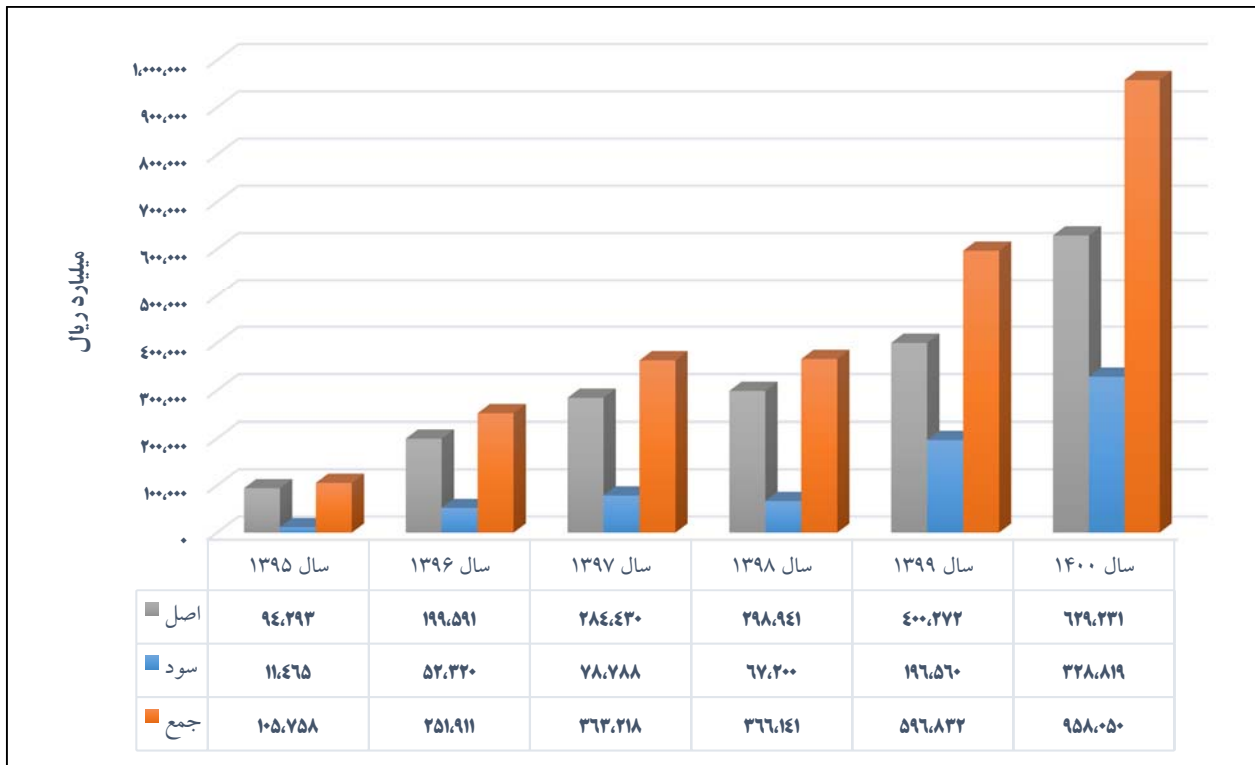
۳,۳ عملکرد انتشار اوراق دولتی مطابق با ظرفیت‌های قانونی در سال ۱۴۰۱



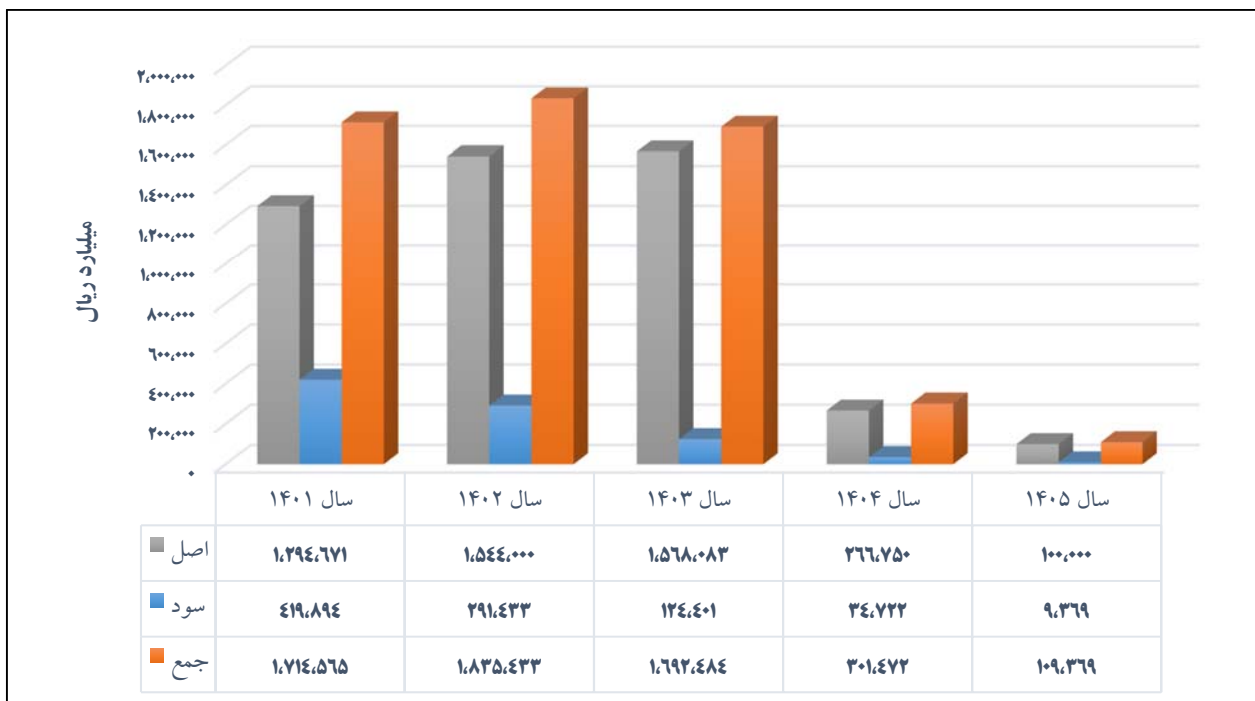
۳,۴ عملکرد انتشار اوراق دولتی از ابتدای سال جاری به تفکیک نوع انتشار



