**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.

Время проведения заседания: 14:00 – 19:00 по московскому времени.

**ПОВЕСТКА ДНЯ:**

1. Отчет по нефинансовым рискам Банка НКЦ (АО) на 01 сентября 2016 г.
2. О риск-аппетите Банка НКЦ (АО).
3. Анализ риска ликвидности Банка НКЦ (АО).
4. О предварительном одобрении Изменений в Политику осуществления казначейской деятельности Банка НКЦ (АО).
5. О предварительном одобрении Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
6. О страховании операционных рисков Банка НКЦ (АО).
7. О предварительном одобрении Политики управления операционным риском Банка НКЦ (АО).
8. Отчет по статусу выполнения поручений Комитета по рискам Банка НКЦ (АО).
9. О предварительном согласовании повестки заседания Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО), запланированного на 9 декабря 2016 г.

**Вопрос 1 повестки дня: Отчет по нефинансовым рискам Банка НКЦ (АО) на 01 сентября 2016 г.**

**Принятое решение:**

Принять к сведению Отчет по нефинансовым рискам Банка НКЦ (АО) на 01 сентября 2016 г.

**Вопрос 2 повестки дня: О риск-аппетите Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Рекомендовать Т.А. Ширинкиной до конца 2016 года предоставить Комитету проект Декларации риск-аппетита Банка НКЦ (АО) на 2017 г., доработанный по результатам обсуждения.

**Вопрос 3 повестки дня: Анализ риска ликвидности Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Принять к сведению информацию об анализе риска ликвидности Банка НКЦ (АО).

**Вопрос 4 повестки дня: О предварительном одобрении Изменений в Политику осуществления казначейской деятельности Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Предварительно одобрить Изменения № 3, вносимые в Политику осуществления казначейской деятельности Банка НКЦ (АО) (Приложение 1).

**Вопрос 5 повестки дня: О предварительном одобрении Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).**

**Принятое решение:**

* + - 1. 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 V. Правила клиринга на срочном рынке в новой редакции, Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VII. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
      2. Рекомендовать С.Г. Горбаченко и А.С. Романовой предоставить Комитету до конца 2016 года предложения по совершенствованию методологии маржирования и расчета рисков при осуществлении клиринга на рынке СПФИ.

**Вопрос 6 повестки дня: О страховании операционных рисков Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

1. Принять к сведению информацию о страховании операционных рисков Банка НКЦ (АО).
2. Рекомендовать С.В. Демидову представить Комитету итоги переговоров со страховыми компаниями и брокерами о страховании операционных рисков Банка НКЦ (АО) в I квартале 2017 г.

**Вопрос 7 повестки дня: О предварительном одобрении Политики управления операционным риском Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Предварительно одобрить Политику управления операционным риском Банка НКЦ в новой редакции (АО) (Приложение 2).

**Вопрос 8 повестки дня: Отчет по статусу выполнения поручений Комитета по рискам Банка НКЦ (АО).**

**Принятое решение:**

Принять к сведению Отчет по статусу выполнения поручений Комитета по рискам Банка НКЦ (АО).

**Вопрос 9 повестки дня: О предварительном согласовании повестки заседания Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО), запланированного на 9 декабря 2016 г.**

**Принятое решение:**

1. Предварительно одобрить повестку заседания Комиссии по управлению рисками Наблюдательного совета ПАО Московская Биржа и Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО).
2. Провести дополнительное очное заседание Комитета по рискам Наблюдательного совета Банка НКЦ (АО) во II половине октября 2016 г.