

УТВЕРЖДЕНО

Решением Наблюдательного совета
Банка «Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)
«03» ноября 2017 года, Протокол № 5

Председатель Наблюдательного совета



Ю.О. Денисов

ПОЛОЖЕНИЕ О КОМИТЕТЕ ПО РИСКАМ НАБЛЮДАТЕЛЬНОГО СОВЕТА НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ-ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» (АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящее Положение о Комитете по рискам Наблюдательного совета Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (далее - НКЦ) разработано в соответствии с законами и иными правовыми актами Российской Федерации, включая нормативные акты Банка России.

1.2. Положение о Комитете по рискам Наблюдательного совета НКЦ (далее – Положение) определяет задачи и функции, порядок формирования и работы Комитета по рискам Наблюдательного совета НКЦ (далее – Комитет по рискам или Комитет).

1.3. Комитет по рискам является постоянно действующим консультативно-совещательным органом Наблюдательного совета НКЦ, образованным для организации эффективной системы управления рисками НКЦ, в том числе для предварительного рассмотрения вопросов, связанных с определением приоритетных направлений деятельности НКЦ в области управления финансовыми и нефинансовыми рисками.

1.4. Комитет по рискам осуществляет свою деятельность в соответствии с Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, Уставом НКЦ, Положением о Наблюдательном совете, решениями Наблюдательного совета, настоящим Положением и иными документами, утверждаемыми Общим собранием акционеров и Наблюдательным советом НКЦ.

1.5. Комитет по рискам действует в рамках полномочий, предоставленных ему Наблюдательным советом НКЦ, и полностью подотчетен Наблюдательному совету НКЦ.

1.6. Комитет по рискам не может выступать от имени НКЦ, исполнительных органов или Наблюдательного совета НКЦ или налагать на исполнительные органы или Наблюдательный совет НКЦ юридически действительные обязательства.

1.7. Настоящее Положение, а также дополнения и изменения к нему утверждаются Наблюдательным советом НКЦ.

1.8. Наблюдательный совет НКЦ на регулярной основе, не реже одного раза в год, осуществляет оценку эффективности работы Комитета.

2. ЗАДАЧИ И ФУНКЦИИ КОМИТЕТА

2.1. Основной задачей Комитета является участие в организации и совершенствовании системы управления рисками НКЦ в следующих сферах:

2.1.1. Управление рисками НКЦ как кредитной организации, в том числе:

- анализ и информирование Наблюдательного совета НКЦ по вопросам, связанным с оценкой системы оплаты труда НКЦ и ее соответствия стратегии НКЦ, характеру и масштабу совершаемых операций, результатам деятельности, уровню и сочетанию принимаемых рисков¹;
- рассмотрение отчетов о состоянии финансовых и операционных рисков НКЦ, в т.ч. управленческой риск-отчетности на консолидированной основе по Группе «Московская Биржа» (по поручению Наблюдательного совета или по решению руководителя подразделения по управлению рисками НКЦ);
- предварительное одобрение внутренних документов и отчетности в рамках реализации внутренних процедур оценки достаточности капитала (ВПОДК);

¹ В рамках рассмотрения указанных вопросов Комитет вправе сотрудничать с Комитетом по назначениям и вознаграждениям Наблюдательного совета НКЦ.

- предварительное одобрение внутреннего документа НКЦ, определяющего основные критерии (принципы) размещения временно свободных денежных средств.

2.1.2. Управление рисками НКЦ как клиринговой организации и центрального контрагента, в целях повышения финансовой устойчивости НКЦ и обеспечения непрерывности клиринговой деятельности. Для этого Комитет осуществляет предварительное одобрение следующих внутренних документов, утверждаемых Наблюдательным советом:

2.1.2.1. документа (документов), определяющего (определяющих) правила организации системы управления рисками НКЦ (кредитным, операционным и иными рисками), в том числе рисками, связанными с совмещением НКЦ клиринговой деятельности и деятельности центрального контрагента с иными видами деятельности, а также:

- меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности,
- меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с иными видами деятельности,
- меры, принимаемые НКЦ в случаях возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций, которые могут препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности;

2.1.2.2. методику стресс-тестирования рисков НКЦ;

2.1.2.3. методику оценки точности модели НКЦ;

2.1.2.4. документа, определяющего меры, принимаемые НКЦ в случаях возникновения чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности;

2.1.2.5. плана восстановления финансовой устойчивости НКЦ.

