

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.07.2021 г.

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

Результаты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	01.07.2021
Общий вывод о прохождении стресс-тестирования	<i>пройдено успешно</i>
Достаточность собственных средств (капитала) центрального контрагента	<i>соблюдается</i>
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	<i>соблюдается</i>
Достаточность ликвидных средств центрального контрагента	<i>соблюдается</i>

Сценарии стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	up	down
Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю	-5.0%	7.6%
Изменение цен акций	28.9%	-19.3%
Сдвиг G-кривой (в точке 1 г.)	-0.3%	1.2%
Изменение цен сырьевых товаров	14.2%	-12.3%

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 01.07.2021 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.