

Отчет об оценке вероятности дефолта компании ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ "НЕИЗВЕСТНАЯ КОМПАНИЯ"

Общая информация о компании и результаты моделирования

Краткая справка

Полное наименование компании	ОБЩЕСТВО С НЕОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ "НЕИЗВЕСТНАЯ КОМПАНИЯ"
ИНН	XXXXXXXXXX
ОГРН	1XXXXXXXXXX
Дата регистрации компании	07.10.2007
Срок деятельности, лет	12
Основной код ОКВЭД	007
Расшифровка основного кода ОКВЭД	Непонятная деятельность
Количество кодов ОКВЭД	52
Организационно-правовая форма	Общество с неограниченной ответственностью
Регион регистрации	«Š†»;
Количество работников	1001 - 5000
Уставной капитал, руб	100 000
ФИО руководителя	Бесфамильный Аноним Имярекович
Должность руководителя	генеральный директор
Электронная почта	
Адрес в сети Интернет	
Регистрация в реестре МСП	Нет

Результаты оценки вероятности дефолта компании на годовом горизонте

Дата оценки	16.12.2019
Базовая вероятность дефолта компании	0.54%
Коэффициент регионально-отраслевой корректировки	1.39
Вероятность дефолта компании с учетом регионально-отраслевой корректировки	0.75%

Информация о компании

Факторы риска

➤ У компании есть незавершенные исполнительные производства (база ФССП)

Информация о владельцах

По данным ЕГРЮЛ

Наименование владельца	ИНН владельца	ОГРН владельца	Адрес владельца	Доля в уставном капитале	Страна
ГРУППА КОМПАНИЙ, ООО	7XXXXXXXXX	1XXXXXXXXX	г. Москва, ул. Мира, д. 4 стр. 1	100%	Российская Федерация

Информация о дочерних компаниях

По данным ЕГРЮЛ

Наименование дочерней компании	ИНН дочерней компании	ОГРН дочерней компании	Адрес дочерней компании	Доля в уставном капитале
Компания-1	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Амурская обл., г. Тында, ул. Школьная, д. 8А	100.0%
ЗАСТРОЙ, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	г. Москва, Михайлово-Ярцевское поселение, пос. Шишкин Лес стр.32-В этаж 2 ком. 3	50.0%
ТXXXXXXXXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	г. Москва, Михайлово-Ярцевское поселение, пос. Шишкин Лес стр. 22-В этаж 12	50.0%
ЖXXXXXXXXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Свердловская обл, г. Екатеринбург, ул. Ковыльная, д. 56	49.0%
СXXXXXXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Иркутская обл, г. Иркутск, ул. Розы Люксембург, д. 111 офис 45	49.0%
СXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Свердловская обл, г. Екатеринбург, ул. Лобкова, д. 443 офис 699	49.0%
СXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Хабаровский кр, г. Хабаровск, ул. Локомотивная, д. 18 офис 111	49.0%
ТXXXXXXXXXXXXXXXXXX, ООО	XXXXXXXXXX	XXXXXXXXXX	Красноярский кр., г. Красноярск, ул. Авиаторов, д. 19 каб. 506	49.0%

Информация об исполнительных производствах с начала деятельности

Всего исполнительных производств	48
Сумма по всем исполнительным производствам, руб.	687 651,7
Количество исполнительных производств, связанных с оплатой труда	0
Сумма по исполнительным производствам, связанным с оплатой труда, руб.	0,0
Количество исполнительных производств, связанных с оплатой налогов, включая пени	0
Сумма по исполнительным производствам, связанным с оплатой налогов, включая пени, руб.	0,0
Количество исполнительных производств, связанных с кредитными платежами	0
Сумма по исполнительным производствам, связанным с кредитными платежами, руб.	0,0
Наиболее частый тип исполнительных производств	Штраф ГИБДД

Информация о контрактах по Ф3-44

Год	2015
Допущено до закупок	1
Не допущено до закупок	0
Выиграно контрактов	0
Заключено контрактов	0
Общая сумма контрактов, тыс. руб.	0,0

Информация о контрактах по Ф3-223

Год	2017	2018	2019
Допущено до закупок	125	146	2
Не допущено до закупок	1	1	0
Выиграно контрактов	75	101	2
Заключено контрактов	58	56	11
Общая сумма контрактов, тыс. руб.	8 431 896,5	51 154 929,6	33 686 970,3

Системы налогообложения, отличные от ОСНО

Упрощенная система налогообложения	Нет
Единый налог на вмененный доход	Нет
Единый сельскохозяйственный налог	Нет

Финансовая информация

□ Бухгалтерский баланс, в тыс. руб.