2.1.3. Управление иными рисками НКЦ в части рассмотрения вопросов по инициативе органов управления НКЦ и лиц, отвечающих за управление рисками НКЦ.

2.2. Комитет вправе совершать иные действия по поручению Наблюдательного совета НКЦ для выполнения своих функций в объеме, соответствующем требованиям российского и другого применимого законодательства, а также Устава НКЦ, иных внутренних документов НКЦ и других нормативных документов, имеющих обязательную силу для НКЦ.

2.3. При необходимости Комитет вправе получать от сторонних организаций профессиональные услуги, либо привлекать третьих лиц в качестве экспертов (консультантов) по вопросам, относящимся к деятельности Комитета.

2.4. Решения Комитета носят рекомендательный и информационный характер для исполнительных органов и/или Наблюдательного совета НКЦ при принятии ими соответствующих решений.

2.5. В течение десяти рабочих дней со дня принятия соответствующего решения, раскрытию на официальном сайте НКЦ в сети «Интернет» (<http://nkcbank.ru>) подлежат:

2.5.1. Состав Комитета;

2.5.2. Решения, принимаемые Комитетом по п. 2.1.2.1 – 2.1.2.4 настоящего Положения.

3. СОСТАВ КОМИТЕТА И ПОРЯДОК ЕГО ФОРМИРОВАНИЯ

3.1. Члены Комитета избираются простым большинством голосов от общего числа избранных членов Наблюдательного совета НКЦ на одном из первых заседаний после

избрания нового состава Наблюдательного совета НКЦ в количестве, определенном Наблюдательным советом НКЦ.

3.2. В состав Комитета должны входить:

- представители участников клиринга (не более одного члена от одного участника клиринга);
- независимые члены Наблюдательного совета НКЦ;
- представители клиентов участников клиринга (не более одного члена от одного клиента участника клиринга).

В целях настоящего Положения:

- представителем участника клиринга является член органа управления или работник* участника клиринга;
- представителем клиента участника клиринга является член органа управления или работник* юридического лица, за счет которого исполняются обязательства, допущенные к клирингу в НКЦ (клиента участника клиринга).

В состав Комитета также могут быть избраны представители саморегулируемых организаций и иные лица, соответствующие требованиям, установленным п. 3.3. настоящего Положения.

3.3. В состав Комитета могут быть избраны только лица с надлежащей деловой репутацией и обладающие квалификацией (высшее образование), знаниями и опытом, необходимыми для выполнения задач и функций Комитета в соответствии с настоящим Положением.

3.4. Не менее двух третей Комитета должны составлять представители участников клиринга.

3.5. Члены Комитета избираются Наблюдательным советом из состава кандидатов для избрания в состав Комитета, выдвинутых на основе заявлений, представленных в НКЦ лицами, соответствующими требованиям п. 3.2. и п. 3.3. настоящего Положения.

3.6. Заявление кандидата о включении в список кандидатов для избрания в состав Комитета должно быть составлено по форме, предусмотренной в Приложение №1 к настоящему Положению. К заявлению прилагается письменное согласие кандидата на обработку персональных данных.

3.7. Секретарь Комитета проверяет поступившие заявления на соответствие представителей требованиям, указанным в п. 3.2. и п. 3.3. настоящего Положения с целью включения в список кандидатов для избрания в состав Комитета.

3.8. Полномочия Комитета действуют до момента избрания нового состава Комитета Наблюдательным советом, избранным годовым общим собранием акционеров либо внеочередным общим собранием акционеров (в случае досрочного прекращения полномочий Наблюдательного совета).

3.9. На заседания Комитета приглашаются руководители подразделений по управлению рисками НКЦ (или их заместители). При необходимости на заседания Комитета приглашаются представители исполнительных органов НКЦ и компаний Группы «Московская Биржа», а также иные лица, обладающие необходимыми знаниями, профессиональными навыками и компетенцией для решения рассматриваемых Комитетом вопросов.

* Работник должен занимать должность не ниже главного эксперта (главного экономиста/специалиста) подразделения, связанного с управлением рисками или с операциями на финансовом рынке.

3.10. Наблюдательный совет по собственной инициативе может досрочно прекратить полномочия как всего состава Комитета, так и любого члена Комитета. В этом случае Наблюдательный совет на том же заседании, на котором было принято решение о досрочном освобождении от исполнения обязанностей, избирает новый состав Комитета или нового члена Комитета либо принимает решение об определении меньшего численного состава Комитета.

