

**ИНФОРМАЦИЯ О ПРИНИМАЕМЫХ РИСКАХ,
ПРОЦЕДУРАХ ИХ ОЦЕНКИ, УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ И КАПИТАЛОМ****по состоянию на 1 июля 2018 года**

Данная информация о принимаемых рисках, процедурах их оценки, управления рисками и капиталом за I полугодие 2018 года составлена в соответствии с Указанием Банка России от 07.08.2017 N 4482-У «О форме и порядке раскрытия кредитной организацией (головной кредитной организацией банковской группы) информации о принимаемых рисках, процедурах их оценки, управления рисками и капиталом»

Раздел I. Информация о структуре собственных средств (капитала)

Информация о структуре собственных средств (капитала) АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» содержится в разделах 1 и 5 формы 0409808 «Отчет об уровне достаточности капитала для покрытия рисков, величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам (публикуемая форма)» по состоянию на 01.07.2018г. (Приложение 1)

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» в 1 полугодии 2018 г. на ежедневной основе исполнял требования к капиталу.

Соотношение основного капитала АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» и собственных средств (капитала) за 1 полугодие 2018 г. составляет 66%.

Инновационные, сложные или гибридные инструменты собственных средств (капитала) отсутствуют.

К АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не применяется антициклическая надбавка в виду того, что требования Инструкции Банка России от 28.06.2017 N 180-И «Об обязательных нормативах банков» не распространяются на платежные небанковские кредитные организации.

В таблице 1.1 приведена сравнительная информация данных формы отчетности 0409806 «Бухгалтерский баланс» (Приложение 2), являющиеся источниками для составления раздела 1 отчета об уровне достаточности капитала, с элементами собственных средств (капитала) по состоянию на 01.07.2018 г..

Таблица 1.1.

Сопоставление данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками
для составления раздела 1 отчета об уровне достаточности капитала,
с элементами собственных средств (капитала)

| Номер | Бухгалтерский баланс | | | Отчет об уровне достаточности капитала (раздел 1 формы 0409808) | | |
|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|------------------------------------|
| | Наименование статьи | Номер строки | Данные на отчетную дату, тыс. руб. | Наименование показателя | Номер строки | Данные на отчетную дату, тыс. руб. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| 1 | "Средства акционеров (участников)", "Эмиссионный доход", всего, в том числе: | 24, 26 | 8097 | X | X | X |
| 1.1 | отнесенные в базовый капитал | X | | "Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный:" | 1 | 8097 |
| 1.2 | отнесенные в добавочный капитал | X | | "Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, классифицируемые как | 31 | 0 |
| 1.3 | отнесенные в дополнительный капитал | X | | "Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход" | 46 | 0 |
| 2 | "Средства кредитных организаций", "Средства клиентов, не являющихся кредитными организациями". всего, в том числе: | 15, 16 | 404008 | X | X | X |
| 2.1 | субординированные кредиты, отнесенные в добавочный капитал | X | | "Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, классифицируемые как | 32 | 0 |
| 2.2 | субординированные кредиты, отнесенные в дополнительный капитал | X | X | "Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход", всего | 46 | 0 |
| 2.2.1 | | X | | из них: субординированные кредиты | X | |

Таблица 1.1.

| | | | | | | |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|-------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------|
| 3 | "Основные средства, нематериальные активы и материальные запасы", всего, в том числе: | 10 | 16280 | X | X | X |
| 3.1 | нематериальные активы, уменьшающие базовый капитал всего, из них: | X | | X | X | X |
| 3.1.1 | деловая репутация (гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств (строка 5.1 настоящей таблицы) | X | | "Деловая репутация (гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств" (строка 5.1 настоящей таблицы) | 8 | 0 |
| 3.1.2 | иные нематериальные активы (кроме деловой репутации) за вычетом отложенных налоговых обязательств (строка 5.2 настоящей таблицы) | X | | "Нематериальные активы (кроме деловой репутации и сумм прав по обслуживанию ипотечных кредитов) за вычетом отложенных налоговых обязательств" (строка 5.2 настоящей таблицы) | 9 | 4810 |
| 3.2 | нематериальные активы, уменьшающие добавочный капитал | X | | "нематериальные активы", подлежащие поэтапному исключению | 41.1.1 | 0 |
| 4 | "Отложенный налоговый актив", всего, в том числе: | 9 | 0 | X | X | X |
| 4.1 | отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли | X | | "Отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли" | 10 | 0 |
| 4.2 | отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | X | | "Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли" | 21 | 0 |
| 5 | "Отложенные налоговые обязательства", всего, из них: | 20 | 0 | X | X | X |
| 5.1 | уменьшающие деловую репутацию (строка 3.1.1 настоящей таблицы) | X | | X | X | |
| 5.2 | уменьшающие иные нематериальные активы (строка 3.1.2 настоящей таблицы) | X | | X | X | |

