附件1：TF1706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（十三期）国债 | 140013 | 019413 | 101413 | 4.02 | 20210703 | 1.0386 |
| 2 | 2016年记账式附息（十五期）国债 | 160015 | 019543 | 101615 | 2.65 | 20210714 | 0.9867 |
| 3 | 2011年记账式附息（十九期）国债 | 110019 | 019119 | 101119 | 3.93 | 20210818 | 1.0361 |
| 4 | 2014年记账式附息（二十四期）国债 | 140024 | 019424 | 101424 | 3.70 | 20211023 | 1.0279 |
| 5 | 2006年记账式（十九期）国债 | 060019 | 010619 | 100619 | 3.27 | 20211115 | 1.0111 |
| 6 | 2011年记账式附息（二十四期）国债 | 110024 | 019124 | 101124 | 3.57 | 20211117 | 1.0234 |
| 7 | 2015年记账式附息（二期）国债 | 150002 | 019502 | 101502 | 3.36 | 20220122 | 1.0151 |
| 8 | 2012年记账式附息（四期）国债 | 120004 | 019204 | 101204 | 3.51 | 20220223 | 1.0220 |
| 9 | 2015年记账式附息（七期）国债 | 150007 | 019507 | 101507 | 3.54 | 20220416 | 1.0239 |
| 10 | 2012年记账式附息（九期）国债 | 120009 | 019209 | 101209 | 3.36 | 20220524 | 1.0163 |
| 11 | 2015年记账式附息（十四期）国债 | 150014 | 019514 | 101514 | 3.30 | 20220709 | 1.0139 |
| 12 | 2012年记账式附息（十五期）国债 | 120015 | 019215 | 101215 | 3.39 | 20220823 | 1.0185 |