3.11. Член Комитета вправе досрочно сложить с себя полномочия члена Комитета, уведомив об этом Председателя Комитета путем направления письменного заявления не менее чем за один месяц до предполагаемой даты сложения полномочий. Полномочия члена Комитета считаются прекращенными со дня принятия Наблюдательным советом НКЦ решения об исключении такого члена.

Член Комитета может быть также исключен из состава Комитета Наблюдательным советом НКЦ по предложению организации, выдвинувшей члена Комитета в качестве своего представителя. В последнем случае такая организация одновременно с предложением об исключении кандидата, вправе предложить в состав Комитета нового кандидата, являющегося ее представителем.

3.12. В случае если количественный состав Комитета становится менее определенного Положением кворума для проведения заседаний Комитета или перестает соответствовать требованиям, указанным в п.3.2. и(или) п.3.4. настоящего Положения, Председатель Наблюдательного совета НКЦ созывает внеочередное заседание Наблюдательного совета НКЦ для избрания членов Комитета либо включает вопрос об избрании членов Комитета в повестку дня ближайшего запланированного заседания Наблюдательного совета НКЦ.

3.13. Руководство Комитетом и организация его деятельности осуществляется Председателем Комитета.

3.14. Председатель Комитета избирается Наблюдательным советом НКЦ из числа членов Наблюдательного совета НКЦ.

4. ОРГАНИЗАЦИЯ РАБОТЫ КОМИТЕТА

4.1. Председатель Комитета организует работу Комитета и выполняет следующие функции:

- обеспечивает объективность при выработке Комитетом рекомендаций Наблюдательному совету НКЦ;
- созывает заседания Комитета и председательствует на них;
- определяет форму проведения заседаний и утверждает повестку дня заседания;
- определяет список лиц, приглашаемых для участия в очном заседании Комитета;
- организует обсуждение вопросов на заседаниях Комитета, а также заслушивание мнения лиц, приглашенных к участию в заседании;
- организует ведение протокола заседаний Комитета и подписывает протоколы заседаний Комитета;
- разрабатывает, при необходимости, план очередных заседаний на текущий год с учетом плана заседаний Наблюдательного совета;
- распределяет обязанности между членами Комитета;
- представляет Комитет при взаимодействии с исполнительными органами НКЦ, иными органами и лицами;
- осуществляет официальную переписку Комитета, подписывает запросы, письма и иные документы от имени Комитета;

- обеспечивает в процессе деятельности Комитета соблюдение требований законодательства Российской Федерации, Устава НКЦ, иных внутренних документов НКЦ и настоящего Положения;

- выполняет иные функции, предусмотренные действующим законодательством, Уставом НКЦ, иными внутренними документами и настоящим Положением.

4.2. Функции Секретаря Комитета осуществляет секретарь Наблюдательного совета НКЦ или иное лицо, назначенное Председателем Правления НКЦ по согласованию с Председателем Комитета.

4.3. Секретарь Комитета обеспечивает подготовку и проведение заседаний Комитета, сбор и систематизацию материалов к заседаниям, своевременное направление членам Комитета и приглашенным лицам уведомлений о проведении заседаний Комитета, повестки дня заседаний, материалов по вопросам повестки дня, подготовку протоколов заседаний Комитета, хранение всех соответствующих материалов, а также иные функции по поручению Председателя Комитета. Заседания Комитета проводятся как правило, в форме очного голосования (совместного присутствия). На заседании Комитета, проводимом в форме очного голосования, с согласия всех присутствующих членов Комитета могут рассматриваться вопросы, предварительно не включенные в повестку дня заседания.

Для проведения заседаний Комитета могут применяться технические средства связи (телефонные конференции и т.п.).

4.4. Члены Комитета, которые не могут принять участие в заседании, вправе представить свои письменные мнения по вопросам повестки дня. Такое письменное мнение должно быть озвучено на заседании Комитета Председателем Комитета. При принятии решения Комитетом с учетом письменного мнения отсутствующего члена Комитета, письменное мнение прилагается к протоколу заседания.

Письменное мнение члена Комитета, не присутствующего на заседании, учитывается при определении наличия кворума и результатов голосования по вопросу повестки, если соблюдены следующие условия:

- письменное мнение по вопросу получено до начала заседания;

- член Комитета однозначно определил свою позицию по вопросу, указав в письменном мнении один из вариантов голосования по предложенному проекту решения - «за», «против» или «воздержался».

