

| 2024年08 月21日非金融企业债务融资工具定价估值 |      |      |      |      |      |      |      |      |
|-----------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|
|                             | 1年   | 3年   | 5年   | 7年   | 10年  | 15年  | 20年  | 30年  |
| 重点AAA                       | 2.09 | 2.27 | 2.46 | 2.56 | 2.66 | 2.76 | 2.83 | 2.9  |
| AAA                         | 2.15 | 2.36 | 2.57 | 2.68 | 2.79 | 2.91 | 3.17 | 3.24 |
| AA+                         | 2.32 | 2.6  | 2.77 | 2.94 | 3.09 | 3.24 | 3.82 | 4    |
| AA                          | 2.52 | 2.83 | 3.04 | 3.24 | 3.43 | 4.16 | 4.49 | 4.65 |
| AA-                         | 3.56 | 4.05 | 4.28 | 4.93 | 5.75 | 6.07 | 6.43 | 6.38 |

2024年08月21 各估值机构原始报价数据

|      | C1   |      |      |      |      | C2   |      |      |      |      | C3   |      |      |      |      | C4   |      |      |      |      | C5   |      |      |      |      |
|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
|      | 票面利率 | 报价   | 报价1  | 报价2  | 报价3  | 票面利率 | 报价   | 报价1  | 报价2  | 报价3  | 票面利率 | 报价   | 报价1  | 报价2  | 报价3  | 票面利率 | 报价   | 报价1  | 报价2  | 报价3  | 票面利率 | 报价   | 报价1  | 报价2  | 报价3  |
| 工商银行 | 4.24 | 4.22 | 4.45 | 5.22 | 4.22 | 4.24 | 4.45 | 5.24 | 5.72 | 7.24 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.24 | 4.42 | 5.24 | 5.45 | 4.24 | 5.24 | 5.24 | 5.22 | 4.42 | 4.42 | 4.22 |
| 建设银行 | 4.22 | 4.21 | 4.72 | 5.22 | 4.24 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 5.42 | 7.22 | 4.72 | 4.42 | 5.42 | 5.42 | 7.22 | 4.42 | 5.22 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 农业银行 | 4.24 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.22 | 4.24 | 4.45 | 5.24 | 5.72 | 7.24 | 4.72 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.42 | 4.42 | 5.22 | 5.42 | 4.24 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 中国银行 | 4.24 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.22 | 4.24 | 4.45 | 5.24 | 5.72 | 7.24 | 4.72 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.42 | 4.42 | 5.22 | 5.42 | 4.24 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 交通银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 招商银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 浦发银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 中信银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 民生银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 兴业银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 光大银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 华夏银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 平安银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 浙商银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 渤海银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 江苏银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 浙江银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 上海银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 上海银行 | 4.24 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 5.72 | 7.24 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.42 | 4.42 | 5.22 | 5.42 | 4.24 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |
| 北京银行 | 4.22 | 4.22 | 4.45 | 5.24 | 4.24 | 4.24 | 4.45 | 5.22 | 5.45 | 7.22 | 4.45 | 4.42 | 5.42 | 5.47 | 7.22 | 4.42 | 5.24 | 5.42 | 4.22 | 5.22 | 5.22 | 5.22 | 4.22 | 4.22 | 4.22 |