附件2：T1706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（五期）国债 | 140005 | 019405 | 101405 | 4.42 | 20240320 | 1.0861 |
| 2 | 2014年记账式附息（二十一期）国债 | 140021 | 019421 | 101421 | 4.13 | 20240918 | 1.0731 |
| 3 | 2015年记账式附息（五期）国债 | 150005 | 019505 | 101505 | 3.64 | 20250409 | 1.0444 |
| 4 | 2005年记账式（四期）国债 | 050004 | 010504 | 100504 | 4.11 | 20250515 | 1.0777 |
| 5 | 2015年记账式附息（十六期）国债 | 150016 | 019516 | 101516 | 3.51 | 20250716 | 1.0363 |
| 6 | 2015年记账式附息（二十三期）国债 | 150023 | 019523 | 101523 | 2.99 | 20251015 | 0.9992 |
| 7 | 2016年记账式附息（四期）国债 | 160004 | 019532 | 101604 | 2.85 | 20260128 | 0.9887 |
| 8 | 2016年记账式附息（十期）国债 | 160010 | 019538 | 101610 | 2.90 | 20260505 | 0.9922 |
| 9 | 2016年记账式附息（十七期）国债 | 160017 | 019545 | 101617 | 2.74 | 20260804 | 0.9793 |
| 10 | 2007年记账式（十三期）国债 | 070013 | 010713 | 100713 | 4.52 | 20270816 | 1.1323 |