

An aerial photograph of a modern city skyline at sunset or sunrise. The sky is a mix of orange, yellow, and blue. In the foreground, several tall, dark skyscrapers stand prominently, their windows reflecting the low sun. A river or canal winds through the city on the left. The rest of the city is a dense grid of smaller buildings, fading into the distance. A large, solid red rectangular box is overlaid on the right side of the image, containing white text.

Детализация расчета
требований по
обеспечению под стресс
(ОПС) на фондовом и
валютном рынке в
Клиринговом терминале

ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ

ЦЕЛЬ: Детализация размера Обеспечения под стресс (далее ОПС), основанного на оценке потенциальных потерь Участника клиринга при реализации возможных стресс-сценариев, позволит Участникам клиринга эффективнее и быстрее выявлять причины изменения требований к ОПС.

- ДЕТАЛИ:**
- Разработан шаблон детализации требований ОПС по Фондовому и Валютному рынку, который включает в себя две таблицы:
 - Детализацию позиций и возможных потерь под стресс в разрезе расчетного кода, риск-группы и инструментов на текущую дату по Фондовому рынку.
 - Детализацию позиций и возможных потерь под стресс в разрезе расчетного кода, риск-группы и инструментов на текущую дату по Валютному рынку.
 - Отражение отчета реализовано в Клиринговом терминале.
 - Данные обновляются по завершению публикации требований ОПС (около 10:00).
 - Методика определения размера обеспечения под стресс размещена на сайте по ссылке: [Методика размере ОПС](#).

ОПИСАНИЕ ПРЕДСТАВЛЕНИЯ ДАННЫХ

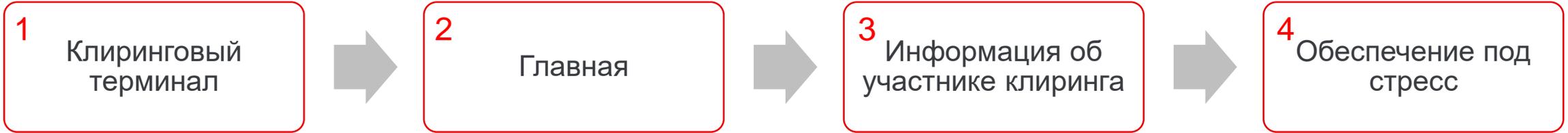
Расчет ExcessRisk на каждом из рынков на уровне Участника определяет потенциальные потери в случае реализации стрессовых сценариев, которые не покрыты/частично покрыты Обеспечением.

Рынок	Дата расчета	Расчетный код	Риск-группа	Потенциальные потери (руб.)	Сценарий ОПС	Требования к обеспечению (руб.)	Инструмент	Позиция под риском (руб.)	Позиция (руб.)	Обеспечение и депозиты (руб.)	Влияние портфеля	Сценарий роста	Сценарий падения
EQ	27.05.25	OWN	ALL_OFZ	300 (3181*0,11-50)	DownDown	50	-						
EQ	27.05.25	12345	ALL_OFZ	600 (10000*0,07-100)	DownDown	100	-						
EQ	27.05.25	OWN	ALL_OFZ				SU26207RMFS9	3181	3181	5000	N	0,11	0,11
EQ	27.05.25	12345	ALL_OFZ				SU26221RMFS0	10000	10000	16000	N	0,07	0,07
EQ	27.05.25	12345	ALL_OFZ				SU26207RMFS9	0	-600	10000	N	0,11	0,11

Описание параметров:

Наименование	Описание	Влияние
Позиция (руб.)	Позиция участника в инструменте	Влияет на Позицию под риском с учетом Обеспечения и депозитов
Обеспечение и депозиты (руб.)	Обеспечение и депозиты участника в инструменте	Влияет на Позицию под риском
Позиция под риском (руб.)	Позиция участника в инструменте с риском	Входит в расчет Потенциальных потерь с учетом применяемых сценарных ставок риска под стресс
Сценарий роста /Сценарий падения	Ставки стрессовых сценариев, с учетом рисков концентрации, ставок ОПС, межпродуктовых спредов	Входит в расчет Потенциальных потерь
Сценарий ОПС	Отражает наихудший сценарий из 4-х возможных для расчета Потенциальных потерь	Влияет на Потенциальные потери
Требования к обеспечению (руб.)	Обеспечение (учитывает ставки риска и риски концентрации) на уровне расчетного кода и риск-группы	Влияет на Потенциальные потери
Потенциальные потери (руб.)	Потенциальные потери в случае реализации стрессовых сценариев по риск-группе инструментов	
Расчетный код	Представляет собой Расчетный код в случае клиентских кодов, и группировку «OWN» всех собственных Расчетных кодов участника.	
Влияние профиля	Подсвечивает, что позиция возможно будет отражена с учетом влияния переведенного профиля по счетам Единого пула	

ОТРАЖЕНИЕ В КЛИРИНГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ



The screenshot displays the MOEX National Clearing Center interface. At the top left is the MOEX logo and the text "НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР" with language options "eng | рус". Navigation tabs include "ПЕРЕВОДЫ", "РАСЧЁТНЫЕ КОДЫ", "СЧЕТА", "ДОКУМЕНТЫ", and "СПРАВОЧНИКИ". The main content area is titled "ИНФОРМАЦИЯ ОБ УЧАСТНИКЕ КЛИРИНГА" and includes sub-tabs: "Общая информация", "Пользователи", "Подписанные документы", "Обеспечение под стресс", and "Закреть форму". The "Обеспечение под стресс" tab is highlighted with a red box and a red number 4. Above it, a dropdown menu shows "ООО 'Тестовая фирма'" with a red box and a red number 3. Other elements include "Уникод: 0111100000", "Test-Test03", "Профиль СКЗИ: ГОСТ 2024_GOST_Firm11u1", and a date "19.01.2026".

ОТРАЖЕНИЕ В КЛИРИНГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ

Возможности работы с таблицей «Обеспечение под стресс»:

- Выгрузка данных в PDF, CSV.
- Сортировка и фильтрация по столбцам «Риск-группа», «Сценарий ОПС», «Инструмент».

ИНФОРМАЦИЯ ОБ УЧАСТНИКЕ КЛИРИНГА

Общая информация | Пользователи | Подписанные документы | **Обеспечение под стресс** | [Заккрыть форму](#)

[Детализация ОПС по ФР](#) | **Детализация ОПС по ВР**

+ Поиск [Обновить](#) [Выгрузить](#)

Информация по состоянию на 12:49:12 16.01.2026

ДАТА РАСЧЕТА	ЛИКВИДАЦИОННЫЙ РЕГИСТР	РИСК-ГРУППА	ПОТЕНЦИАЛЬНЫЕ ПОТЕРИ (РУБ.)	СЦЕНАРИЙ ОПС	ТРЕБОВАНИЯ К ОБЕСПЕЧЕНИЮ (РУБ.)	ИНСТРУМЕНТ	ПОЗИЦИЯ ПОД РИСКОМ (РУБ.)	ПОЗИЦИЯ (РУБ.)	ОБЕСПЕЧЕНИЕ И ДЕПОЗИТЫ (РУБ.)
16.01.2026	12345	RG_RU000A102E52	—		—	RU000A102E52	0.00	0.00	110185591.43
16.01.2026	12345	RG_RU000A109312	—		—	RU000A109312	0.00	0.00	2102039.20
16.01.2026	12345	RG_RU000A10BQR6	—		—	RU000A10BQR6	0.00	0.00	74468942.08
16.01.2026	12345	ALL_OFZ	—		—	SU26251RMFS7	0.00	-923927169.79	923927169.79