۳,۵ عملکرد تسویه اصل و سود اوراق دولتی در سنوات گذشته



۳,۶ وضعیت تعهدات آتی در خصوص تسویه اصل و سود اوراق دولتی در سنوات آتی



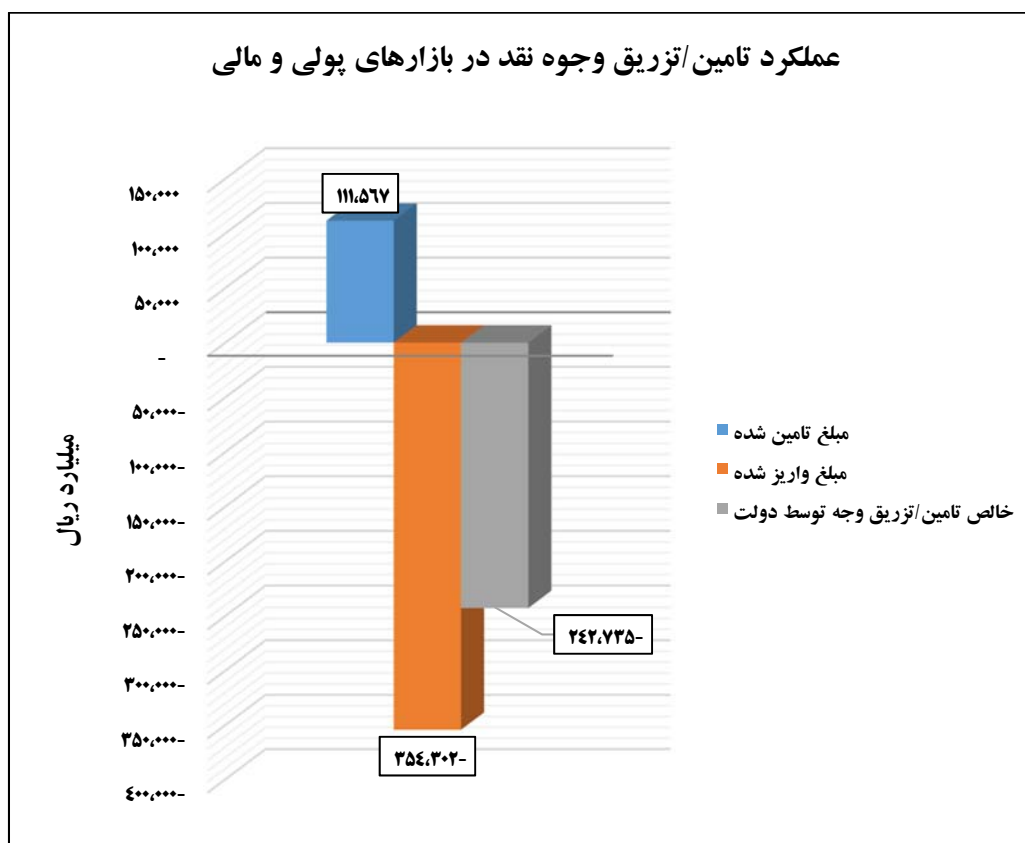
از ابتدای سالجاری تا تاریخ تهیه گزارش، مبلغ ۳۵۴,۳۰۲ میلیارد ریال از تعهدات مربوط به اوراق با تضمین دولت در سال ۱۴۰۱ (شامل مبلغ ۲۷۰,۰۰۰ میلیارد ریال بابت اصل و مبلغ ۸۴,۳۰۲ میلیارد ریال بابت سود) تسویه شده است. لذا مبالغ مورد نیاز برای تسویه تعهدات

اوراق با تضمین دولت تا انتهای سال ۱۴۰۵، به مبلغ ۵,۲۹۹,۰۲۱ میلیارد ریال (شامل مبلغ ۴,۵۰۳,۵۰۳ میلیارد ریال بابت اصل و مبلغ ۷۹۵,۵۱۸ میلیارد ریال بابت سود) می‌باشد.

۳,۷ میزان تعهدات تا پایان سال و عملکرد تسویه اوراق دولتی از ابتدای سال ۱۴۰۱ (میلیارد ریال)

عنوان	مبلغ تسویه شده	تعهدات باقیمانده تا پایان سال
اصل اوراق دولتی	۲۷۰,۰۰۰	۱,۰۲۴,۶۷۱
سود اوراق دولتی	۸۴,۳۰۲	۳۳۵,۵۹۲
جمع	۳۵۴,۳۰۲	۱,۳۶۰,۲۶۳

۳,۸ خالص وجه نقد تامین/تزریق شده توسط دولت در نتیجه انتشار و تسویه اوراق مالی اسلامی از ابتدای سال ۱۴۰۱



۴ وضعیت شاخص‌های اثرگذار بر بازارهای پولی و مالی کشور

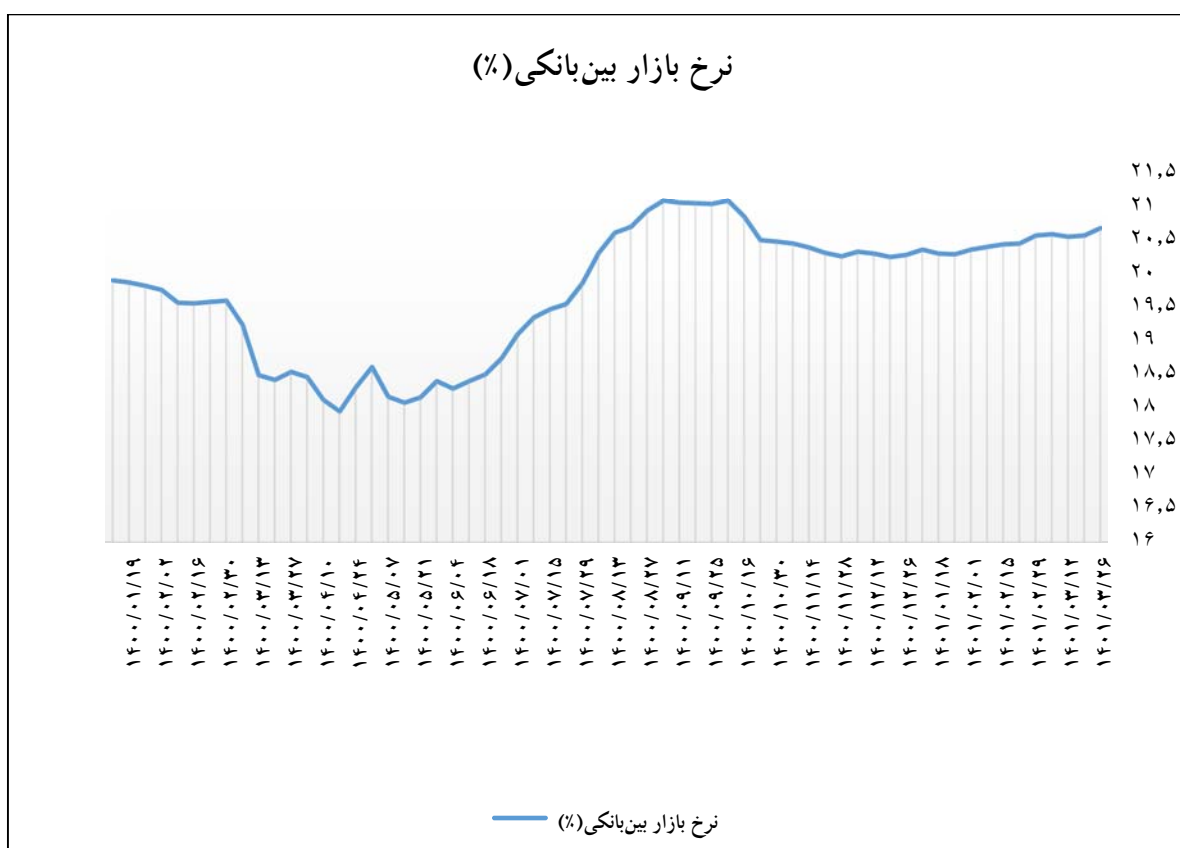
۴,۱ تصویری کلی از تغییرات متغیرهای پولی و مالی

