

Информация о результатах стресс-тестирования на отчетную дату: 01.01.2021:

Методы проведения стресс-тестирования	Проведение стресс-тестирования
Прямое стресс-тестирование	выполнено
Обратное стресс-тестирование	выполнено
Анализ чувствительности потенциальных потерь центрального контрагента к действию отдельных риск-факторов	выполнено

Результаты стресс-тестирования рисков центрального контрагента признаны удовлетворительными:

- потенциальные убытки во всех примененных сценариях отсутствуют, значение коэффициента кредитного риска (KP_n) равно нулю;
- средств центрального контрагента (выделенный капитал центрального контрагента плюс Гарантийный фонд) достаточно для покрытия рисков;
- норматив достаточности собственных средств (капитала) центрального контрагента соблюдается;
- наблюдается избыток ликвидных средств центрального контрагента;
- величина регулятивного капитала центрального контрагента остается положительной, сценарное значение норматива достаточности собственных средств (капитала) центрального контрагента в результате применения стресс-сценария остается больше 100%;
- модель центрального контрагента выдерживает существенный рост рыночной волатильности.
- управление собственным портфелем центрального контрагента обеспечивает значительный запас ликвидных средств и позволяет соблюдать обязательные нормативы;
- максимальная отрицательная переоценка позиций участников клиринга достигается при выполнении сценария падение риск-фактора «Акции с валютой котировки USD».