附件1：TF1703合约可交割国债和转换因子

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **国债全称** | **国债代码** | | | **票面利率（%）** | **到期日期** | **转换因子** |
| **银行间** | **上交所** | **深交所** |
| 1 | 2014年记账式附息（六期）国债 | 140006 | 019406 | 101406 | 4.33 | 20210403 | 1.0504 |
| 2 | 2016年记账式附息（七期）国债 | 160007 | 019535 | 101607 | 2.58 | 20210414 | 0.9841 |
| 3 | 2011年记账式附息（十五期）国债 | 110015 | 019115 | 101115 | 3.99 | 20210616 | 1.0392 |
| 4 | 2014年记账式附息（十三期）国债 | 140013 | 019413 | 101413 | 4.02 | 20210703 | 1.0407 |
| 5 | 2011年记账式附息（十九期）国债 | 110019 | 019119 | 101119 | 3.93 | 20210818 | 1.0382 |
| 6 | 2014年记账式附息（二十四期）国债 | 140024 | 019424 | 101424 | 3.70 | 20211023 | 1.0294 |
| 7 | 2006年记账式（十九期）国债 | 060019 | 010619 | 100619 | 3.27 | 20211115 | 1.0116 |
| 8 | 2011年记账式附息（二十四期）国债 | 110024 | 019124 | 101124 | 3.57 | 20211117 | 1.0246 |
| 9 | 2015年记账式附息（二期）国债 | 150002 | 019502 | 101502 | 3.36 | 20220122 | 1.0159 |
| 10 | 2012年记账式附息（四期）国债 | 120004 | 019204 | 101204 | 3.51 | 20220223 | 1.0231 |
| 11 | 2015年记账式附息（七期）国债 | 150007 | 019507 | 101507 | 3.54 | 20220416 | 1.0251 |
| 12 | 2012年记账式附息（九期）国债 | 120009 | 019209 | 101209 | 3.36 | 20220524 | 1.0171 |