عنوان	هفته جاری	هفته گذشته	تغییرات (%)
نرخ بازار بین بانکی	۲۰,۶۸٪	۲۰,۵۷٪	۰,۱۱٪
میانگین بازده اوراق با درآمد ثابت در بازار سرمایه	۲۰,۸۴٪	۲۰,۸۱٪	۰,۰۳٪
شاخص کل صکوک فرابورس ایران (هموزن)	۵۹۴,۶۲	۵۹۲,۵۱	۰,۳۶٪
شاخص اسناد خزانه اسلامی فرابورس ایران (هموزن)	۲۳۵,۸۱	۲۳۴,۹۲	۰,۳۸٪
شاخص کل بورس اوراق بهادار (هموزن)	۴۲۸,۹۳۲	۴۲۱,۴۰۱	۱,۷۹٪

تغییرات بیشتر از نیم درصد مثبت با علامت ▲ و بیشتر از نیم درصد منفی با علامت ▼ نشان داده می‌شود.

تغییرات کمتر از نیم درصد مثبت یا منفی با علامت ■ نشان داده می‌شود.

۴,۲ نمودار روند تاریخی نرخ بازار بین بانکی:

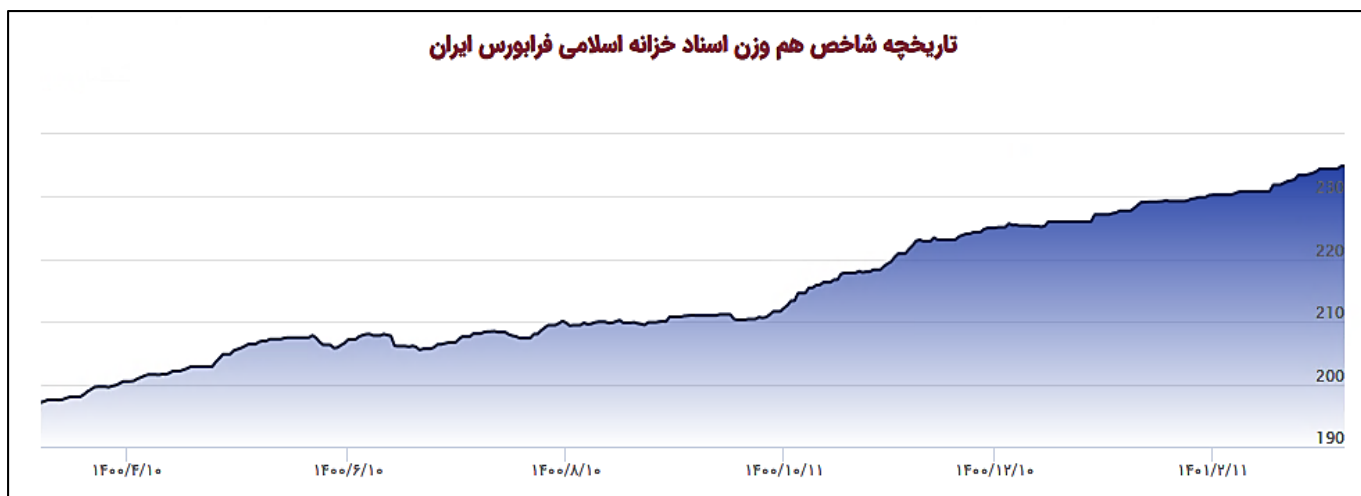


۴,۳ نمودار روند تاریخی میانگین بازده اوراق با درآمد ثابت در بازار سرمایه



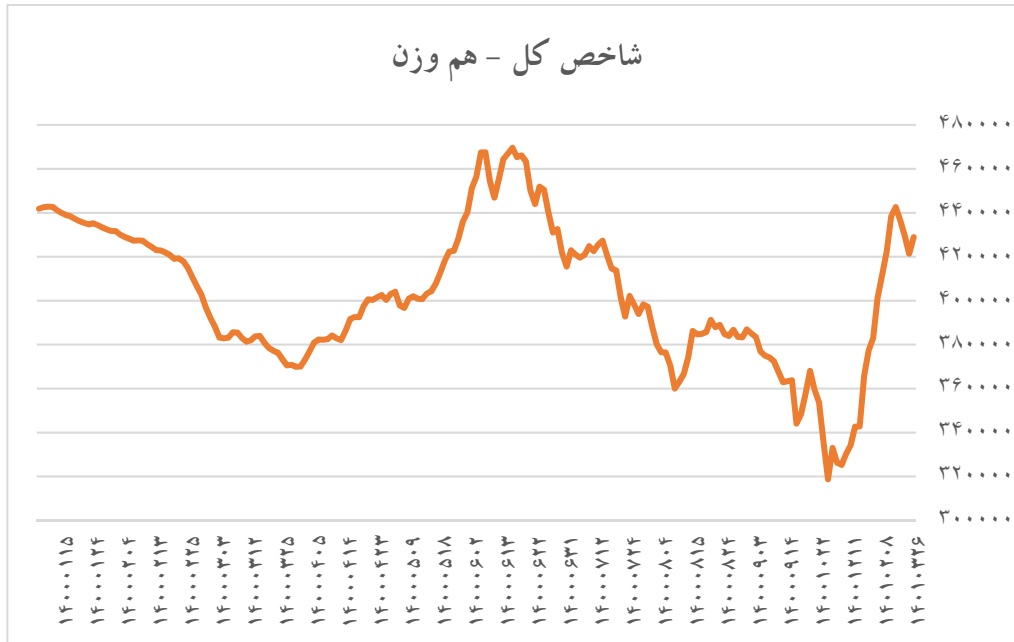
بر اساس آخرین اطلاعات دریافتی میانگین بازده اوراق با درآمد ثابت معادل ۲۰,۸۴ درصد سالانه می‌باشد که نسبت به هفته گذشته ۳ صدم درصد افزایش و نسبت به ماه گذشته ۴۸ صدم درصد کاهش داشته است.

۴,۴ نمودار تاریخچه شاخص اسناد خزانه اسلامی فرابورس ایران (هموزن)



بر اساس آخرین اطلاعات دریافتی شاخص اسناد خزانه اسلامی فرابورس ایران به رقم ۲۳۵,۸۱ واحد رسیده است. بازدهی سبد اسناد خزانه دولتی در طی هفته گذشته مثبت ۰,۳۸ درصد و طی ماه گذشته مثبت ۲,۱۴ درصد بوده است. این در حالیست که بازدهی شاخص کل صکوک فرابورس ایران (هموزن) طی هفته گذشته ۳۶ صدم درصد و طی ماه گذشته ۱,۶۵ درصد بوده است.