Наименование статьи	Код строки	2014	2015	2016	2017	2018
Актив						
Внеоборотные активы	1100	6 879	102 574	89 901	186 654	840 813
Основные средства	1150	6 879	102 574	89 440	186 097	587 260
Долгосрочные финансовые вложения	1170				103	250 118
Отложенные налоговые активы	1180			461	454	3 435
Оборотные активы	1200	1 411 318	7 558 830	4 406 593	7 839 561	21 995 791
Запасы	1210	65 168	60 539	311 869	786 860	3 194 270
НДС по приобретенным ценностям	1220	470	6 549	21	3 986	70 885
Дебиторская задолженность	1230	1 143 168	7 172 223	3 548 953	6 560 946	14 506 634
Краткосрочные финансовые вложения	1240	197 630	148 523	284 766	295 392	0,0
Денежные средства и денежные эквиваленты	1250	2 031	167 872	258 339	187 396	4 218 782
Прочие оборотные активы	1260	2 852	3 124	2 645	4 981	5 220
Активы всего	1600	1 418 197	7 661 404	4 496 494	8 026 215	22 836 604
Пассив						
Капитал и резервы	1300	58 634	79 615	93 359	650 236	1 232 256
Уставный капитал	1310				100	100
Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)	1370	58 534	79 515	93 259	650 136	1 232 156
Долгосрочные обязательства	1400	30	504		1 440	21 266
Отложенные налоговые обязательства	1420	30	504		1 440	21 266
Краткосрочные обязательства	1500	1 359 533	7 581 285	4 403 135	7 374 539	21 583 081
Заёмные средства (краткосрочные)	1510	332 890	380 673	1 044 750	1 260 185	2 422 324
Кредиторская задолженность	1520	1 023 975	7 178 068	3 325 224	5 953 200	19 057 200
Пассивы всего	1700	1 418 197	7 661 404	4 496 494	8 026 215	22 836 604

□ Отчет о финансовых результатах, в тыс. руб.

Наименование статьи	Код строки	2014	2015	2016	2017	2018
Доходы и расходы по обычным видам деятельности						
Выручка	2110	1 105 346	9 154 405	4 800 297	14 166 729	29 002 828
Себестоимость продаж	2120	969 167	8 837 877	4 230 742	12 183 053	25 049 844
Валовая прибыль (убыток)	2100	136 179	316 528	569 555	1 983 676	3 952 984
Коммерческие расходы	2210		2 395	542	0,0	75
Управленческие расходы	2220	38 778	261 453	364 690	769 931	806 441
Прибыль (убыток) от продажи	2200	97 401	52 680	204 323	1 213 745	3 146 468
Операционные доходы и расходы						
Доходы от участия в других организациях	2310				0,0	116 522
Проценты к получению	2320	844	15 292	56 395	18 839	14 590
Проценты к уплате	2330	13 157	47 783	56 226	127 272	231 445
Прочие доходы	2340		167 182	24 042	47 011	13 034
Прочие расходы	2350	12 002	160 781	172 816	194 723	282 759
Прибыль (убыток) до налогообложения	2300	73 086	26 590	55 718	957 600	2 776 410
Текущий налог на прибыль	2410	14 721	5 035	21 958	197 685	564 858
Чистая прибыль (убыток)	2400	58 328	20 981	34 725	758 467	2 194 706

□ Отчет о движении денежных средств, в тыс.руб.

Наименование статьи	Код строки	2014	2015	2016	2017	2018
Денежные потоки от текущих операций						
Поступления от текущих операций	4110		4 328 280	7 963 977	11 305 467	30 183 326
Поступления от продаж	4111		4 136 361	7 796 875	11 305 024	30 136 219
Прочие поступления от текущих операций	4119					215
Платежи по текущим операциям	4120		4 162 677	8 188 672	11 343 557	25 848 945

Платежи поставщикам и подрядчикам	4121		3 468 373	7 433 516	9 432 402	23 168 140
Оплата труда	4122		440 023	407 133	1 294 532	1 838 299
Оплата процентов по долговым обязательствам	4123			11 156	64 790	160 870
Налог на прибыль	4124		17 576	11 977	94 899	593 905
Прочие платежи по текущим операциям	4129					87 731
Сальдо денежных потоков от текущих операций	4100		165 603	-224 695	-38 090	4 334 381
Денежные потоки от инвестиционных операций						
Поступления от инвестиционных операций	4210		12 193	51 203	14 837	312 590
Поступления от возврата займов, продажи долговых ценных бумаг	4213					295 587
Получение дивидендов, процентов	4214		12 193	51 203	14 837	17 003
Платежи по инвестиционным операциям	4220		11 826	14 516	130 681	608 009
Приобретение внеоборотных активов	4221		11 826	11 516	130 578	357 989
Приобретение акций (долей участия)	4222				103	250 020
Приобретение долговых ценных бумаг, предоставление займов	4223			3 000		
Сальдо денежных потоков от инвестиционных операций	4200		367	36 687	-115 844	-295 419
Денежные потоки от финансовых операций						
Поступления от финансовых операций	4310		420	301 270	5 090 121	13 223 148
Получение кредитов и займов	4311			300 000	5 090 121	13 223 148
Платежи по финансовым операциям	4320		549	22 795	5 007 130	13 230 724
Выплата дивидендов	4322			20 981	70 000	1 099 140
Погашение векселей, возврат кредитов и займов	4323			200	4 937 130	12 131 584
Сальдо денежных потоков от финансовых операций	4300		-129	278 475	82 991	-7 576
Сальдо денежных потоков за отчетный период	4400		165 841	90 467	-70 943	4 031 386

