

**Повестка дня и решения, принятые на заседании
Совета Биржи ПАО Московская Биржа**

Форма проведения заседания: совместное присутствие членов Совета Биржи ПАО «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – «Биржа») для голосования по вопросам повестки дня и принятия решений по вопросам, поставленным на голосование.

Дата проведения заседания: 12 октября 2015 года

Место проведения заседания: г. Москва, ул. Воздвиженка, д.4/7, стр.1

ПОВЕСТКА ДНЯ:

1. О внедрении механизмов восстановления финансовой устойчивости и распределения убытков Центрального контрагента в соответствии с новыми регулятивными требованиями Банка России и международными стандартами.
2. О подходах к унификации клиринговых сервисов на рынках Группы «Московская Биржа».
3. Разное.

Вопрос 1. О внедрении механизмов восстановления финансовой устойчивости и распределения убытков Центрального контрагента в соответствии с новыми регулятивными требованиями Банка России и международными стандартами.

А.С. Хавин и Т.А. Ширинкина описали вводимые с 01.11.2015 г. уровни защиты Центрального контрагента (ЦК) и сравнили их с действующей структурой защиты на различных рынках, выделили ключевые особенности уровней защиты. Также в докладе был приведен порядок расчета выделенного капитала ЦК.

Принятое решение:

Принять к сведению информацию о внедрении механизмов восстановления финансовой устойчивости и распределения убытков Центрального контрагента. **Рекомендовать Бирже учесть** результаты дискуссии о необходимости повышения открытости методик расчета риск-параметров, включая методики стресс-тестирования, и о потребности в создании методологии оценки размеров выделенного капитала Центрального контрагента для рынка СПФИ.

Вопрос 2. О подходах к унификации клиринговых сервисов на рынках Группы «Московская Биржа».

А.К. Афанасьев представил новые подходы к унификации клиринговых сервисов на рынках Группы "Московская Биржа", включающие кросс-маржирование, унификацию требований к обеспечению и полный неттинг при расчетах на всех рынках Биржи. Это позволит участникам оперативно управлять своим обеспечением с учетом единой нетто-позиции на всех рынках, и, как следствие, снизить свои издержки. Наибольшую экономию смогут получить активные участники, работающие на всех рынках Московской биржи.

Принятое решение:

Принять к сведению информацию о подходах и одобрить работу по унификации клиринговых сервисов на рынках Группы «Московская Биржа».

Вопрос 3. Разное.

О непрерывности сервисов Московской Биржи

С. Поляков выступил с обзором основных мер, направленных на улучшение непрерывности сервисов Биржи, в том числе: 1. реализация проекта по разделению торговых и клиринговых ядер до конца 2016 года; 2. Переход на новую сетевую архитектуру с физической сегрегацией сетей; 3.

Соблюдение правила о замене 30% оборудования в течение каждого года; 4. увеличение инвестиций в ИТ, включая кадровое развитие; 5. изменение методологии тестирования программного обеспечения.

Принятое решение:

Принять к сведению информацию о непрерывности сервисов Московской Биржи.

О подходах к формированию состава Совета Биржи ПАО Московская Биржа

А.В. Шеметов представил предложения по изменению формата заседаний и формирования Совета. Предлагается сформировать Совет Биржи в количестве 25 человек, 15 из которых будут представлять топ-15 участников по суммарному взвешенному объему торгов (по представлению CEO компаний), а оставшиеся 10 будут выбраны Наблюдательным советом Московской биржи преимущественно из числа саморегулируемых организаций, управляющих компаний, инвестиционных фондов, банков и представителей регулятора.

Принятое решение:

Одобрить новую концепцию формирования Совета Биржи ПАО Московская Биржа.

Заместитель Председателя Биржевого совета ПАО Московская Биржа

С.А. Романчук

Ответственный Секретарь Биржевого совета ПАО Московская Биржа

А.Г. Василенко