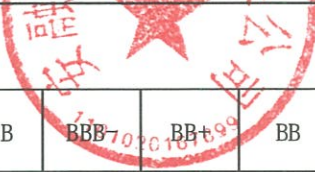


金融债发行主体主动评级各级别等级迁移及违约率矩阵

表1 金融债发行主体1年期迁移/违约率矩阵(%)



期初信用等级 (2020年)		期末信用等级 (2021年)											期间评级情形 (2020年-2021年)				
信用等级	存续评 级数量	AAA	AA+	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB+	BB	存续	违约	兑付	终止 (其他)
AAA	0	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
AA+	2	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
AA	11	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
AA-	2	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
A+	2	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
A	1	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
A-	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
合计	18																

注：公司无3年期、5年期、10年期存续金融债券。

非金融企业债务融资工具发行主体主动评级各级别等级迁移及违约率矩阵

表3 非金融企业债务融资工具发行主体1年期迁移/违约率矩阵(%)

期初信用等级 (2020年)		期末信用等级 (2021年)											期间评级情形 (2020年-2021年)				
信用等级	存续评级数量	AAA	AA+	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB+	BB	存续	违约	兑付	终止 (其他)
AAA	0	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
AA+	1	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		100.00	
AA	13	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	76.92		23.08	
AA-	10	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
A+	0	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
A	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
A-	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
合计	24																

表4 非金融企业债务融资工具发行主体3年期迁移/违约率矩阵(%)

期初信用等级 (2018年)		期末信用等级 (2021年)											期间评级情形 (2018年-2021年)				
信用等级	存续评级数量	AAA	AA+	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB+	BB	存续	违约	兑付	终止 (其他)
AAA	0	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
AA+	2	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	50.00		50.00	
AA	8	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	87.50		12.50	
AA-	3	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	66.67		33.33	
A+	1	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00			
A	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
A-	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
合计	14																

注：公司无5年期、10年期存续债券。