附件1：TF1712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 | 2008年记账式（二期）国债 | 080002 | 019802 | 100802 | 4.16 | 20230228 | 1.0551 |
| 2 | 2012年记账式附息（九期）国债 | 120009 | 019209 | 101209 | 3.36 | 20220524 | 1.0148 |
| 3 | 2012年记账式附息（十五期）国债 | 120015 | 019215 | 101215 | 3.39 | 20220823 | 1.0168 |
| 4 | 2012年记账式附息（四期）国债 | 120004 | 019204 | 101204 | 3.51 | 20220223 | 1.0198 |
| 5 | 2013年记账式附息（五期）国债 | 130005 | 019305 | 101305 | 3.52 | 20230221 | 1.0247 |
| 6 | 2015年记账式附息（二期）国债 | 150002 | 019502 | 101502 | 3.36 | 20220122 | 1.0136 |
| 7 | 2015年记账式附息（二十六期）国债 | 150026 | 019526 | 101526 | 3.05 | 20221022 | 1.0022 |
| 8 | 2015年记账式附息（七期）国债 | 150007 | 019507 | 101507 | 3.54 | 20220416 | 1.0215 |
| 9 | 2015年记账式附息（十四期）国债 | 150014 | 019514 | 101514 | 3.30 | 20220709 | 1.0126 |
| 10 | 2017年记账式附息（一期）国债 | 170001 | 019555 | 101701 | 2.88 | 20220112 | 0.9954 |