

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.01.2020 г.

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

Результаты стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	01.01.2020
Общий вывод о прохождении стресс-тестирования	<i>пройдено успешно</i>
Достаточность собственных средств (капитала) центрального контрагента	<i>соблюдается</i>
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	<i>соблюдается</i>
Достаточность ликвидных средств центрального контрагента	<i>соблюдается</i>

Сценарии стресс-тестирования НКО НКЦ (АО)	up	down
Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю	<i>-5,0%</i>	<i>7,2%</i>
Изменение цен акций	<i>14,3%</i>	<i>-12,9%</i>
Сдвиг G-кривой (в точке 1 г.)	<i>-0,5%</i>	<i>1,1%</i>
Изменение цен основных сырьевых товаров	<i>9,5%</i>	<i>-7,8%</i>

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 01.01.2020 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.

В качестве сценариев приведены средние значения сценариев для торгуемых валют; акций, входящих в индекс MOEX, и основных сырьевых товаров. НКО НКЦ (АО) устанавливает отдельный сценарий по каждому инструменту исходя из исторических и гипотетических сценариев изменений, соответствующих инструменту риск-факторов.