

### Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.04.2021 г.

Компоненты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	Исполнение
Прямое стресс-тестирование	<b>выполнено</b>
Обратное стресс-тестирование	<b>выполнено</b>
Анализ чувствительности результатов стресс-тестирования к изменению риск-факторов	<b>выполнено</b>
Мониторинг актуальности стресс-сценариев	<b>выполнено</b>

Результаты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	01.04.2021
Общий вывод о прохождении стресс-тестирования	<b>пройдено успешно</b>
Достаточность собственных средств (капитала) центрального контрагента	<b>соблюдается</b>
Достаточность средств центрального контрагента на покрытие потерь, вызванных неисполнением обязательств двух крупнейших по потерям участников клиринга в условиях шока на рынках, на которых центральный контрагент осуществляет централизованный клиринг	<b>соблюдается</b>
Достаточность ликвидных средств центрального контрагента	<b>соблюдается</b>

Сценарии стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	up	down
Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю	<b>-5,0%</b>	<b>7,6%</b>
Изменение цен акций	<b>24,3%</b>	<b>-21,9%</b>
Сдвиг G-кривой (в точке 1 г.)	<b>-0,3%</b>	<b>1,2%</b>
Изменение цен сырьевых товаров	<b>14,2%</b>	<b>-12,3%</b>

#### Аналитическая записка:

НКО НКЦ (АО) в целях контроля достаточности ресурсов на покрытие потерь в случае реализации стрессовых, но вероятных событий осуществил:

- 1) Прямое и обратное стресс-тестирование. При этом сценарии стресс-тестов учитывали исторические данные биржевых торгов за последние 10 лет.
- 2) Анализ чувствительности результатов стресс-тестирования к изменению риск-факторов.
- 3) Мониторинг актуальности стресс-сценариев.
- 4) Моделирование состояния ликвидности НКО НКЦ (АО) в стрессовых условиях.

Анализ результатов указанных выше процедур по состоянию на 01.04.2021 г. проводился как в разрезе биржевых рынков и видов деятельности, так и по результатам всей деятельности целиком.

Указанный анализ показал, что НКО НКЦ (АО) в случае реализации стрессовых, но вероятных событий сохраняет достаточность капитала и иных ресурсов на приемлемом уровне во всех указанных разрезах.

По результатам проведенного анализа не требуются специальные мероприятия чрезвычайного характера, направленные на обеспечение непрерывности деятельности НКО НКЦ (АО) в стрессовых условиях.

В качестве сценариев приведены значения сценариев по умолчанию, применяемые для вновь допускаемых к клирингу валют, акций и сырьевых товаров. НКО НКЦ (АО) устанавливает отдельный сценарий по каждому инструменту исходя из исторических и гипотетических сценариев изменений риск-факторов, соответствующих инструменту.