附件2：T1703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（二十三期）国债 | 080023 | 019823 | 100823 | 3.62 | 20231127 | 1.0372 |
| 2 | 2009年记账式附息（十一期）国债 | 090011 | 019911 | 100911 | 3.69 | 20240611 | 1.0446 |
| 3 | 2014年记账式附息（十二期）国债 | 140012 | 019412 | 101412 | 4.00 | 20240619 | 1.0647 |
| 4 | 2014年记账式附息（二十九期）国债 | 140029 | 019429 | 101429 | 3.77 | 20241218 | 1.0529 |
| 5 | 2015年记账式附息（五期）国债 | 150005 | 019505 | 101505 | 3.64 | 20250409 | 1.0456 |
| 6 | 2005年记账式（四期）国债 | 050004 | 010504 | 100504 | 4.11 | 20250515 | 1.0798 |
| 7 | 2015年记账式附息（十六期）国债 | 150016 | 019516 | 101516 | 3.51 | 20250716 | 1.0373 |
| 8 | 2015年记账式附息（二十三期）国债 | 150023 | 019523 | 101523 | 2.99 | 20251015 | 0.9992 |
| 9 | 2016年记账式附息（四期）国债 | 160004 | 019532 | 101604 | 2.85 | 20260128 | 0.9884 |
| 10 | 2016年记账式附息（十期）国债 | 160010 | 019538 | 101610 | 2.90 | 20260505 | 0.9920 |
| 11 | 2006年记账式(九期)国债 | 060009 | 010609 | 100609 | 3.70 | 20260626 | 1.0561 |