

Стресс-тестирование НКО НКЦ (АО) по состоянию на 01.10.2024 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) | | 01.10.2024 | |
| 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 | | 31.6% | -21.8% |
| 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