**Повестка дня и решения, принятые на заседании**

**Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО)**

Форма проведения заседания: совместное присутствие членов Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО) для голосования по вопросам повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование.

Место проведения заседания: 125009, Москва, Большой Кисловский переулок, дом 13.

Дата и время проведения заседания: 23 июня 2017 года, 11:00 – 14:30 по московскому времени.

**ПОВЕСТКА ДНЯ:**

1. О величине выделенного капитала центрального контрагента Банка НКЦ (АО).
2. О предварительном рассмотрении документов, разработанных в рамках дорожной карты по получению Банком НКЦ (АО) статуса центрального контрагента.
3. О результатах выполнения ВПОДК в 2016 году.
4. О предварительном одобрении Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
5. Отчет по статусу выполнения поручений Комиссии по управлению рисками Московской Биржи и Комитета по рискам Банка НКЦ (АО).
6. О предварительном согласовании повесток следующих заседаний Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО).

**Вопрос 1 повестки дня: О величине выделенного капитала центрального контрагента Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Рекомендовать Наблюдательному совету Банка НКЦ (АО) сохранить размер выделенного капитала Банка НКЦ (АО), рассчитанного по состоянию на 01.01.2017 г., и его распределение по рынкам без изменений.

**Вопрос 2 повестки дня: О предварительном рассмотрении документов, разработанных в рамках дорожной карты по получению Банком НКЦ (АО) статуса центрального контрагента.**

**Принятое решение:**

Рекомендовать Наблюдательному совету Банка НКЦ (АО) для целей изменения статуса Банка НКЦ (АО) с банка на небанковскую кредитную организацию - центральный контрагент и получению статуса центрального контрагента, утвердить (с учетом доработки по итогам обсуждения):

* Правила организации системы управления рисками НКО НКЦ (АО)
* Методика определения выделенного капитала центрального контрагента НКО НКЦ (АО)
* Методика проведения стресс-тестирования в НКО НКЦ (АО)
* Методика оценки точности моделей в НКО НКЦ (АО).

**Вопрос 3 повестки дня: О результатах выполнения ВПОДК в 2016 году.**

**Принятое решение:**

Рекомендовать Наблюдательному совету Банка НКЦ (АО) принять к сведению отчет о выполнении ВПОДК и эффективности системы управления рисками в 2016 году.

**Вопрос 4 повестки дня: О предварительном одобрении Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).**

**Принятое решение:**

Предварительно одобрить:

* Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть в новой редакции;
* Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы в новой редакции;
* Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в новой редакции;
* Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть IV. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в новой редакции;
* Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть V. Правила клиринга на срочном рынке в новой редакции.

**Вопрос 5 повестки дня: Отчет по статусу выполнения поручений Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

1. Принять к сведению отчет по статусу выполнения поручений Комиссии по управлению рисками Московской Биржи и Комитета по рискам Банка НКЦ (АО).

2. Перенести срок исполнения поручений №16, 17 и 19 Реестра поручений в соответствии с рекомендациями, приведенными в Реестре.

**Вопрос 6 повестки дня: О предварительном согласовании повесток следующих совместных заседаний Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Принять к сведению предварительные повестки заседаний Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО) до конца 2017 года.