۴,۵ شاخص کل بورس اوراق بهادار (هم وزن)



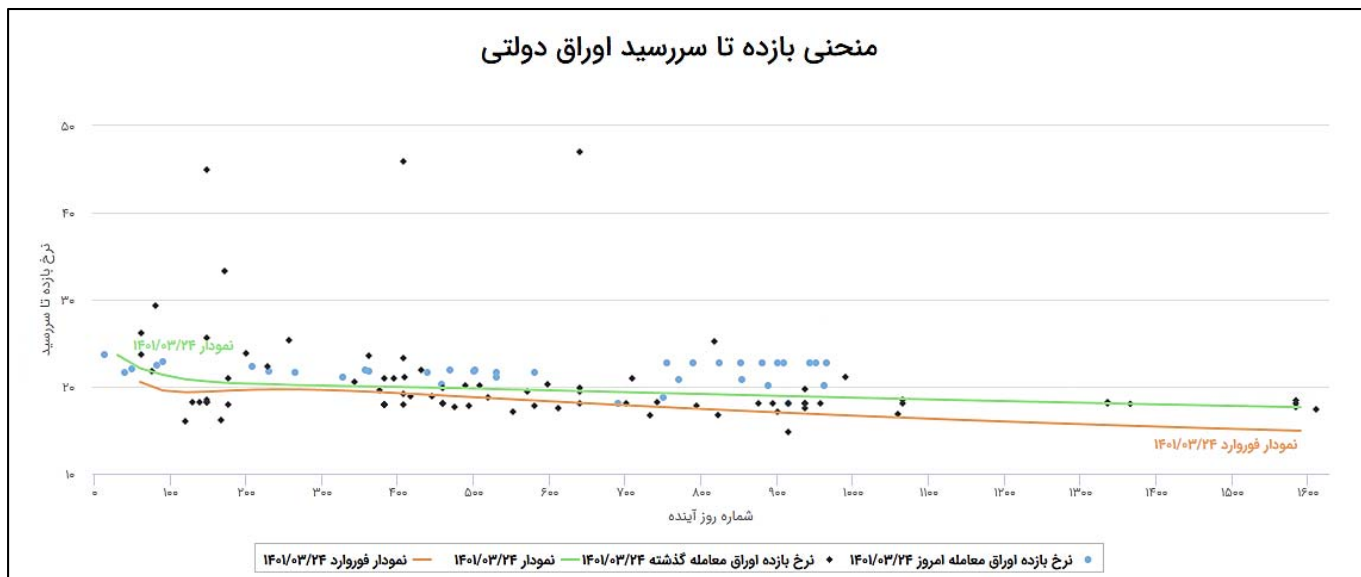
منبع: شرکت مدیریت و فناوری بورس تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار در هر کشوری همانند دماسنج اقتصاد آن کشور می باشد و از اهمیت بالایی برخوردار است. لذا در کنار سایر شاخص های مهم، نمودار شاخص هم وزن نیز می بایست مورد توجه قرار گیرد. همانطور که ملاحظه می شود، شاخص هم وزن که برگرفته از میانگین هم وزن شده کلیه سهام قابل معامله در بورس اوراق بهادار می باشد، بر اساس آخرین اطلاعات دریافتی به رقم **۴۲۸,۹۳۲** واحد رسیده است و نسبت به هفته گذشته **۱,۷۹ درصد افزایش** و نسبت به ماه گذشته **۳,۰۹ درصد کاهش** داشته است.

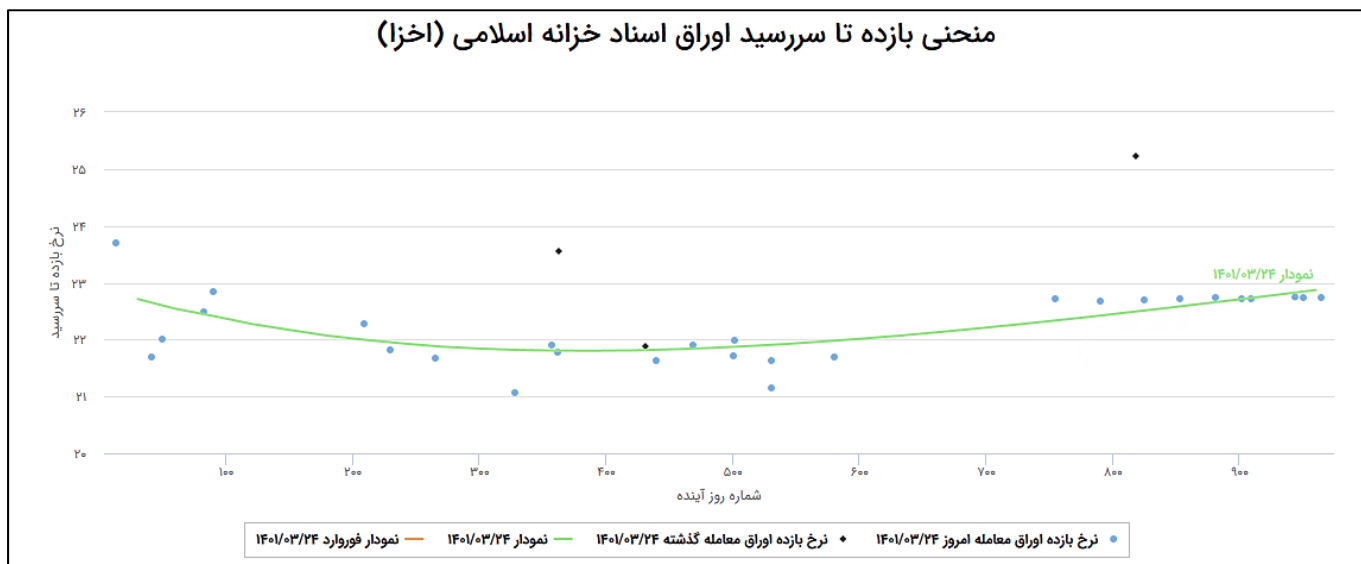
۴,۶ منحنی های بازده تا سررسید اسناد خزانه اسلامی و اوراق دولتی

منحنی بازده تا سررسید نموداری است که به صورت لحظه ای متوسط نرخ بهره بازار (محور عمودی) و مدت زمان تا سررسید (محور افقی) را نشان می دهد. نمودارهای ذیل منحنی بازده تا سررسید اوراق دولتی و اسناد خزانه اسلامی را نشان می دهد:

