

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.01.2018 г.

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

Результаты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	01.01.2018
Общий вывод о прохождении стресс-тестирования	пройдено успешно
Достаточность собственных средств (капитала) центрального контрагента	соблюдается
Достаточность средств центрального контрагента на покрытие потерь, вызванных неисполнением обязательств двух крупнейших по потерям участников клиринга на рынках, на которых центральный контрагент осуществляет централизованный клиринг	соблюдается
Достаточность ликвидных средств центрального контрагента	соблюдается

Сценарии стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	up	down
Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю	8%	-6%
Изменение цен акций	-17%	17%
Сдвиг рублевых кривых процентных ставок	1.2%	-1%
Изменение цен сырьевых товаров	-12%	12%

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, исключая кризисный период 2008 года.
- 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 01.01.2018 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.