

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.01.2019 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) | 01.01.2019 |
|---|-------------------------|
| 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 в условиях шока 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.
- 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 01.01.2019 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.