

Исторические данные об уровнях дефолта по рейтинговым категориям рейтинговых шкал, применяемых обществом с ограниченной ответственностью «Национальные Кредитные Рейтинги» (далее – «НКР»), за период с 01.01.2023 г. по 31.12.2023 г.

Таблица 1. Национальная рейтинговая шкала для Российской Федерации

Рейтинговая категория	Уровень кредитного рейтинга	Количество объектов рейтинга, в отношении которых раскрываются исторические данные, на 01.01.23		Количество дефолтов объектов рейтинга в течение 2023 года	
		всего	за вычетом долговых обязательств, кредитные рейтинги которых совпадают с кредитным рейтингом их эмитента	всего	за вычетом долговых обязательств, кредитные рейтинги которых совпадают с кредитным рейтингом их эмитента
AAA	AAA.ru	15	7	0	0
AA	AA+.ru	2	2	0	0
	AA.ru	2	2	0	0
	AA-.ru	4	4	0	0
A	A+.ru	6	6	0	0
	A.ru	8	6	0	0
	A-.ru	12	12	0	0
BBB	BBB+.ru	4	4	0	0
	BBB.ru	4	4	0	0
	BBB-.ru	6	6	0	0
BB	BB+.ru	2	2	0	0
	BB.ru	3	3	0	0
	BB-.ru	3	3	0	0
B	B+.ru	5	5	0	0
	B.ru	1	1	0	0
	B-.ru	0	0	0	0
CCC	CCC.ru	0	0	0	0
CC	CC.ru	0	0	0	0
C	C.ru	0	0	0	0
D	D	0	0	не применимо, так как категория по определению включает только дефолтные объекты	

Методологии НКР предусматривают возможность присвоения кредитных рейтингов по международной рейтинговой шкале и национальной рейтинговой шкале для обязательств специализированного финансирования в рейтинговой деятельности. За отчётный период указанные шкалы не применялись.

Информация за 2019–2023 годы в отношении применяемой национальной рейтинговой шкалы для Российской Федерации

Информация представлена в двух таблицах (2 и 3).

Таблица 2. Количество объектов рейтинга (годовые срезы)

Количество объектов рейтинга (за вычетом долговых обязательств, кредитные рейтинги которых совпадают с кредитным рейтингом их эмитента¹), имевших кредитный рейтинг НКР на 1 января каждого из лет после 12.09.2019 г. (дата включения НКР в реестр кредитных рейтинговых агентств).

Рейтинговая категория	Уровень кредитного рейтинга	01.01.20	01.01.21	01.01.22	01.01.23	Всего
AAA	AAA.ru	0	2	6	7	15
AA	AA+.ru	0	1	3	2	6
	AA.ru	0	2	1	2	5
	AA-.ru	1	2	4	4	11
A	A+.ru	0	4	5	6	15
	A.ru	0	4	5	6	15
	A-.ru	0	5	10	12	27
BBB	BBB+.ru	0	1	2	4	7
	BBB.ru	0	0	4	4	8
	BBB-.ru	0	7	8	6	21
BB	BB+.ru	0	1	1	2	4
	BB.ru	0	0	2	3	5
	BB-.ru	0	0	0	3	3
B	B+.ru	0	2	5	5	12
	B.ru	0	2	1	1	4
	B-.ru	0	1	0	0	1
CCC	CCC.ru	0	0	0	0	0
CC	CC.ru	0	0	0	0	0
C	C.ru	0	0	0	0	0
D	D	0	0	0	0	0
Всего		1	34	57	67	159

¹ С целью избежать ситуации, когда одно рейтингуемое лицо с большим числом отрейтингованных выпусков старших необеспеченных долговых обязательств будет оказывать сильное влияние на частоту дефолтов для определённого уровня кредитного рейтинга.

Таблица 3. Количество дефолтов объектов рейтинга на горизонте 1 года

Количество дефолтов объектов рейтинга, приведённых в таблице выше, на горизонте 1 (одного) года после отчётной даты, выявленных на дату раскрытия данной информации.

Рейтинговая категория	Уровень кредитного рейтинга	2020	2021	2022	2023	Всего
AAA	AAA.ru	0	0	0	0	0
AA	AA+.ru	0	0	0	0	0
	AA.ru	0	0	0	0	0
	AA-.ru	0	0	0	0	0
A	A+.ru	0	0	0	0	0
	A.ru	0	0	0	0	0
	A-.ru	0	0	0	0	0
BBB	BBB+.ru	0	0	0	0	0
	BBB.ru	0	0	0	0	0
	BBB-.ru	0	0	0	0	0
BB	BB+.ru	0	0	0	0	0
	BB.ru	0	0	0	0	0
	BB-.ru	0	0	0	0	0
B	B+.ru	0	0	1	0	1
	B.ru	0	1	0	0	1
	B-.ru	0	0	0	0	0
CCC	CCC.ru	0	0	0	0	0
CC	CC.ru	0	0	0	0	0
C	C.ru	0	0	0	0	0
D	D	0	0	0	0	0
Всего		0	1	1	0	2