Информация о результатах стресс-тестировании на отчетную дату: 01.04.2026 (за 1 квартал 2026г):

Методы и сценарии проведения стресс-тестирования	Проведение стресс-тестирования
Прямое стресс-тестирование выполненное на основе исторических и гипотетических стресс-сценариев.	выполнено
Обратное стресс-тестирование выполненное посредством определения параметров гипотетических стресс-сценариев (значений риск-факторов), при которых принимают критические значения: • Совокупные средства центрального контрагента (ВК+ГФ); • Ликвидные средства центрального контрагента; • Регулятивный капитал центрального контрагента и значение норматива достаточности капитала Н1цк.	выполнено
Анализ чувствительности потенциальных потерь центрального контрагента к действию отдельных риск-факторов.	выполнено
Мониторинг актуальности стресс-сценариев	выполнено

Гипотетические сценарии стресс-тестирования (средние значения)	Падение, %	Рост, %
Курсы иностранных валют	-5,70	+7,87
Изменение цен финансовых инструментов	-14,43	+19,95

Результаты стресс-тестирования рисков центрального контрагента признаны удовлетворительными:

- потенциальные убытки во всех примененных сценариях отсутствуют, значение коэффициента кредитного риска ($КР_n$) равно нулю;
- средств центрального контрагента (Выделенный капитал, 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 запас ликвидных средств и позволяет соблюдать обязательный норматив Н1цк при любом из тестируемых стресс-сценариев;
- Ни один из модельных сценариев в рамках анализа чувствительности к действию отдельных риск-факторов не привел к возникновению потенциальных потерь центрального контрагента. К максимальной отрицательной переоценке позиций участников клиринга приводит сценарий падения риск-фактора 1 - Акции и фьючерсы с валютой котировки RUB.