Таблица 1.1.

| | | | | | | |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---|
| 6 | "Собственные акции (доли), выкупленные у акционеров (участников)", всего, в том числе: | 25 | 0 | X | X | X |
| 6.1 | уменьшающие базовый капитал | X | | "Вложения в собственные акции (доли)" | 16 | 0 |
| 6.2 | уменьшающие добавочный капитал | X | | "Вложения в собственные инструменты добавочного капитала", "собственные акции (доли), приобретенные (выкупленные) у акционеров (участников)", подлежащие поэтапному исключению | 37, 41.1.2 | 0 |
| 6.3 | уменьшающие дополнительный капитал | X | | "Вложения в собственные инструменты дополнительного | 52 | 0 |
| 7 | "Средства в кредитных организациях", "Чистая ссудная задолженность", "Чистые вложения в ценные бумаги и другие финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи", "Чистые вложения в ценные бумаги, удерживаемые до -----" в том числе: | 3, 5, 6, 7 | 41651 | X | X | X |
| 7.1 | несущественные вложения в базовый капитал финансовых организаций | X | | "Несущественные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций" | 18 | 0 |
| 7.2 | существенные вложения в базовый капитал финансовых организаций | X | | "Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций" | 19 | 0 |
| 7.3 | несущественные вложения в добавочный капитал финансовых организаций | X | | "Несущественные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций" | 39 | 0 |
| 7.4 | существенные вложения в добавочный капитал финансовых организаций | X | | "Существенные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций" | 40 | 0 |

Таблица 1.1

| | | | | | | |
|-----|-------------------------------------------------------------------------|---|--|-----------------------------------------------------------------------------------------|----|---|
| 7.5 | несущественные вложения в дополнительный капитал финансовых организаций | X | | "Несущественные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций" | 54 | 0 |
| 7.6 | существенные вложения в дополнительный капитал финансовых организаций | X | | "Существенные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций" | 55 | 0 |

Раздел II. Информация о системе управления рисками

Информация о требованиях (обязательствах), взвешенных по уровню риска, и о минимальном размере капитала, необходимом для покрытия рисков, тыс. руб.

Таблица 2.1.

| Номер | Наименование показателя | Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска | | Минимальный размер капитала, необходимый |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------|
| | | данные на отчетную дату | данные на предыдущую отчетную дату | данные на отчетную дату |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Кредитный риск (за исключением кредитного риска контрагента), всего, в том числе: | * | * | * |
| 2 | при применении стандартизированного подхода | * | * | * |
| 3 | при применении ПВР | неприменимо | | |
| 4 | Кредитный риск контрагента, всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 |
| 5 | при применении стандартизированного | 0 | 0 | 0 |
| 6 | при применении метода, основанного на внутренних моделях | неприменимо | | |
| 7 | Инвестиции в долевые ценные бумаги (акции, паи в паевых инвестиционных фондах) и доли участия в уставном капитале юридических лиц, не входящие в торговый портфель, при применении рыночного | 0 | 0 | 0 |
| 8 | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - сквозной подход | 0 | 0 | 0 |

Таблица 2.1.