Письменное мнение, содержащее поправки и оговорки по предложенному проекту решения, не подлежит учету при определении кворума и результатов голосования. Если поправки в проект решения внесены на заседании Комитета, письменное мнение также не подлежит учету при определении кворума по данному вопросу и результатов голосования.

Письменные мнения учитываются при определении кворума и результатов голосования по каждому вопросу повестки дня заседания отдельно, что отражается в протоколе заседания Комитета.

Письменное мнение, направленное лицами, которые не смогли принять участие в очном заседании Комитета, должно быть подписано с указанием фамилии и инициалов члена Комитета и представлено не позднее времени начала заседания Комитета в оригинале либо посредством факсимильной связи с последующим направлением оригинала.

4.5. По решению Председателя Комитета, в исключительных случаях, решения Комитета могут приниматься путем проведения заочного голосования.

4.6. План работы Комитета формируется Председателем Комитета с учетом утвержденного плана работы Наблюдательного совета и предложений членов

Наблюдательного совета НКЦ, членов Комитета, Председателя Правления НКЦ, Правления НКЦ, а также заинтересованных структурных подразделений НКЦ.

4.7. При созыве заседания Комитета Председатель Комитета определяет дату, время, повестку дня, место и форму проведения заседания, а также перечень лиц, приглашаемых для участия в заседании Комитета.

Решение о созыве заседания или включении вопроса повестки дня в план работы Комитета, должно быть принято Председателем Комитета в течение 5 (Пяти) рабочих дней с даты поступления требования или предложения с учетом важности и срочности предлагаемого к рассмотрению вопроса.

Секретарь Комитета рассылает членам Комитета повестку дня, утвержденную Председателем Комитета, и необходимые материалы, как правило, не менее чем за 5 дней до даты проведения заседания Комитета.

4.8. Решение Председателя Комитета об отказе в созыве заседания может быть принято в случае, если вопросы, предложенные для включения в повестку дня заседания, не отнесены настоящим Положением к функциям Комитета. Мотивированное решение об отказе должно быть сообщено инициатору созыва в течение 5 (Пяти) рабочих дней с даты поступления требования или предложения.

4.9. При возникновении обстоятельств, делающих невозможным или затрудняющих проведение заседания Комитета, о котором члены Комитета были уведомлены, по решению Председателя, заседание по запланированной повестке дня может быть перенесено на другую дату.

Об изменении даты и (или) времени заседания Комитета Секретарь Комитета по указанию Председателя уведомляет всех членов Комитета.

4.10. Председатель Комитета председательствует на заседаниях Комитета. В случае его отсутствия члены Комитета избирают Председательствующего из числа присутствующих членов Комитета простым большинством голосов.

4.11. Заседание Комитета правомочно (имеет кворум), если на нем присутствует не менее половины от общего числа его членов. Наличие кворума определяет Председатель Комитета при открытии заседания. При отсутствии кворума для проведения заседания Комитета Председателем Комитета должно быть принято решение о проведении повторного заседания с той же повесткой дня либо включении вопросов, которые должны быть рассмотрены на несостоявшемся заседании, в повестку дня следующего запланированного заседания Комитета.

4.12. Каждый из членов Комитета, включая Председателя, обладает одним голосом. Передача права голоса членом Комитета другому члену Комитета не допускается.

Мнения или рекомендации приглашенных на заседание лиц, указанных в пункте 3.9. настоящего Положения, могут быть занесены в протокол заседания.

4.13. В ходе проведения заседания Комитета должна быть раскрыта и доведена до сведения членов Комитета любая информация о наличии конфликта интересов члена Комитета в рассмотрении того или иного вопроса. В таком случае член Комитета обязан воздерживаться от участия в голосовании по соответствующему вопросу.

4.14. Решения Комитета принимаются простым большинством голосов от числа принимающих участие в заседании. При равенстве голосов голос Председательствующего на заседании Комитета является решающим.

4.15. При проведении заочного заседания Комитета одновременно с материалами (информацией) по вопросам повестки дня заочного заседания членам Комитета направляются бюллетени для голосования.

4.16. При заполнении бюллетеня для заочного голосования по каждому вопросу, поставленному на голосование, должен быть оставлен не зачеркнутым только один из возможных вариантов голосования («за», «против», «воздержался»). Заполненный бюллетень для голосования должен быть подписан с указанием фамилии и инициалов члена Комитета и представлен не позднее времени окончания их приема в оригинале либо посредством факсимильной связи с последующим направлением оригинала бюллетеня для голосования по указанному в нем адресу.

