

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.01.2023 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)		01.01.2023
Общий вывод о прохождении стресс-тестирования		пройдено
Сценарии стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	up	down
Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю	-6,8%	10,0%
Изменение цен акций	17,5%	-16,2%
Сдвиг G-кривой (в точке 1 г.)	-0,9%	1,7%
Изменение цен сырьевых товаров	14,5%	-12,9%