| | | | | |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|---|---|
| 9 | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - мандатный подход | 0 | 0 | 0 |
| 10 | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - резервный подход | 0 | 0 | 0 |
| 11 | Риск расчетов | неприменимо | | |
| 12 | Риск секьюритизации (за исключением риска секьюритизации торгового портфеля), всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 |
| 13 | при применении ПВР, основанного на | неприменимо | | |
| 14 | при применении ПВР с использованием формулы надзора | неприменимо | | |
| 15 | при применении стандартизированного подхода | 0 | 0 | 0 |
| 16 | Рыночный риск, всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 |
| 17 | при применении стандартизированного | 0 | 0 | 0 |
| 18 | при применении метода, основанного на внутренних моделях | неприменимо | | |
| 19 | Операционный риск, всего, в том числе: | * | * | * |
| 20 | при применении базового индикативного подхода | * | * | * |
| 21 | при применении стандартизированного подхода | неприменимо | | |
| 22 | при применении продвинутого (усовершенствованного) подхода | неприменимо | | |
| 23 | Активы (требования) ниже порога существенности для вычета из собственных средств (капитала), взвешенные с коэффициентом 250% | | 0 | 0 |
| 24 | Минимальный размер корректировки на предельный размер снижения кредитного и операционного риска при применении ПВР и продвинутого (усовершенствованного) подхода | неприменимо | | |
| 25 | Итого (сумма строк 1 + 4 + 7 + 8 + 9 + 10 + 11 + 12 + 16 + 19 + 23 + 24) | * | 0 | 0 |

*) Информация о системе управления рисками, политике и процедурах, используемых в целях управления риском, и методах оценки риска описана в годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» за 2017 год, промежуточная отчетность не формируется. Информация опубликована на сайте mcc.elecsnet.ru.

Раздел III. Сопоставление данных годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности кредитной организации и данных отчетности, представляемой кредитной организацией в Банк России в целях надзора

Таблица 3.3.

Сведения об обремененных и необремененных активах, тыс.руб.

| Номер | Наименование показателя | Балансовая стоимость обремененных активов | | Балансовая стоимость необремененных активов | |
|-------|------------------------------------------------------|-------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|
| | | всего | в том числе по обязательствам перед Банком России | всего | в том числе пригодных для предоставления в качестве обеспечения Банку России |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 1 | Всего активов, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 | долевые ценные бумаги, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.1 | кредитных организаций | | | | |
| 2.2 | юридических лиц, не являющихся | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3 | долговые ценные в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.1 | кредитных организаций, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.1.1 | имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности | | | | |
| 3.1.2 | не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности | 0 | 0 | 0 | 0 |

Таблица 3.3.

| | | | | | |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------|---|---|---|---|
| 3.2 | юридических лиц, не в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.2.1 | имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.2.2 | не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности | | | | |
| 4 | Средства на корреспондентских счетах в кредитных организациях | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5 | Межбанковские кредиты (депозиты) | | | | |
| 6 | Ссуды, предоставленные юридическим лицам, не являющимся кредитными организациями | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7 | Ссуды, предоставленные физическим лицам | | | | |
| 8 | Основные средства | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 9 | Прочие активы | | | | |

У АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» отсутствуют обремененные и необремененные активы, в том числе предоставленные в качестве обеспечения по операциям Банка России.

Таблица 3.4.

Информация об операциях с контрагентами – нерезидентами, тыс.руб.

| Номер | Наименование показателя | Данные на отчетную дату | Данные на начало отчетного года |
|-------|----------------------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 | Средства на корреспондентских счетах в банках - нерезидентах | 0 | 0 |
| 2 | Ссуды, предоставленные контрагентам - нерезидентам, всего, в том числе: | 0 | 0 |
| 2.1 | банкам - нерезидентам | 0 | 0 |
| 2.2 | юридическим лицам - нерезидентам, не являющимся кредитными организациями | 0 | 0 |
| 2.3 | физическим лицам - нерезидентам | 0 | 0 |

Таблица 3.4.

| | | | |
|-----|------------------------------------------------------------------------|---|---|
| 3 | Долговые ценные бумаги эмитентов - нерезидентов, всего, в том числе: | 0 | 0 |
| 3.1 | имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности | 0 | 0 |
| 3.2 | не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности | 0 | 0 |
| 4 | Средства нерезидентов, всего, в том числе: | 0 | 0 |
| 4.1 | банков - нерезидентов | 0 | 0 |
| 4.2 | юридических лиц - нерезидентов, не являющихся кредитными организациями | 0 | 0 |
| 4.3 | физических лиц - нерезидентов | 0 | 0 |

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не осуществляет операции с контрагентами-нерезидентами.

