

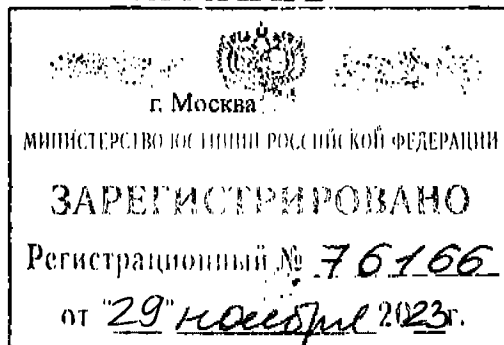


ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

УКАЗАНИЕ

« 02 » октября 2023 г.

№ 6558-У



О внесении изменений

в Положение Банка России от 12 марта 2015 года № 463-П

На основании части 5 статьи 22 и пункта 11 части 1 статьи 25 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте»:

1. Внести в Положение Банка России от 12 марта 2015 года № 463-П «О требованиях, направленных на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, и требования к документу (документам), определяющему (определяющим) меры, направленные на снижение кредитных, операционных и иных рисков, в том числе рисков, связанных с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности»¹ следующие изменения:

1.1. В пункте 1.1:

в абзаце первом слово «операционным,» исключить;

дополнить абзацем следующего содержания:

«риском, определяемым в соответствии с пунктом 1 Положения Банка России от 2 октября 2023 года № 827-П «О требованиях к управлению рисками

¹ Зарегистрировано Минюстом России 30 апреля 2015 года, регистрационный № 37079, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 15 марта 2018 года № 4738-У (зарегистрировано Минюстом России 5 июня 2018 года, регистрационный № 51287), от 15 июня 2021 года № 5816-У (зарегистрировано Минюстом России 21 июля 2021 года, регистрационный № 64332).

клиринговых организаций, центральных контрагентов, центрального депозитария и репозитариев в части управления операционным риском» (зарегистрировано Минюстом России 29 ноября 2023 года, регистрационный № 76162) (далее – операционный риск).».

1.2. Пункт 2.5 дополнить абзацем следующего содержания:

«внесение данных о выявленных рисках клиринговой организации и результатах их оценки во внутренний документ клиринговой организации (далее – реестр рисков).».

1.3. Пункт 2.6 признать утратившим силу.

1.4. Пункт 4.1 дополнить абзацами следующего содержания:

«перечень процессов, нарушение которых вследствие воздействия событий реализации операционного риска влечет нарушение деятельности клиринговой организации, в том числе технологических процессов, требующих обеспечения информационного взаимодействия, обработки и хранения информации с помощью программно-технических средств клиринговой организации (далее – критически важный процесс);

перечень программно-технических средств, ошибки в функционировании которых влекут за собой нарушение критически важных процессов;

порядок проведения испытательных работ программно-технических средств и подготовки отчета по итогам проведенных испытательных работ;

контрольные показатели операционного риска, позволяющие отслеживать их изменения (контрольные показатели операционного риска клиринговой организации), и количественные показатели, направленные на измерение и контроль операционного риска в определенный момент времени (ключевые индикаторы операционного риска клиринговой организации);

порядок ведения реестра рисков и базы событий реализации операционного риска;

требования к организации функционирования резервного комплекса, функционально дублирующего основной комплекс программно-технических средств.».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 27 сентября 2023 года № ПСД-39) вступает в силу с 1 октября 2024 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина