

|   |               |
|---|---------------|
| Код территории по ОКАТО                               | 45286585000   |
| Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН)       | 7703622255    |
| Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) | 1077746005666 |

## РАСЧЕТ СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ

по состоянию на 31 марта 2021 г.

Полное/сокращенное фирменные наименования профессионального участника

Общество с ограниченной ответственностью «Меррилл Линч Секьюритиз» / ООО «Меррилл Линч Секьюритиз»

Почтовый адрес: 107031, г. Москва, ул.Петровка, д.№7

### Раздел I. Информация о величине минимального размера собственных средств профессионального участника рынка ценных бумаг

| Минимальный размер собственных средств, руб. | Значение величины "X", руб. | Значение добавочного коэффициента |
|--|-----------------------------|-----------------------------------|
| 1  | 2                           | 3                                 |
| 15,000,000.00                                | 2,000,000.00                | 7.5                               |

### Раздел II. Расчет размера собственных средств профессионального участника рынка ценных бумаг

| Код строки    | Наименование показателя  | Стоимость, руб.  |
|---------------|--|------------------|
| 1             | 2  | 3                |
| <b>АКТИВЫ</b> |  |                  |
| 1.1           | Денежные средства профессионального участника, находящиеся в кассе   | 10,642.41        |
| 1.2           | Денежные средства профессионального участника и его клиентов, находящиеся на его расчетных счетах и специальных банковских счетах в кредитных организациях и иностранных банках  | 1,597,659,095.78 |
| 1.3           | Денежные средства профессионального участника во вкладах (депозитах) в кредитных организациях и иностранных банках (за исключением субординированных депозитов), а также суммы процентов, причитающихся по вкладу (депозиту) на расчетную дату               |                  |
| 1.4           | Драгоценные металлы профессионального участника во вкладах (депозитах) в кредитных организациях и иностранных банках, а также суммы процентов, причитающихся по вкладу (депозиту) на расчетную дату  |                  |
| 1.5           | Драгоценные металлы профессионального участника на его счетах в кредитных организациях   |                  |
| 1.6           | Денежные средства профессионального участника, переданные по договору доверительного управления управляющему и (или) иностранному лицу, имеющему право в соответствии с его личным законом осуществлять деятельность по управлению ценными бумагами          |                  |
| 1.7           | Денежные средства профессионального участника и его клиентов, переданные по договору о брокерском обслуживании брокеру и (или) иностранному лицу   |                  |
| 1.8           | Денежные средства профессионального участника и его клиентов, переданные в обеспечение исполнения обязательств профессионального участника и (или) его клиентов, включая индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение                               | 793,585,496.89   |
| 1.9           | Драгоценные металлы профессионального участника, переданные в обеспечение исполнения обязательств профессионального участника, включая индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение   |                  |
| 1.10          | Ценные бумаги профессионального участника, переданные в обеспечение исполнения обязательств профессионального участника, включая индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение   |                  |
| 1.11          | Дебиторская задолженность по выплате профессиональному участнику вознаграждений и возмещению расходов по договорам о возмездном оказании услуг   | 226,079,381.52   |
| 1.12          | Дебиторская задолженность по плате, взимаемой регистратором с зарегистрированных лиц за проведение операций по лицевым счетам и за предоставление информации из реестра владельцев ценных бумаг (для профессиональных участников, являющихся регистраторами) |                  |

|   |   |                         |
|---|---|-------------------------|
| 1.13                                    | Маржинальные займы, предоставленные клиентам профессионального участника, имеющего лицензию на осуществление брокерской деятельности, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории клиентов с особым уровнем риска   |                         |
| 1.14                                    | Маржинальные займы, предоставленные клиентам профессионального участника, имеющего лицензию на осуществление брокерской деятельности, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории клиентов со стандартным уровнем риска или категории клиентов с повышенным уровнем риска |                         |
| 1.15                                    | Акции российских эмитентов, являющихся публичными акционерными обществами, и акции иностранных эмитентов, а также депозитарные расписки на них  |                         |
| 1.16                                    | Облигации российских и иностранных эмитентов, за исключением субординированных и структурных облигаций  |                         |
| 1.17                                    | Инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов, а также ценные бумаги иностранных эмитентов, которые в соответствии с их личным законом относятся к схемам коллективного инвестирования или схемам совместного инвестирования как с образованием, так и без образования юридического лица                |                         |
| 1.18                                    | Иные финансовые активы, предусмотренные подпунктом 2.1.15 подпункта 2.1 Указания Банка России   |                         |
| 1.19                                    | Отложенные налоговые активы профессионального участника в сумме, не превышающей отложенных налоговых обязательств профессионального участника   |                         |
| 1.20                                    | Недвижимое имущество профессионального участника, используемое для осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и (или) для его управленческих нужд, принятое профессиональным участником к бухгалтерскому учету в качестве основных средств   |                         |
| <b>СУММАРНАЯ СТОИМОСТЬ АКТИВОВ</b>      |   | <b>2,617,334,616.60</b> |
| <b>ОБЯЗАТЕЛЬСТВА</b>                    |   |                         |
| 1.21                                    | Финансовые обязательства, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток, в том числе:  |                         |
| 1.22                                    | Расчет размера собственных средств профессионального участника рынка ценных бумаг: финансовые обязательства, в обязательном порядке классифицируемые как оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток   |                         |
| 1.23                                    | финансовые обязательства, классифицируемые как оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток по усмотрению некредитной финансовой организации  |                         |
| 1.24                                    | <i>Финансовые обязательства, оцениваемые по амортизированной стоимости, в том числе:</i>  | 799,729,012.59          |
| 1.25                                    | Средства клиентов   | 772,228,848.29          |
| 1.26                                    | Кредиты, займы и прочие привлеченные средства   | 1,040,329.42            |
| 1.27                                    | Выпущенные долговые ценные бумаги   |                         |
| 1.28                                    | Кредиторская задолженность  | 26,459,834.88           |
| 1.29                                    | Обязательства выбывающих групп, классифицированных как предназначенные для продажи  |                         |
| 1.30                                    | Обязательства по вознаграждениям работникам по окончании трудовой деятельности, не ограниченным фиксируемыми платежами  |                         |
| 1.31                                    | Обязательство по текущему налогу на прибыль   |                         |
| 1.32                                    | Отложенные налоговые обязательства  |                         |
| 1.33                                    | Резервы - оценочные обязательства   |                         |
| 1.34                                    | Прочие обязательства  | 156,349,416.50          |
| <b>СУММАРНАЯ СТОИМОСТЬ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ</b> |   | <b>956,078,429.09</b>   |
| <b>РАЗМЕР СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ</b>       |   | <b>1,661,256,187.51</b> |