Модель оценки вероятности дефолта компании

□ Общие характеристики модели

Тип модели	Логистическая регрессия
Коэффициент L1-регуляризации	2
Коэффициент L2-регуляризации	0

□ Параметры компании, используемые моделью, и веса параметров в модели

Наименование параметра	Значение параметра	Вес параметра в модели
Доля выигранных тендеров по государственным закупкам	69.2%	-0.012
Отношение суммы всех исполнительных производств, возбужденных в течение предшествовавшего года, к выручке	0.0%	0.176
Наличие исполнительных производств по взысканию задолженности по налогам и по заработной плате, возбужденных в течение предшествовавшего года	0	1.451
Количество возбужденных исполнительных производств по взысканию задолженности по налогам	0	0.007
Существенные факторы риска	0	0.6
Критические факторы риска	0	0.587
Соотношение обязательств с прибылью от продаж за год	82.4%	0.022
Соотношение процентов к уплате с прибылью от продаж за год	0.08	0.202
Коэффициент автономии	0.059	-1.136
Покрытие обязательств денежным потоком от операционной деятельности за год	10.8%	-0.288
Соотношение процентных платежей по долговым обязательствам и денежного потока от операционной деятельности за год	6.9%	0.021
Коэффициент текущей ликвидности	1.028	-0.078
Покрытие краткосрочных обязательств ликвидными активами	0.868	-0.286
Покрытие обязательств оборотными активами	1.018	0.101
Рентабельность активов по чистой прибыли за год	13.8%	-0.89
Рентабельность продаж по чистой прибыли за год	8.1%	-0.197
Динамика заемных средств за год	92.2%	-0.091
Динамика выручки за год	104.7%	-0.437
Отношение прочих расходов к выручке	1.0%	0.533
Отношение прочих доходов к выручке	0.0%	-0.02

Оценки вероятности дефолта компании и вероятности дефолта по кредиту осуществляются при помощи моделей машинного обучения. Исходные данные для моделирования извлекаются преимущественно из открытых источников, включая систему СПАРК-Интерфакс, базу арбитражных дел, Федеральный реестр юридически значимых сведений о деятельности юридических лиц, данные и реестры Федеральной налоговой службы, данные и реестры Федеральной службы судебных приставов, статистику и прогнозы Банка России. Модель построена на основе набора параметров, рассчитанных по публичным данным, и массива обезличенных данных об обслуживании банковских кредитов юридическими лицами, который имеется в распоряжении Рейтингового агентства «Эксперт РА». Данные указанного массива не подлежат раскрытию каким-либо лицам, включая заказчика оценки вероятности дефолта. Структура модели допускает корректировки результатов применительно к отдельным компаниям, видам компаний, отраслям и регионам. Индивидуальные корректировки, в первую очередь,

могут применяться к крупным публичным компаниям и отражать влияние не формализованных в качестве параметров модели факторов на деятельность компаний. К таким факторам, в частности, относятся публичные кредитные рейтинги. Корректировка вероятности дефолта в соответствии с вероятностью дефолта, сопоставленной присвоенному компании кредитному рейтингу, является правом или возможностью, а не обязанностью или универсальным правилом. В связи с этим допускается существенное отклонение оценок вероятности дефолта от тех величин, которые могут быть сопоставлены присвоенным компаниям кредитным рейтингам. Оценка вероятности дефолта при помощи моделей машинного обучения по своим правилам и результатам может быть не сопоставима с рейтинговым анализом, который осуществляется с учетом непубличных данных, а также, как правило, допускает большую степень возможного влияния экспертного суждения на результат оценки. Оценки вероятности дефолта компании и вероятности дефолта по кредиту осуществляются на годовом горизонте. Их экстраполяция на другие временные горизонты по умолчанию не предусмотрена. Отчет об оценке вероятности дефолта содержит широкий перечень параметров компании и параметров кредита (при наличии), в том числе справочную информацию, которая непосредственно не используется для формирования набора переменных, используемых алгоритмами, и (или) корректировок полученных оценок. Все представленные в отчете параметры компании получены на основе данных из открытых источников. Представленные в отчете параметры кредитов рассчитаны на основе данных, предоставленных заказчиком, и не подлежат раскрытию третьим лицам. Проверка достоверности предоставленных заказчиком данных, как правило, не осуществляется, не считая простых логических проверок входных данных.