Раздел IV. Кредитный риск¹

В случае возникновения (или угрозы возникновения) возможных убытков АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» формирует резервы на возможные потери в соответствии с Положением Банка России от 23.10.2017 № 611-П «О порядке формирования кредитными организациями резервов на возможные потери».

Фактически сформированные резервы на возможные потери на отчетную дату составили 14 488 тыс.руб. (или + 3 817 тыс.руб. за отчетный период).

Данные по форме Таблицы 4.1.1. «Информация о ценных бумагах, права на которые удостоверяются депозитариями, резервы на возможные потери по которым формируются в соответствии с Указанием Банка России от 17 ноября 2011 года N 2732-У «Об особенностях формирования кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с ценными бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями» не раскрываются, так как действующей лицензией на осуществление банковских операций АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не предусмотрено проведение операций с ценными бумагами.

Данные по форме Таблицы 4.1.2. «Активы и условные обязательства кредитного характера, классифицированные в более высокую категорию качества, чем это предусмотрено критериями оценки кредитного риска Положения Банка России № 590-П и Положением Банка России № 283-П» не раскрываются, так как у АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» на отчетную дату отсутствуют активы и условные обязательства кредитного характера, классифицированные в более высокую категорию качества, чем

¹ Информация о системе управления рисками, политике и процедурах, используемых в целях управления риском, и методах оценки риска описана в годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» за 2017 год и в промежуточной отчетности не приводится. Информация опубликована на сайте mcc.elecsnet.ru.

это предусмотрено критериями оценки кредитного риска Положения Банка России № 590-П и Положением Банка России № 611-П.

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не применяет в целях регуляторной оценки достаточности капитала подход на основе внутренних рейтингов (ПФР) и в связи с этим не раскрывает информацию по форме Таблицы 4.8 «Изменения величины требований (обязательств), взвешенных по уровню риска, при применении ПВР» (разрешение на применение ПФР в регуляторных целях отсутствует).

Раздел V. Кредитный риск контрагента

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не осуществляет операции с ПФИ и не раскрывает информацию, предусмотренную разделом V.

Раздел VI. Риск секьюритизации

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не осуществляет операции секьюритизации и не раскрывает информацию, предусмотренную разделом VI.

Раздел VII. Рыночный риск

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не раскрывает информацию в данном разделе, так как не подвержена указанному риску поскольку отсутствуют связанные с этим риском операции.

Раздел VIII. Информация о величине операционного риска

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» при управлении операционным риском руководствуется Указанием Банка России от 25.06.2012 N 2840-У «О требованиях к управлению операционным риском небанковскими кредитными организациями, имеющими право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций».

Информация о способах управления операционным риском, о величине требований к капиталу отражена в разделе 24 Пояснительной записки к годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности за 2017 год, опубликованной на официальном сайте АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» mcc.elecsnet.ru.

Раздел IX. Информация о величине процентного риска банковского портфеля

У АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» на отчетную дату отсутствуют финансовые инструменты, подверженные процентному риску, в связи с этим не раскрывает информацию в данном разделе.

Раздел X. Информация о величине риска ликвидности

Глава 14. Информация о нормативе краткосрочной ликвидности

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» не является системно значимой кредитной организацией и не осуществляет расчет норматива краткосрочной ликвидности.

Раздел XI. Финансовый рычаг и обязательные нормативы кредитной организации (банковской группы)

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» имеет статус платежной небанковской кредитной организации, на которые не распространяется действие Инструкция Банка России от 28.06.2017 № 180-И «Об обязательных нормативах банков» в части необходимости расчета норматива финансового рычага.

Согласно Инструкции Банка России от 15.09.2011 N 137-И «Об обязательных нормативах небанковских кредитных организаций, имеющих право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций, и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением» АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР» рассчитывает и соблюдает на ежедневной основе следующие обязательные нормативы, которые на 01.07.2018 составили:

- Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.3. составил 10,191 %, при минимально допустимом значении 2 %;
- Норматив ликвидности Н15.1– 125.103 %, при минимально допустимом значении 100 %.

23 августа 2018 г.

Генеральный директор

А.В. Жадобин

Главный бухгалтер

Г.М. Заббарова



Раздел 1. Информация об уровне достаточности капитала Отчета об уровне достаточности капитала для покрытия рисков (публикуемая форма) по состоянию на 01.07.18 г.

| Номер строки | Наименование инструмента (показателя) | Номер пояснения | Стоимость инструмента (величина показателя) на отчетную дату | Стоимость инструмента (величина показателя) на начало отчетного года | Ссылка на статьи бухгалтерского баланса (публикуемая форма), являющиеся источниками элементов капитала |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Источники базового капитала | | | | | |
| 1 | Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный: | | 8097.0000 | 8097.0000 | 24 |
| 1.1 | обыкновенными акциями (долями) | | 8097.0000 | 8097.0000 | 24 |
| 1.2 | привилегированными акциями | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 2 | Нераспределенная прибыль (убыток): | | 76648.0000 | 46403.0000 | |
| 2.1 | прошлых лет | | 47286.0000 | 49660.0000 | 33 |
| 2.2 | отчетного года | | 29362.0000 | -3257.0000 | |
| 3 | Резервный фонд | | 5550.0000 | 5550.0000 | 27 |
| 4 | Доли уставного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 5 | Инструменты базового капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 6 | Источники базового капитала, итого (строка 1 +/- строка 2 + строка 3 - строка 4 + строка 5) | | 90295.0000 | 60050.0000 | |
| Показатели, уменьшающие источники базового капитала | | | | | |
| 7 | Корректировка торгового портфеля | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 8 | Деловая репутация (Гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 9 | Нематериальные активы (кроме деловой репутации и сумм прав по обслуживанию почечных кредитов) за вычетом отложенных налоговых обязательств | | 4810.0000 | 3186.0000 | |
| 10 | Отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 11 | Резервы хеджирования денежных потоков | | 0.0000 | 0.0000 | |

АО НКО «МОСКЛИРИНГЦЕНТР»



**NON-BANKING CREDIT
ORGANIZATION «MOSCOW
CLEARING CENTRE» Joint Stock
Company**

123557, Россия, Москва, Электрический пер., 3/10, стр. 1;
Тел. (495) 662-1500; Факс (495) 287-2959

Building 1, 3/10, Elektrichesky side St., 123557 Moscow,
Russia;
Tel.: (495) 662-1500; Fax (495) 287-2959

| | | | | | |
|--------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------------|--------------|--------------|
| 12 | Недосозданные резервы на возможные потери | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 13 | Доход от сделок секьюритизации | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 14 | Доходы и расходы, связанные с изменением кредитного риска по обязательствам, оцениваемым по справедливой стоимости | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 15 | Активы пенсионного плана с установленными выплатами | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 16 | Вложения в собственные акции (доляжи) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 17 | Встречные вложения кредитной организации и финансовой организации в инструменты базового капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 18 | Неущественные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 19 | Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 20 | Права по обслуживанию ипотечных кредитов | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 21 | Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 22 | Совокупная сумма существенных вложений и отложенных налоговых активов в части, превышающей 15 процентов от величины базового капитала, всего, в том числе: | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 23 | существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 24 | права по обслуживанию ипотечных кредитов | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 25 | отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 26 | Иные показатели, уменьшающие источники базового капитала, установленные Банком России | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 27 | Отрицательная величина добавочного капитала | | 0.0000 | 797.0000 | |
| 28 | Показатели, уменьшающие источники базового капитала, итого (сумма строк с 7 по 22 и строк 26, 27) | | 4810.0000 | 3983.0000 | |
| 29 | Базовый капитал, итого (строка 6- строка 28) | | 85485.0000 | 56067.0000 | |
| Источники добавочного капитала | | | | | |
| 30 | Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, всего, в том числе: | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 31 | классифицируемые как капитал | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 32 | классифицируемые как обязательства | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 33 | Инструменты добавочного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 34 | Инструменты добавочного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе: | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 35 | инструменты добавочного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 36 | Источники добавочного капитала, итого (строка 30 + строка 33 + строка 34) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала | | | | | |
| 37 | Вложения в собственные инструменты добавочного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 38 | Встречные вложения кредитной организации и финансовой | | | | |