منحنی بازده تا سررسید اوراق دولتی



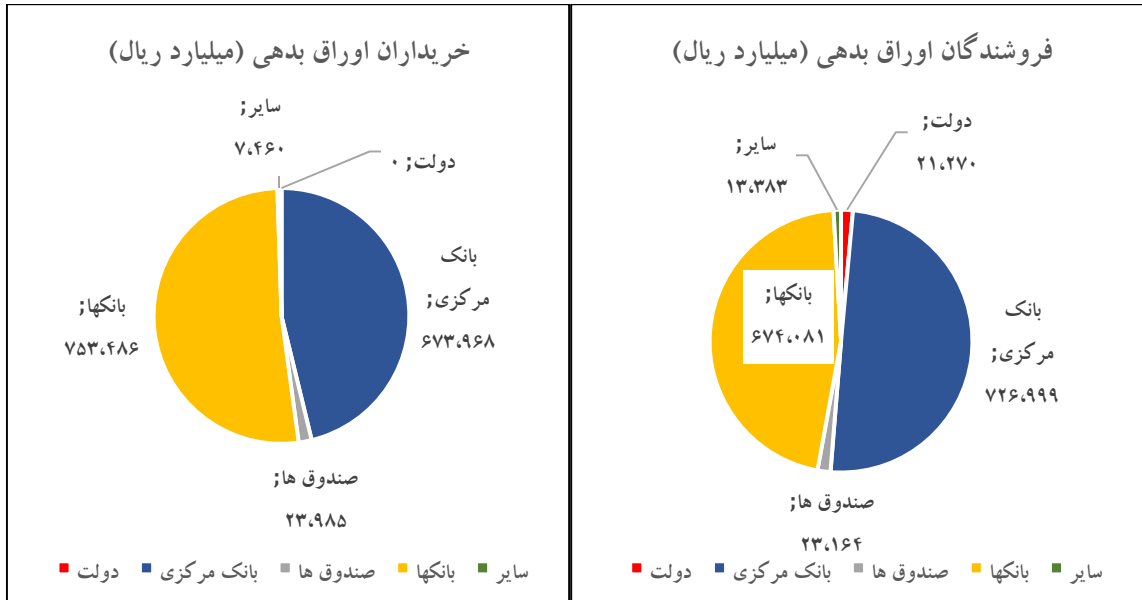
منحنی بازده تا سررسید اوراق اسناد خزانه اسلامی (اخزا)



در حالت عادی شیب این منحنی به دلیل ارزش زمانی پول مثبت (ملایم) است، اگر شیب این منحنی تند و صعودی باشد، یعنی اوراق با سررسید بالاتر، سود بیشتری دارند پس پول حال حاضر ارزشمند است و نوید بخش آینده روشن و بازدهی بالا خواهد بود و شیب منحنی تخت یا منفی نتیجه عکس خواهد داشت و نشان دهنده رکود در اقتصاد پیش رو است. همانند شاخص اوراق با درآمد ثابت، هرچه بازار بدهی عمیق تر باشد قابلیت اتکاء این نمودارها افزایش می‌یابد.

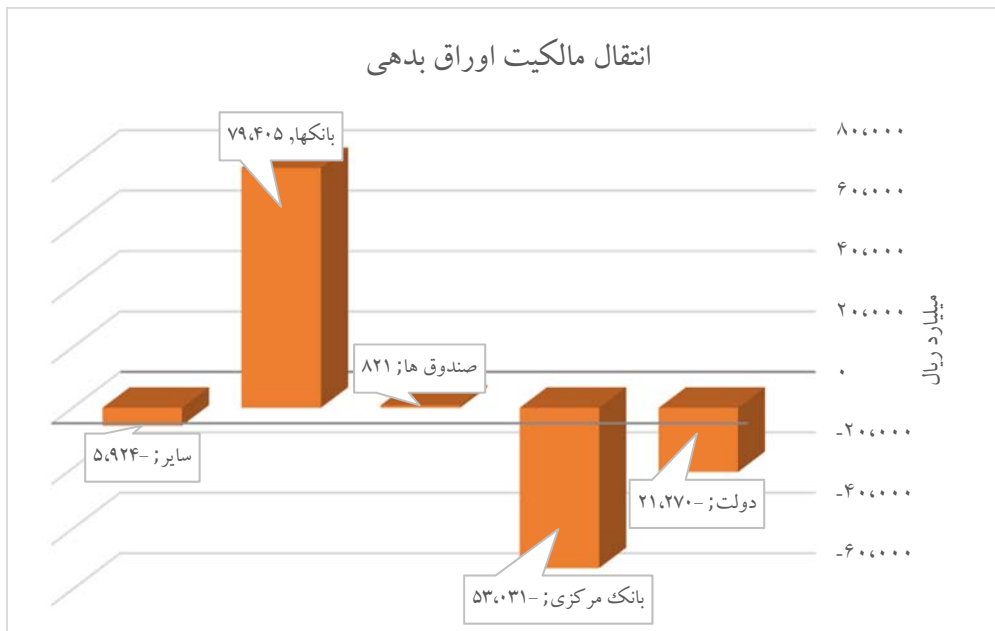
۵. گزیده اطلاعات مربوط به بازار بدهی طی هفته

۵,۱ خریداران و فروشندگان اوراق بدهی در هفته (۲۱ خرداد الی ۲۴ خرداد)



منبع: فرابورس ایران

۵,۲ نمودار انتقال مالکیت اوراق بدهی در هفته (۲۱ خرداد الی ۲۴ خرداد)



منبع: فرابورس ایران

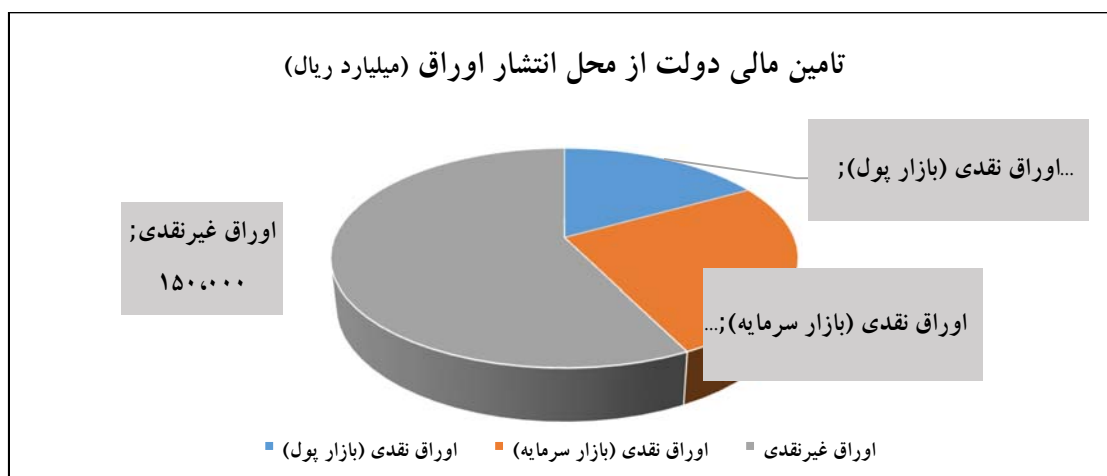
همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته، بانکها بطور عمده خریداران اوراق بدهی بوده‌اند و بانک مرکزی بطور خالص مبلغ ۵۳,۰۳۱ میلیارد ریال در بازار بدهی فروشنده اوراق بوده است. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۲۱,۲۷۰ میلیارد ریال از طریق اوراق بهادار اسلامی نموده است.

