附件：TF1509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 | 2005年记账式（十二期）国债 | 050012 | 010512 | 100512 | 3.65 | 20201115 | 1.0309 |
| 2 | 2006年记账式（十九期）国债 | 060019 | 010619 | 100619 | 3.27 | 20211115 | 1.0151 |
| 3 | 2009年记账式附息（二十七期）国债 | 090027 | 019927 | 100927 | 3.68 | 20191105 | 1.0264 |
| 4 | 2010年记账式附息（二期）国债 | 100002 | 019002 | 101002 | 3.43 | 20200204 | 1.0176 |
| 5 | 2010年记账式附息（十二期）国债 | 100012 | 019012 | 101012 | 3.25 | 20200513 | 1.0108 |
| 6 | 2010年记账式附息（十九期）国债 | 100019 | 019019 | 101019 | 3.41 | 20200624 | 1.0180 |
| 7 | 2010年记账式附息（二十四期）国债 | 100024 | 019024 | 101024 | 3.28 | 20200805 | 1.0127 |
| 8 | 2010年记账式附息（三十四期）国债 | 100034 | 019034 | 101034 | 3.67 | 20201028 | 1.0314 |
| 9 | 2010年记账式附息（四十一期）国债 | 100041 | 019041 | 101041 | 3.77 | 20201216 | 1.0371 |
| 10 | 2011年记账式附息（二期）国债 | 110002 | 019102 | 101102 | 3.94 | 20210120 | 1.0460 |
| 11 | 2011年记账式附息（十五期）国债 | 110015 | 019115 | 101115 | 3.99 | 20210616 | 1.0519 |
| 12 | 2011年记账式附息（十九期）国债 | 110019 | 019119 | 101119 | 3.93 | 20210818 | 1.0501 |
| 13 | 2011年记账式附息（二十四期）国债 | 110024 | 019124 | 101124 | 3.57 | 20211117 | 1.0318 |
| 14 | 2012年记账式附息（四期）国债 | 120004 | 019204 | 101204 | 3.51 | 20220223 | 1.0295 |
| 15 | 2012年记账式附息（九期）国债 | 120009 | 019209 | 101209 | 3.36 | 20220524 | 1.0216 |
| 16 | 2012年记账式附息（十五期）国债 | 120015 | 019215 | 101215 | 3.39 | 20220823 | 1.0242 |
| 17 | 2013年记账式附息（三期）国债 | 130003 | 019303 | 101303 | 3.42 | 20200124 | 1.0167 |
| 18 | 2013年记账式附息（八期）国债 | 130008 | 019308 | 101308 | 3.29 | 20200418 | 1.0121 |
| 19 | 2013年记账式附息（十五期）国债 | 130015 | 019315 | 101315 | 3.46 | 20200711 | 1.0203 |
| 20 | 2013年记账式附息（二十期）国债 | 130020 | 019320 | 101320 | 4.07 | 20201017 | 1.0497 |
| 21 | 2014年记账式附息（三期）国债 | 140003 | 019403 | 101403 | 4.44 | 20210116 | 1.0699 |
| 22 | 2014年记账式附息（六期）国债 | 140006 | 019406 | 101406 | 4.33 | 20210403 | 1.0673 |
| 23 | 2014年记账式附息（十三期）国债 | 140013 | 019413 | 101413 | 4.02 | 20210703 | 1.0538 |
| 24 | 2014年记账式附息（二十四期）国债 | 140024 | 019424 | 101424 | 3.70 | 20211023 | 1.0384 |
| 25 | 2014年记账式附息（二十六期）国债 | 140026 | 019426 | 101426 | 3.53 | 20191030 | 1.0200 |