| | | | | | |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--|
| | организации в инструменты добавочного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 39 | Несущественные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 40 | Существенные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 41 | Иные показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, установленные Банком России | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 42 | Отрицательная величина дополнительного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 43 | Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, (сумма строк с 37 по 42) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 44 | Добавочный капитал, итого (строка 36 - строка 43) | | 0.0000 | | |
| 45 | Основной капитал, итого (строк 29 + строка 44) | | 85485.0000 | 56067.0000 | |
| Источники дополнительного капитала | | | | | |
| 46 | Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 47 | Инструменты дополнительного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 48 | Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе: | не применимо | не применимо | не применимо | |
| 49 | Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | не применимо | не применимо | не применимо | |
| 50 | Резервы на возможные потери | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 51 | Источники дополнительного капитала, итого (строка 46 + строка 47 + строка 48 + строка 50) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала | | | | | |
| 52 | Вложения в собственные инструменты дополнительного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 53 | Встречные вложения кредитной организации и финансовой организации в инструменты дополнительного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 54 | Несущественные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 55 | Существенные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 56 | Иные показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, установленные Банком России, всего, в том числе: | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 56.1 | просроченная дебиторская задолженность длительностью свыше 30 календарных дней | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 56.2 | превышение совокупной суммы кредитов, банковских гарантий и оручительств, предоставленных своим акционерам (участникам) и инсайдерам, над ее максимальным размером | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 56.3 | вложения в сооружение и приобретение основных средств и материальных запасов | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 56.4 | разница между действительной стоимостью доли, причитающейся вышедшим из общества участникам, и стоимостью, по которой доля была реализована другому участнику | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 57 | Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, итого (сумма строк с 52 по 56) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 58 | Дополнительный капитал, итого (строка 51 - строка 57) | | 0.0000 | 0.0000 | |

| | | | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------------|--------------|--------------|
| 59 | Собственные средства (капитал), итого (строка 45 + строка 58) | | 85485.0000 | 56067.0000 | |
| 60 | Активы, взвешенные по уровню риска: | | X | X | X |
| 60.1 | необходимые для определения достаточности базового капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 60.2 | необходимые для определения достаточности основного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 60.3 | необходимые для определения достаточности собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Показатели достаточности собственных средств (капитала) и надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), процент | | | | | |
| 61 | Достаточность базового капитала (строка 29 : строка 60.1) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 62 | Достаточность основного капитала (строка 45 : строка 60.2) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 63 | Достаточность собственных средств (капитала) (строка 59 : строка 60.3) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 64 | Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего, в том числе: | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 65 | надбавка поддержания достаточности капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 66 | антициклическая надбавка | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 67 | надбавка за системную значимость банков | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 68 | Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Нормативы достаточности собственных средств (капитала), процент | | | | | |
| 69 | Норматив достаточности базового капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 70 | Норматив достаточности основного капитала | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 71 | Норматив достаточности собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Показатели, не превышающие установленные пороги существенности и не принимаемые в уменьшение источников капитала | | | | | |
| 72 | Несущественные вложения в инструменты капитала финансовых организаций | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 73 | Существенные вложения в инструменты базового капитала внутренних моделей | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 74 | Права по обслуживанию ипотечных кредитов | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 75 | Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | 0.0000 | 0.0000 | |
| Ограничения на включение резервов на возможные потери в расчет дополнительного капитала | | | | | |
| 76 | Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополнительного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется стандартизованный подход | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 77 | Ограничения на включение в расчет дополнительного капитала сумм резервов на возможные потери при использовании стандартизованного подхода | | не применимо | не применимо | не применимо |
| 78 | Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополнительного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется подход на основе внутренних моделей | | 0.0000 | 0.0000 | |
| 79 | Ограничения на включение в расчет дополнительного капитала сумм резервов на возможные потери при использовании подхода на основе внутренних моделей | | 0.0000 | 0.0000 | |

| Инструменты, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) (применяется с 1 января 2018 года по 1 января 2022 года) | | | | |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------|--------|
| 80 | Текущее ограничение на включение в состав источников базового капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 |
| 81 | Часть инструментов, не включенная в состав источников базового капитала вследствие ограничения | | 0.0000 | 0.0000 |
| 82 | Текущее ограничение на включение в состав источников добавочного капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 |
| 83 | Часть инструментов, не включенная в состав источников добавочного капитала вследствие ограничения | | 0.0000 | 0.0000 |
| 84 | Текущее ограничение на включение в состав источников дополнительного капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | 0.0000 | 0.0000 |
| 85 | Часть инструментов, не включенная в состав источников дополнительного капитала вследствие ограничения | | 0.0000 | 0.0000 |

Примечание.

Сведения о данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками для составления раздела 1 Отчета, приведены в таблице N раздела I "Информация о структуре собственных средств (капитала)" информации о применяемых процедурах управления рисками и капиталом, раскрытой

Раздел 1(1). Информация об уровне достаточности капитала

| Номер строки | Наименование инструмента (показателя) | Номер пояснения | Стоимость инструмента (величина показателя) на отчетную дату, тыс.руб. | Стоимость инструмента (величина показателя) на начало отчетного года, тыс.руб. |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------|------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный: | | | |
| 1.1 | обыкновенными акциями (долями) | | | |
| 1.2 | привилегированными акциями | | | |
| 2 | Нераспределенная прибыль (убыток): | | | |
| 2.1 | прошлых лет | | | |
| 2.2 | отчетного года | | | |
| 3 | Резервный фонд | | | |
| 4 | Источники базового капитала, итого (строка 1 +/- строка 2 + строка 3) | | | |
| 5 | Показатели, уменьшающие источники базового капитала, всего, в том числе: | | | |
| 5.1 | недосозданные резервы на возможные потери | | | |
| 5.2 | вложения в собственные акции (доли) | | | |
| 5.3 | отрицательная величина добавочного капитала | | | |
| 6 | Базовый капитал | | | |

| | | | | | | | | | |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

Раздел 5. Продолжение

| N п.п. / Наименование характеристики инструмента | Регулятивные условия | | | | | | | Проценты/дивиденды/купонный доход | | | | |
|-----------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | Классификация инструмента для целей бухгалтерского учета | Дата выпуска (привлечения, размещения) инструмента | Наличие срока по инструменту | Дата погашения инструмента | Наличие права досрочного выкупа (погашения) инструмента, согласованного с Банком России | Первоначальная дата (даты) возможной реализации права досрочного выкупа (погашения) инструмента, условия такого права и сумма выкупа (погашения) | Последующая дата (даты) возможной реализации права досрочного выкупа (погашения) инструмента | Тип ставки по инструменту | Ставка | Наличие условий прекращения выплаты дивидендов по обыкновенным акциям | Обязательность выплат дивидендов | Наличие условий, предусматривающих увеличение платежей по инструменту или иных стимулов к досрочному выкупу (погашению) инструмента |
| | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20 | 21 |

Раздел 5. Продолжение

| N п.п. / Наименование характеристики инструмента | Проценты/дивиденды/купонный доход | | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|----------------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------|
| | Характер выплат | Конвертируемость инструмента | Условия, при наступлении которых осуществляется конвертация инструмента | Полная либо частичная конвертация | Ставка конвертации | Обязательность конвертации | Уровень капитала, в инструмент которого конвертируется инструмент | Сокращенное фирменное наименование инструмента, в который конвертируется инструмент | Возможность списания инструмента на покрытие убытков | Условия, при наступлении которых осуществляется списание инструмента | Полное или частичное списание | Постоянное или временное списание |
| | 22 | 23 | 24 | 25 | 26 | 27 | 28 | 29 | 30 | 31 | 32 | 33 |

Раздел 5. Продолжение

| N п.п. / Наименование характеристики инструмента | Механизм восстановления | Субординированность инструмента | Соответствие требованиям Положения Банка России N 395-П и Положения Банка России N 509-П | Описание несоответствий |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| | 34 | 35 | 36 | 37 |

Отчет по форме ОКУД 0409806

Кредитной организации
 НЕБАНКОВСКАЯ КРЕДИТНАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ МОСКОВСКИЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР (АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)
 / АО НКО МОСКЛИРИНГЦЕНТР
 Адрес (место нахождения) кредитной организации
 123557, г. Москва, Электрический пер., д.3/10, стр.1

