

## Стресс-тестирование НКО ЛЦК (АО) по состоянию на 01.10.2025 г.

| Компоненты стресс-тестирования НКО ЛЦК (АО)                                                                                                                                                                                          | Статус                   |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| Результаты стресс-тестирования                                                                                                                                                                                                       | <i>удовлетворительны</i> |
| Результаты обратного стресс-тестирования                                                                                                                                                                                             | <i>удовлетворительны</i> |
| Достаточность средств центрального контрагента для покрытия рисков, сопряженных с деятельностью центрального контрагента и осуществлением центральным контрагентом банковских операций                                               | <i>достаточно</i>        |
| Достаточность размера средств центрального контрагента для покрытия возможных потерь (не покрытых обеспечением), вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств двумя крупнейшими по потерям участниками клиринга | <i>достаточно</i>        |
| Достаточность размера ликвидных средств для покрытия регуляторных требований к деятельности центрального контрагента (стресс-тестирование ликвидности)                                                                               | <i>достаточно</i>        |
| Анализ чувствительности достаточности средств центрального контрагента к возникновению отдельных факторов риска                                                                                                                      | <i>выполнено</i>         |
| Мониторинг актуальности стресс-сценариев                                                                                                                                                                                             | <i>выполнено</i>         |

| Результаты стресс-тестирования НКО ЛЦК (АО)   | 01.10.2025      |
|-----------------------------------------------|-----------------|
| Общий вывод о прохождении стресс-тестирования | <i>пройдено</i> |

| Сценарии стресс-тестирования НКО ЛЦК (АО)               | up            | down          |
|---------------------------------------------------------|---------------|---------------|
| Изменение курсов иностранных валют по отношению к рублю | <i>10,87%</i> | <i>-7,79%</i> |

Информация об исторических, гипотетических и иных (гибридных/ комбинированных, сочетающих исторические и гипотетические события) стресс-сценариях, которые были использованы НКО ЛЦК (АО) при проведении прямого, обратного стресс-тестирования и анализа чувствительности достаточности средств НКО ЛЦК (АО) к возникновению отдельных факторов риска, в раскрытии не содержится.