

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
(БАНК РОССИИ)**

**У К А З А Н И Е**

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2023 г.

№ \_\_\_\_\_-У

г. Москва

**О внесении изменений в Положение Банка России от 30.12.2016 № 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»**

На основании части 2 статьи 6<sup>1</sup>, пунктов 11 и 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 30.12.2016 № 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»<sup>1</sup> следующие изменения:

1.1. Дополнить пунктом 1.6 следующего содержания:

«1.6. Должностное лицо (отдельное структурное подразделение), ответственное за управление рисками центрального контрагента, в рамках

---

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

выявления рисков центрального контрагента должно осуществлять внесение выявленных рисков центрального контрагента и результатов их оценки, включая размер рисков центрального контрагента, во внутренний документ центрального контрагента (далее - реестр рисков).

Должностное лицо (отдельное структурное подразделение), ответственное за управление рисками центрального контрагента, должно вести реестр рисков в электронной форме на постоянной основе и пересматривать его с периодичностью и в порядке, которые установлены правилами управления рисками, в целях актуализации содержащихся в нем данных.».

1.2. Главу 3 признать утратившей силу.

1.3. В пункте 6.1:

абзац четвертый изложить в следующей редакции:

«порядок выявления, мониторинга и оценки рисков центрального контрагента (по каждому виду рисков, за исключением регуляторного риска);

порядок внесения рисков центрального контрагента и результатов их оценки, включая размер указанных рисков центрального контрагента, в реестр рисков, а также порядок осуществления оценки реестра рисков на предмет его актуальности, а в случае выявления в реестре рисков неактуальных сведений - порядок пересмотра реестра рисков;»;

абзацы восьмой – десятый изложить в следующей редакции:

«перечень процессов, отрицательное (негативное) воздействие событий операционного риска на которые и (или) приостановление которых вследствие реализации событий операционного риска влечёт нарушение осуществления лицензируемой деятельности центрального контрагента (далее – критически важный процесс);

перечень программно-технических средств, сбои и (или) ошибки в функционировании которых влекут за собой приостановление критически важных процессов финансовой организации и (или) оказывают иное неблагоприятное воздействие на критически важные процессы;

перечень показателей операционного риска центрального контрагента, характеризующих эффективность управления операционным риском

центрального контрагента;»;

абзацы двенадцатый и тринадцатый признать утратившими силу.

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от \_\_ \_\_\_\_ 20\_\_ года № ПСД- \_\_) вступает в силу с 1 октября 2024 года.

Председатель  
Центрального банка  
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина