

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.10.2018 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)	01.10.2018
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 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, 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 01.10.2018 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.