

Информация о результатах стресс-тестирования на отчетную дату: 01.04.2021:

Методы и сценарии проведения стресс-тестирования	Проведение стресс-тестирования
Прямое стресс-тестирование выполняется на основе исторических и гипотетических стресс-сценариев.	выполнено
Обратное стресс-тестирование выполняется посредством определения гипотетических стресс-сценариев (значений риск-факторов) при которых принимают критические значения: <ul style="list-style-type: none"> • Средства центрального контрагента; • Ликвидные средства центрального контрагента; • Запас (буфер) капитала центрального контрагента 	выполнено
Анализ чувствительности потенциальных потерь центрального контрагента к действию отдельных риск-факторов проводится на текущих позициях участников клиринга при условии нулевых свободных средств каждого участника клиринга.	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, 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».