۵,۳ نتیجه عرضه اوراق بهادار دولتی منتهی به مورخ ۱۴۰۱/۰۳/۲۵

حسب تصمیمات اتخاذ شده در راستای تأمین مالی بهینه، چهارمین هفته عرضه اوراق مالی اسلامی منتهی به مورخ ۱۴۰۱/۰۳/۲۵ برگزار شد، که طی آن ضمن برگزاری حراج و اخذ سفارش‌های خرید اوراق از متقاضیان در سامانه‌های بازار بین‌بانکی کارگزاری بانک مرکزی و مظنه‌یابی شرکت مدیریت فناوری بورس مبلغ ۲,۱۲۷ میلیارد تومان اوراق به شرح جدول ذیل به فروش رسید.

شرح	نماد معاملاتی	سررسید اوراق	مبلغ عرضه (میلیون ریال)	نرخ اسمی اوراق	نرخ بهره موثر اوراق	متقاضیان	مبلغ کل فروخته شده (میلیون ریال)
عرضه اوراق مباحه عام	اراد۱۰۵	مرداد۱۴۰۳	۶,۶۴۳,۵۰۰	۱۸٪	۲۲٪	بازار سرمایه	۲,۳۱۶,۵۷۱
	اراد۱۰۶	شهریور۱۴۰۲	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰		۲۱,۵٪	بازار سرمایه	۶,۱۹۶,۰۲۴
	اراد۱۰۷	مهر۱۴۰۳	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰		۲۲٪	بازار پول	۱۲,۶۷۲,۴۰۰
						بازار سرمایه	۸۵,۴۰۵
جمع کل فروش			۲۰۶,۶۴۳,۵۰۰				۲۱,۲۷۰,۴۰۰

۵,۴ جزئیات عملکرد انتشار اوراق مالی اسلامی در سال ۱۴۰۱



۵,۵ برنامه عرضه اوراق دولتی در هفته آتی

نماد معاملاتی	تاریخ سررسید	تعداد ورقه (ورقه یک میلیونی ریالی)
اراد۱۰۵	مرداد۱۴۰۳	۴,۲۱۳,۷۰۰
اراد۱۰۶	شهریور۱۴۰۲	۸۰,۶۴۳,۸۰۰
اراد۱۰۷	مهر۱۴۰۳	۹۹,۹۱۰,۰۰۰
جمع کل		۱۸۴,۷۶۷,۵۰۰

۶ اهم اخبار و رخدادها

- ۱- نتیجه چهارمین حراج اوراق مالی اسلامی دولتی و برگزاری حراج مرحله جدید در وبگاه بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران منتشر شد. (منبع: www.cbi.ir)
- ۲- بنابر گزارش عملیات اجرایی سیاست پولی بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، با توجه به پیش‌بینی بانک مرکزی از وضعیت نقدینگی در بازار بین‌بانکی، موضع عملیاتی بانک مرکزی در هفته منتهی به ۲۳ خرداد توافق بازخرید بود. از این رو، این بانک به اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخرید به مبلغ ۶۵۰,۰ هزار میلیارد ریال اقدام کرد. (منبع: www.cbi.ir)
- ۳- رشد اقتصادی کشور (به قیمت‌های ثابت سال ۱۳۹۵) در سال ۱۴۰۰ به عدد ۴,۴ درصد رسید. تحقق رشد اقتصادی ۴,۴ درصدی در سال ۱۴۰۰ در امتداد رشد اقتصادی ۴,۱ درصدی سال ۱۳۹۹، حکایت از روند رو به بهبود فعالیت‌های اقتصادی در کشور به رغم تداوم تحریم‌های اقتصادی دارد. (منبع: www.cbi.ir)
- ۴- وزیر امور اقتصادی و دارایی گفت: پروژه‌های پیش‌ران و عمرانی نیمه‌تمام اولویت‌دار در استان‌ها از منابع عمومی برخوردار می‌شوند. (منبع: www.shada.ir)
- ۵- وزیر امور اقتصادی و دارایی طی دستوری در نشست با رؤسای اتاق‌های اصناف سراسر کشور، انجمن اسلامی بازار تهران، رئیس کمیسیون اقتصادی مجلس و رئیس و اعضای فراکسیون اصناف مجلس شورای اسلامی مهلت تسلیم اظهار نامه‌های مالیاتی فعالان اقتصادی را تا ۱۵ تیر ماه تمدید کرد. (منبع: www.shada.ir)
- ۶- رئیس کل بانک مرکزی با تأکید بر اینکه از ابتدای سال تا ۲۰ خرداد مجموعاً ۸ میلیارد و ۱۰۰ میلیون دلار در بازار حواله معامله شده است گفت: در جلسه با صرافان مقرر شد تا در زمینه اسکناس، میزان عرضه ارز را بیشتر و مقررات مربوط به تقاضای بازار در حوزه اسکناس را هم تسهیل کنیم. (منبع: www.cbi.ir)

۷ نکته آموزشی هفته:

در گزارش پیشین به نقش "دارنده اوراق" به عنوان یکی از ارکان انتشار صکوک پرداخته شد. در این گزارش به نقش "ضامن" یکی دیگر از ارکان انتشار صکوک می‌پردازیم:

ضامن به عنوان عامل تضمین کننده سرمایه و سود دارندگان اوراق بهادار عمل نموده (بند و ماده یک دستور العمل انتشار اوراق اجاره) و مطابق مقررات وجودش الزامی است. رتبه بندی اعتباری عامل تعیین کننده وجود یا عدم وجود ضامن است. در صورتی که شرکتی رتبه اعتباری داشته باشد مطابق ماده ۲۳ دستور العمل انتشار اوراق اجاره وجود ضامن الزامی نخواهد بود. رتبه بندی اعتباری وضعیت مالی و سرمایه‌ای بانی را به لحاظ امکان ایفای تعهدات خویش معین می‌نماید و صلاحیت مالی او برای پرداخت سود و اصل اوراق را تضمین می‌کند.

