

版本号：V4.0.202208

证券公司主体信用评级方法



2022年8月

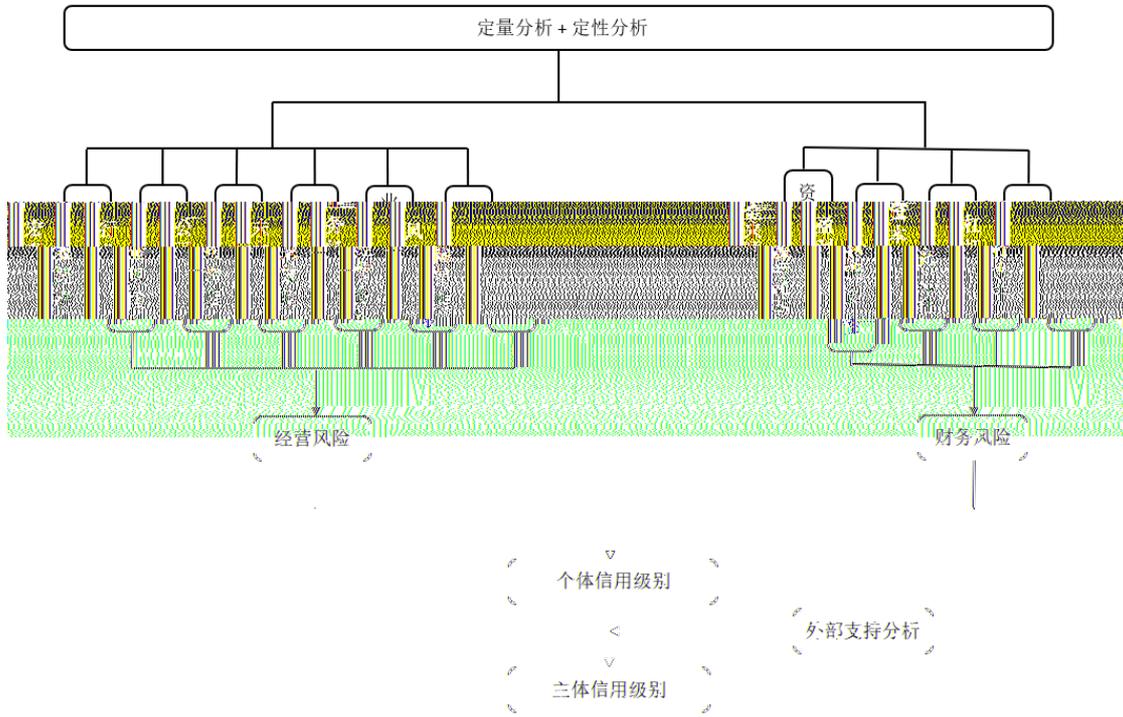
证券公司主体信用评级方法

一、修订说明

(“ ”) ,

, ,

1



五、评级方法局限性

，

，

。

。

，

，

； — ，

，

，

— ，

； — ，

，

，

，

，

，

— ，

，

。

，

，

。

、

、

: / 100%;

。

3.

,

。

;

,

，

。

()

， ， 一

， 。

， 、 、

，

： (1) 、

， ； (2)

； (3) ， ； (4) 一

， ； (5) 、 、

， / ，

； (6) 。

， 、 、

、 。

，

： (1) 、 ；

(2) 、 ， ； (3)

，

； (4) 一 ； (5)

。

1-1

，
 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC、C。 AAA 、CCC ()
 ， - + - ，
 ，
 ，
 。

AAA	，
AA	，
A	，
BBB	— ， —
BB	，
B	，
CCC	，
CC	，
C	

1-2

—
 、 、 、 。

	，
	，
	，
	， 、

2

	$(1) 2 \quad : \quad = (\quad - \quad) / \quad 100\%$
	$(2) \quad : \quad = (\quad / \quad) (1/(-1)) -1 \quad 100\%$
	-
	-
	-