

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.04.2025 г.

Компоненты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)		Статус
Результаты прямого стресс-тестирования		удовлетворительны
Результаты обратного стресс-тестирования		удовлетворительны
Достаточность средств центрального контрагента для покрытия возможных потерь (не покрытых обеспечением), вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств двумя крупнейшими по потерям участниками клиринга		достаточно
Достаточность размера средств центрального контрагента, размера ликвидных средств для покрытия регуляторных требований к деятельности центрального контрагента		достаточно
Анализ чувствительности достаточности средств центрального контрагента к возникновению отдельных факторов риска		выполнено
Мониторинг актуальности стресс-сценариев		выполнено
Результаты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)		01.04.2025
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%	10.7%
Изменение цен акций	29.3%	-19.2%
Сдвиг G-кривой (в точке 1 г.)	-1.55%	1.68%
Изменение цен сырьевых товаров	13.7%	-13.4%

Информация об исторических, гипотетических и иных (гибридных/ комбинированных, сочетающих исторические и гипотетические события) стресс-сценариях, которые были использованы НКЦ при проведении прямого, обратного стресс-тестирования и анализа чувствительности достаточности средств НКЦ к возникновению отдельных факторов риска, в раскрытии не содержится