4.17. Принятые Комитетом решения оформляются протоколом заседания Комитета, который составляется в 2 (Двух) экземплярах Секретарем Комитета не позднее 8 (Восьми) рабочих дней после его проведения. Протокол заседания подписывается Председательствующим на заседании, который несет ответственность за правильность составления протокола.

4.18. В протоколе заседания Комитета указываются: форма, место, дата и время проведения заседания (дата окончания приема заполненных бюллетеней для голосования при проведении заочного голосования), лица, присутствующие на заседании, повестка дня заседания, вопросы, поставленные на голосование, предложения по формулировке решений, итоги голосования, принятые решения, наличие письменных мнений отсутствующих на заседании членов Комитета, могут указываться основные положения (тезисы) выступлений по вопросам повестки дня, а также мнения или рекомендации приглашенных на заседание Комитета лиц.

Персональное мнение члена Комитета, голосовавшего против принятия решения или воздержавшегося от голосования по вопросу повестки дня заседания, по желанию высказавшего его члена Комитета может быть занесено в протокол заседания Комитета.

4.19. По вопросам повестки дня, по которым Комитетом по рискам разработаны рекомендации для дальнейшего принятия решения на заседании Наблюдательного совета, такая рекомендация оформляется в форме выписки из протокола заседания, которая прилагается к материалам при рассмотрении соответствующего вопроса на заседании Наблюдательного совета НКЦ.

4.20. Оригиналы протоколов заседаний Комитета хранятся у Секретаря Комитета и/или в архиве НКЦ. Протоколы заседаний Комитета нумеруются непрерывной сквозной нумерацией в хронологическом порядке в период с даты утверждения действующего состава Комитета до даты избрания Наблюдательным советом НКЦ нового состава Комитета.

4.21. Копии протоколов заседаний Комитета или выписки из них Секретарь Комитета направляет лицам, ответственным за исполнение соответствующих решений Комитета. Членам Наблюдательного совета НКЦ копии протоколов или выписки из них направляются по запросу, а в структурные подразделения НКЦ - только с разрешения Председателя Правления НКЦ или уполномоченного им лица.

4.22. Члены Комитета обязаны воздерживаться от действий, которые приведут или потенциально способны привести к возникновению конфликта между своими интересами и интересами НКЦ, а также не вправе разглашать и использовать в личных интересах или в интересах третьих лиц конфиденциальную информацию о НКЦ и инсайдерскую информацию. В этой связи члены Комитета обязаны взять на себя письменное обязательство о сохранении конфиденциальной информации.

5. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

5.1. Вопросы, не урегулированные настоящим Положением, регулируются Уставом НКЦ, Положением о Наблюдательном совете, иными внутренними документами НКЦ и действующим законодательством.

5.2. Если в результате изменения законодательства, Устава НКЦ, Положения о Наблюдательном совете или иных внутренних документов НКЦ, утвержденных Общим собранием акционеров НКЦ, отдельные статьи настоящего Положения вступают в противоречие с ними, такие статьи настоящего Положения утрачивают силу и до момента внесения изменений в настоящее Положение, Комитет по рискам руководствуется требованиями вышеуказанных нормативных и внутренних документов.

Приложение 1
к Положению о Комитете по рискам
Наблюдательного совета
Небанковской кредитной организации-
центрального контрагента
«Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)

Председателю Правления
НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ
на включение в список кандидатов для избрания в состав
Комитета по рискам Наблюдательного совета Небанковской кредитной организации-
центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное
общество)

Прошу включить меня _____
(Ф.И.О. полностью)

в список кандидатов для избрания в состав Комитета по рискам Наблюдательного совета Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).

Краткие сведения:

- Дата рождения:

• Образование (с указанием квалификации, специальности и учебного заведения):

- Сведения о работе (с указанием наименования организации, занимаемой должности и даты начала работы в указанной организации):

- Членство в органах управления иных юридических лиц:

Иная информация (по усмотрению заявителя):

- Контактный телефон, факс, адрес электронной почты:

Обязуюсь соблюдать требования Положения о Комитете по рискам Наблюдательного совета Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).

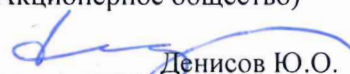
"__" _____ 20__ г.

_____/_____
(Ф.И.О.)

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 10 (десять) листов

Председатель Наблюдательного Совета Банка
«Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)




Денисов Ю.О.
(подпись)