Код формы по ОКУД 0409806
 Квартальная (Годовая)

| Номер строки | Наименование статьи | Номер пояснений | Данные за отчетный период, тыс. руб. | Данные за предыдущий отчетный год, тыс. руб. |
|-------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| I. АКТИВЫ | | | | |
| 11 | Денежные средства | | 781714 | 989180 |
| 12 | Средства кредитной организации в Центральном банке Российской Федерации | | 82437 | 47792 |
| 12.1 | Обязательные резервы | | 0 | 8316 |
| 13 | Средства в кредитных организациях | | 41651 | 144021 |
| 14 | Финансовые активы, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток | | 0 | 0 |
| 15 | Чистая ссудная задолженность | | 0 | 0 |
| 16 | Чистые вложения в ценные бумаги и другие финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи | | 0 | 0 |
| 16.1 | Инвестиции в дочерние и зависимые организации | | 0 | 0 |
| 17 | Чистые вложения в ценные бумаги, удерживаемые до погашения | | 0 | 0 |
| 18 | Требования по текущему налогу на прибыль | | 3743 | 3755 |
| 19 | Отложенный налоговый актив | | 0 | 0 |
| 10 | Основные средства, нематериальные активы и материальные запасы | | 16280 | 21809 |
| 11 | Долгосрочные активы, предназначенные для продажи | | 0 | 0 |
| 12 | Прочие активы | | 43721 | 155558 |
| 13 | Всего активов | | 969546 | 1362115 |
| II. ПАССИВЫ | | | | |
| 14 | Кредиты, депозиты и прочие средства Центрального банка Российской Федерации | | 0 | 0 |
| 15 | Средства кредитных организаций | | 395407 | 625153 |
| 16 | Средства клиентов, не являющихся кредитными организациями | | 8601 | 10979 |
| 16.1 | Вклады (средства) физических лиц в том числе индивидуальных предпринимателей | | 0 | 0 |
| 17 | Финансовые обязательства, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток | | 0 | 0 |
| 18 | Выпущенные долговые обязательства | | 0 | 0 |
| 19 | Обязательства по текущему налогу на прибыль | | 0 | 0 |
| 20 | Отложенные налоговые обязательства | | 0 | 0 |
| 21 | Прочие обязательства | | 474485 | 665050 |
| 22 | Резервы на возможные потери по условным обязательствам кредитного характера, прочим возможным потерям и операциям с резидентами офшорных зон | | 0 | 0 |
| 23 | Всего обязательств | | 878493 | 1301182 |
| III. ИСТОЧНИКИ СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ | | | | |
| 24 | Средства акционеров (участников) | | 8097 | 8097 |
| 25 | Собственные акции (доли), выкупленные у акционеров (участников) | | 0 | 0 |
| 26 | Эмиссионный доход | | 0 | 0 |
| 27 | Резервный фонд | | 5550 | 5550 |
| 28 | Переоценка по справедливой стоимости ценных бумаг, имеющихся в наличии для продажи, уменьшенная на отложенное налоговое обязательство (увеличенная на отложенный налоговый актив) | | 0 | 0 |
| 29 | Переоценка основных средств и нематериальных активов, уменьшенная на отложенное налоговое обязательство | | 0 | 0 |
| 30 | Переоценка обязательств (требований) по выплате долгосрочных вознаграждений | | 0 | 0 |
| 31 | Переоценка инструментов хеджирования | | 0 | 0 |

| | | | |
|---------------------------------|----------------------------------------------------------------------|-------|---------|
| 132 | Денежные средства безвозмездного финансирования (вклады в имущество) | 30000 | 106000 |
| 133 | Нераспределенная прибыль (непокрытые убытки) прошлых лет | 47286 | 49660 |
| 134 | Неиспользованная прибыль (убыток) за отчетный период | 120 | -108374 |
| 135 | Всего источников собственных средств | 91053 | 60933 |
| IV. ВНЕБАЛАНСОВЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА | | | |
| 136 | Безотзывные обязательства кредитной организации | 0 | 0 |
| 137 | Выданные кредитной организацией гарантии и поручительства | 0 | 0 |
| 138 | Условные обязательства некредитного характера | 0 | 0 |