



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

МИНИСТЕРСТВО ЮСТИЦИИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

регистрационный № 76164

от "29 ноября 2023".

УКАЗАНИЕ

«02» октября 2023 г.

№ 6560-У

Москва

**О внесении изменений
в Положение Банка России
от 30 декабря 2016 года № 575-П**

На основании части 2 статьи 6¹, пункта 12 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 30 декабря 2016 года № 575-П «О требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками, клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета, и методике определения выделенного капитала центрального контрагента»¹ следующие изменения:

1.1. Пункт 1.2 после слов «настоящим Положением» дополнить словами «, Положением Банка России от 2 октября 2023 года № 827-П «О требованиях к управлению рисками клиринговых организаций, центральных контрагентов, центрального депозитария и репозитариев в части управления операционным риском» (зарегистрировано Минюстом России 29 ноября 2023 года, регистрационный № 76162)».

1.2. В пункте 1.3 слова «главами 2–4» заменить словами «главами 2 и 4».

1.3. Главу 1 дополнить пунктом 1.6 следующего содержания:

¹ Зарегистрировано Минюстом России 20 марта 2017 года, регистрационный № 46034, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 15 марта 2018 года № 4740-У (зарегистрировано Минюстом России 5 июня 2018 года, регистрационный № 51286), от 9 июня 2021 года № 5813-У (зарегистрировано Минюстом России 15 июля 2021 года, регистрационный № 64281).

«1.6. Центральный контрагент в рамках организации системы управления рисками должен обеспечить ведение реестра данных о выявленных рисках центрального контрагента и результатах их оценки (далее – реестр рисков).».

1.4. Главу 3 признать утратившей силу.

1.5. В пункте 6.1:

абзац десятый признать утратившим силу;

абзац одиннадцатый изложить в следующей редакции:

«порядок ведения реестра рисков и базы событий реализации риска нарушения деятельности центрального контрагента в результате несовершенства внутренних бизнес-процессов центрального контрагента и (или) действий или бездействия работников центрального контрагента, ошибок в функционировании программно-технических средств центрального контрагента, а также в результате внешних событий и (или) действий или бездействия третьих лиц (далее – операционный риск);»;

абзац четырнадцатый изложить в следующей редакции:

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

дополнить абзацами следующего содержания:

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

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

контрольные показатели операционного риска, позволяющие отслеживать их изменения (контрольные показатели операционного риска центрального контрагента), и количественные показатели, направленные на измерение и контроль операционного риска в определенный момент времени (ключевые индикаторы операционного риска центрального контрагента).».

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