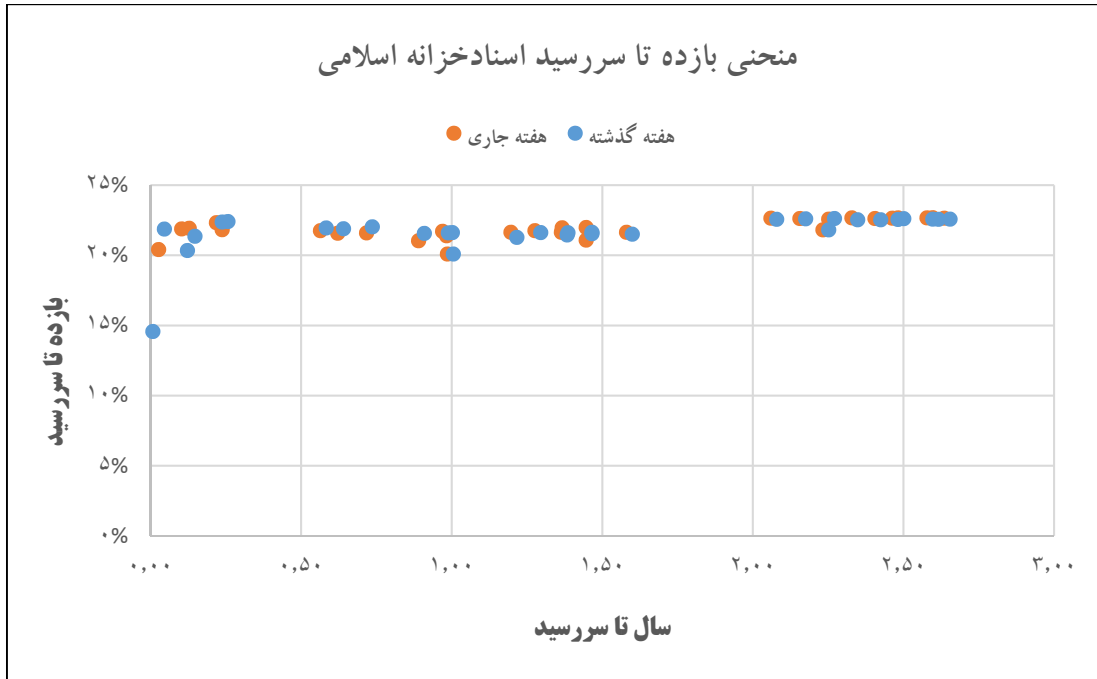
ضمانت ضامن صرف نظر از روابط مبنایی بین ضامن و بانی است: ضامن در هر صورت موظف است تا تعهداتی که از سوی بانی صورت نگرفته است را بر عهده گیرد، هرچند بانی در قبال ضامن تعهدات خویش را نادیده انگاشته باشد. این قید در قرارداد ضمانت در اوراق اجاره آمده است و مقرر می‌دارد: «تعهدات ضامن در این قرارداد در برابر ناشر از هر حیث بدون قید و شرط بوده و ایرادات راجع به تعهدات بانی در مقابل ضامن اثری بر اجرای تعهدات این قرارداد توسط ضامن ندارد و ضامن نمی‌تواند به عذر عدم تأمین وجوه کافی یا عدم پرداخت مبلغ کارمزد یا هر دلیل دیگری انجام تعهدات خود در این قرارداد را به تعویق انداخته یا معلق نماید».

در گزارش آتی به نقش "بازارگردان" از دیگر ارکان انتشار صکوک می‌پردازیم.

(منبع: <https://sukuk.ir>)

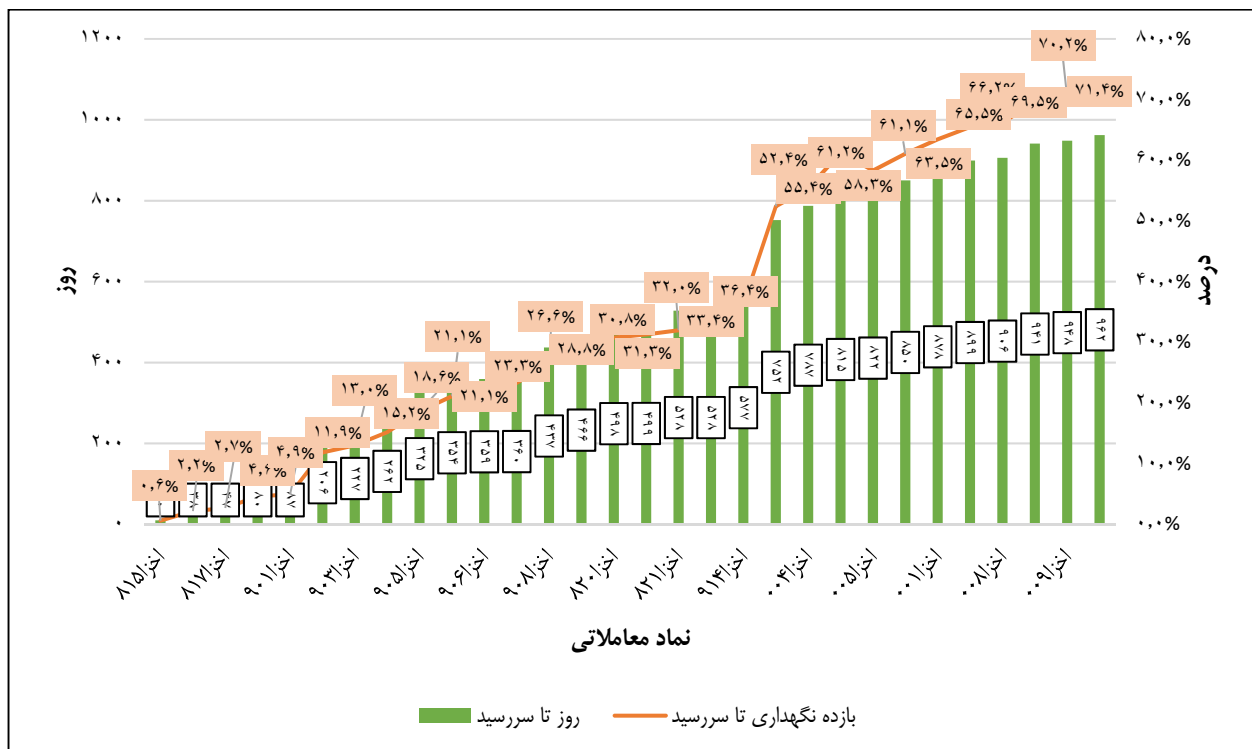
۸ فرصت‌های سرمایه‌گذاری در اسناد خزانه اسلامی دولت

۸,۱ نمودار مقایسه‌ای بازده تا سررسید انواع اسناد خزانه اسلامی نسبت به هفته گذشته



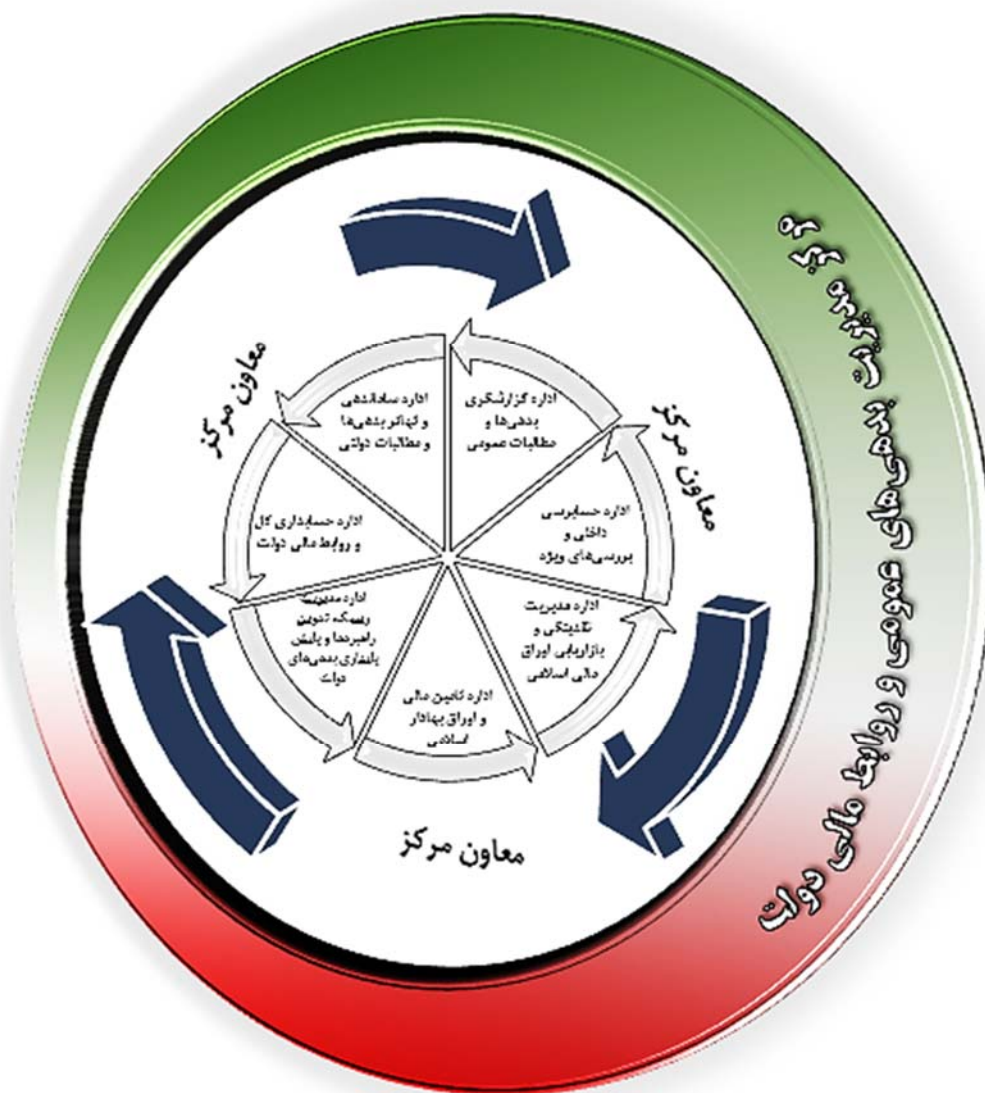
نمودار فوق، بازدهی تا سررسید (سالانه) انواع اسناد خزانه اسلامی در سررسیدهای مختلف را نشان می‌دهد. همانگونه که ملاحظه می‌شود، تحرکات محسوسی در بازده اسناد خزانه اسلامی کوتاه مدت و میان مدت مشاهده می‌شود.

۸,۲ نمودار مقایسه‌ای بازده نگهداری تا سررسید انواع اسناد خزانه اسلامی به تفکیک نماد معاملاتی



۸,۳ جدول بازده اسناد خزانه اسلامی دولت به تفکیک نماد معاملاتی

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخز۱۵	۹۹۳,۱۵۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۲۳,۲۵٪	۲۰,۹۸٪
اخز۱۶	۹۷۷,۸۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۲۲,۷۴٪	۲۰,۷۲٪
اخز۱۷	۹۷۳,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۲۲,۶۳٪	۲۰,۶۷٪
اخز۱۸	۹۵۵,۰۲۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۰۶/۱۴	۲۲,۷۴٪	۲۰,۹۶٪
اخز۱۱	۹۵۲,۳۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۰۶/۲۱	۲۲,۱۹٪	۲۰,۵۴٪
اخز۱۲	۸۹۳,۲۵۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۱۰/۱۹	۲۱,۹۱٪	۲۰,۹۷٪
اخز۱۳	۸۸۴,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۱۱/۱۰	۲۱,۷۲٪	۲۰,۹۲٪
اخز۱۴	۸۶۷,۵۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۱/۱۲/۱۵	۲۱,۷۲٪	۲۱,۱۲٪
اخز۱۵	۸۴۲,۱۹۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۲/۱۸	۲۱,۱۳٪	۲۰,۹۳٪
اخز۱۶	۸۲۵,۰۲۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۳/۱۶	۲۱,۸۰٪	۲۱,۷۵٪
اخز۱۷	۸۲۵,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۳/۲۱	۲۱,۴۷٪	۲۱,۴۵٪
اخز۱۸	۸۱۰,۳۰۰	۱۴۰۱/۰۱/۳۱	۱۴۰۲/۰۳/۲۲	۲۰,۱۶٪	۲۰,۴۴٪
اخز۱۹	۸۲۶,۵۴۰	۱۴۰۱/۰۱/۳۱	۱۴۰۲/۰۵/۲۸	۱۵,۳۸٪	۱۵,۷۶٪
اخز۲۰	۷۸۹,۵۱۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۶/۰۶	۲۱,۷۱٪	۲۲,۱۷٪
اخز۲۱	۷۷۶,۰۴۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۴	۱۴۰۲/۰۷/۰۴	۲۱,۸۱٪	۲۲,۴۶٪
اخز۲۲	۷۶۴,۱۲۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۸/۰۶	۲۱,۷۰٪	۲۲,۵۳٪
اخز۲۳	۷۶۱,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۸/۰۷	۲۲,۰۳٪	۲۲,۸۸٪
اخز۲۴	۷۵۷,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۹/۰۶	۲۱,۱۳٪	۲۲,۱۱٪
اخز۲۵	۷۴۸,۹۱۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۰۹/۰۶	۲۲,۰۳٪	۲۳,۰۹٪
اخز۲۶	۷۳۲,۳۷۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۲/۱۰/۲۵	۲۱,۷۰٪	۲۳,۰۴٪
اخز۲۷	۶۵۵,۶۱۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۴/۱۸	۲۲,۶۸٪	۲۵,۴۳٪
اخز۲۸	۶۴۳,۱۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۵/۲۲	۲۳٪	۲۵,۶۷٪
اخز۲۹	۶۱۹,۷۹۰	۱۴۰۱/۰۱/۲۰	۱۴۰۳/۰۶/۱۹	۲۱,۸۴٪	۲۵,۳۳٪
اخز۳۰	۶۳۱,۱۵۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۶/۲۶	۲۲,۶۱٪	۲۵,۸۹٪
اخز۳۱	۶۲۰,۳۸۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۷/۲۳	۲۲,۶۹٪	۲۶,۲۱٪
اخز۳۲	۶۱۱,۳۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۸/۲۱	۲۲,۶۵٪	۲۶,۳۷٪
اخز۳۳	۶۰۳,۸۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۹/۱۲	۲۲,۶۸٪	۲۶,۵۸٪
اخز۳۴	۶۰۱,۱۴۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۰۹/۱۹	۲۲,۷۰٪	۲۶,۶۷٪
اخز۳۵	۵۸۹,۴۸۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۱۰/۲۴	۲۲,۷۰٪	۲۶,۹۶٪
اخز۳۶	۵۸۷,۰۴۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۱۱/۰۱	۲۲,۷۱٪	۲۷,۰۳٪
اخز۳۷	۵۸۳,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۴۰۳/۱۱/۱۵	۲۲,۶۷٪	۲۷,۰۸٪



تهیه و تنظیم : اداره مدیریت ریسک، تدوین راهبردها و پایش پایداری بدهی‌های دولت



<https://iridmo.mefa.ir>



Riskmgn@mefa.gov.ir



<https://sokhan.mefa.ir/۸۰۸۲>