

附件 1

3 年期和 7 年期国开债标准债券远期实物交割合约要素表及可交割券信息

表 1 合约要素表

合约名称	3 年期、7 年期国开标债实物交割合约
合约期限	3 年期、7 年期
合约代码示例	CDB3_2506P 、CDB7_2506P
合约标的	票面利率为 3%的 3 年期、7 年期虚拟券
可交割券	按待偿期范围选取上海清算所托管的、固息、不含权的一篮子常规国开债券，至少 2 只
可交割券待偿期	3 年期合约为 [1.5, 3) 年 7 年期合约为 [5, 8) 年
单位报价量	1000 万/手
报价方式	百元净价
最小价格变动	0.005 元
合约月份	最近的 2 个季月
合约到期交割日	合约月份的第三个星期三
最后交易日	合约到期交割日前一个营业日
新合约上市日	业务上线日、旧合约交割日
交易时间	银行间市场交易日 9:00-12:00, 13:30-16:30
申报时间	滚动交割阶段：银行间市场工作日 8:30-16:30
	最后交易日：买方可在 8:30-12:00 提出交割申报，卖方可在 8:30-16:30 提出交割申报
交割方式	实物交割

到期交割价	<p>采取滚动交割方式。</p> <p>最后交易日前，交割价等于每日结算价；</p> <p>最后交易日，交割价等于当日加权平均价。</p>
-------	---

表 2 可交割券信息

合约代码	可交割券债券简称	转换因子
CDB3_2506P	24 国开清发 02	0.9824
	24 国开清发 03	0.9742
CDB7_2506P	24 国开清发 01	0.9816
	23 国开清发 02	0.9865
	23 国开清发 01	0.9944