附件1：TF1612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 | 2016年记账式附息（二期）国债 | 160002 | 019530 | 101602 | 2.53 | 20210114 | 0.9822 |
| 2 | 2014年记账式附息（三期）国债 | 140003 | 019403 | 101403 | 4.44 | 20210116 | 1.0545 |
| 3 | 2011年记账式附息（二期）国债 | 110002 | 019102 | 101102 | 3.94 | 20210120 | 1.0359 |
| 4 | 2011年记账式附息（八期）国债 | 110008 | 019108 | 101108 | 3.83 | 20210317 | 1.0329 |
| 5 | 2014年记账式附息（六期）国债 | 140006 | 019406 | 101406 | 4.33 | 20210403 | 1.0532 |
| 6 | 2014年记账式附息（十三期）国债 | 140013 | 019413 | 101413 | 4.02 | 20210703 | 1.0429 |
| 7 | 2011年记账式附息（十九期）国债 | 110019 | 019119 | 101119 | 3.93 | 20210818 | 1.0402 |
| 8 | 2014年记账式附息（二十四期）国债 | 140024 | 019424 | 101424 | 3.70 | 20211023 | 1.0310 |
| 9 | 2006年记账式（十九期）国债 | 060019 | 010619 | 100619 | 3.27 | 20211115 | 1.0122 |
| 10 | 2011年记账式附息（二十四期）国债 | 110024 | 019124 | 101124 | 3.57 | 20211117 | 1.0259 |
| 11 | 2015年记账式附息（二期）国债 | 150002 | 019502 | 101502 | 3.36 | 20220122 | 1.0167 |
| 12 | 2012年记账式附息（四期）国债 | 120004 | 019204 | 101204 | 3.51 | 20220223 | 1.0242 |