

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

РАСЧЕТ РАЗМЕРА СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ

по состоянию на 29.02.2016 г.

Полное/сокращенное фирменные наименования профессионального участника Общество с ограниченной ответственностью «Меррилл Линч Секьюритиз»/ООО «Меррилл Линч Секьюритиз»

Код формы по ОКУД 0420413  
Месячная

| Наименование показателя  | Код строки | Стоимость, руб. | Коэффициент | Стоимость с учетом коэффициента, руб. |
|--|------------|-----------------|-------------|---------------------------------------|
| 1  | 2          | 3               | 4           | 5                                     |
| <b>СТОИМОСТЬ АКТИВОВ</b>   |            |                 |             |                                       |
| <b>Внеоборотные активы</b>   |            |                 |             |                                       |
| Недвижимое имущество   | 010        | 0               | 1           | 0                                     |
| Программно-аппаратные средства   | 020        | 9 813 012,8     | 1           | 9 813 012,8                           |
| Транспортные средства  | 030        | 0               | 1           | 0                                     |
| Незавершенное строительство  | 040        | 0               | 0,5         | 0                                     |
| Доходные вложения в материальные ценности  | 050        | 0               | 0,5         | 0                                     |
| Итого по строкам 010 – 050   | 060        | 9 813 012,8     | X           | 9 813 012,8                           |
| <b>Программные средства (за вычетом амортизации)</b>   |            |                 |             |                                       |
| Исключительные права на программы ЭВМ и базы данных (за вычетом амортизации)   | 070        | 0               | 1           | 0                                     |
| Программы ЭВМ и базы данных, на которые организация не имеет исключительных прав   | 080        | 0               | 1           | 0                                     |
| Итого по строкам 070 – 080   | 090        | 0               | X           | 0                                     |
| <b>Отложенные налоговые активы и налог на добавленную стоимость</b>  |            |                 |             |                                       |
| Налог на добавленную стоимость по приобретенным ценностям, за исключением налога на добавленную стоимость по приобретенным ценностям по операциям с имуществом, составляющим закрытый инвестиционный фонд, под управлением организации | 100        | 16 242 034,07   | 1           | 16 242 034,07                         |
| Отложенные налоговые активы  | 110        | 0               | 1           | 0                                     |
| Итого по строкам 100 – 110   | 120        | 16 242 034,07   | X           | 16 242 034,07                         |
| <b>Финансовые вложения</b>   |            |                 |             |                                       |
| Ценные бумаги, включенные в котировальные списки российских фондовых бирж  | 130        | 0               | 1           | 0                                     |
| Ценные бумаги, допущенные к торгам российского организатора торговли на рынке ценных бумаг без прохождения процедуры листинга, за исключением ценных бумаг, предусмотренных в строке 160   | 140        | 0               | 1           | 0                                     |
| Ценные бумаги, не допущенные к торгам российского организатора торговли на рынке ценных бумаг, за исключением ценных бумаг, предусмотренных в строке 160   | 150        | 0               | 0,5         | 0                                     |
| Ценные бумаги аффилированных лиц, за исключением ценных бумаг, включенных в котировальные списки российских фондовых бирж и акций инфраструктурных организаций   | 160        | 0               | 0,1         | 0                                     |
| Доли организации в уставных (складочных) капиталах инфраструктурных организаций  | 170        | 0               | 0,5         | 0                                     |
| Займы, предоставленные организацией для приобретения ценных бумаг при их размещении, если организация оказывает эмитенту указанных ценных бумаг услуги по их размещению и (или) по организации их размещения                           | 180        | 0               | 1           | 0                                     |
| Займы, предоставленные для приобретения ценных бумаг у лица, которому организация оказывает услуги по их продаже   | 190        | 0               | 1           | 0                                     |
| Займы, предоставленные по маржинальным сделкам   | 200        | 0               | 1           | 0                                     |
| Иные займы, предоставленные организацией   | 210        | 0               | 0,1         | 0                                     |
| Банковские вклады, за исключением банковских вкладов в кредитных организациях, аффилированных с организацией   | 220        | 0               | 1           | 0                                     |
| Банковские вклады в кредитных организациях, аффилированных с организацией, за исключением банковских вкладов, указанных в строке 240   | 230        | 0               | 0,5         | 0                                     |
| Банковские вклады в кредитных организациях, аффилированных с организацией (только для инфраструктурных организаций)  | 240        | 0               | 1           | 0                                     |
| Права требования к кредитной организации выплатить денежный эквивалент стоимости драгоценного металла по текущему курсу  | 250        | 0               | 1           | 0                                     |
| Иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в соответствии с законодательством Российской Федерации в качестве ценных бумаг  | 260        | 0               | 1           | 0                                     |
| Итого по строкам 130 – 260   | 270        | 0               | X           | 0                                     |
| <b>Дебиторская задолженность</b>   |            |                 |             |                                       |
| Права (требования) по сделкам, совершенным за счет клиентов организации  | 280        | 0               | 1           | 0                                     |
| Сумма требований по поставке ценных бумаг, включенных в котировальные списки российской фондовой биржи, за исключением задолженности, предусмотренной в строке 280   | 290        | 0               | 1           | 0                                     |

|  |     |                  |     |                  |
|--|-----|------------------|-----|------------------|
| Сумма требований по поставке ценных бумаг, допущенных к торгам российского организатора торговли на рынке ценных бумаг без прохождения процедуры листинга, за исключением задолженности, предусмотренной в строках 280 и 310   | 300 | 0                | 1   | 0                |
| Сумма требований по поставке ценных бумаг, выпущенных (выданных) лицом, аффилированным с организацией, за исключением задолженности, предусмотренной в строках 280 и 290   | 310 | 0                | 0,1 | 0                |
| Сумма требований по поставке иностранных финансовых инструментов, квалифицированных в соответствии с законодательством Российской Федерации в качестве ценных бумаг, за исключением  | 320 | 0                | 1   | 0                |
| Сумма требований по поставке иностранных финансовых инструментов, квалифицированных в соответствии с законодательством Российской Федерации в качестве ценных бумаг, выпущенных (выданных) лицом, аффилированным с организацией  | 330 | 0                | 0,1 | 0                |
| Сумма требований по оплате ценных бумаг, переданных организацией по сделке с ценными бумагами, а также по перечислению денежных средств в счет сделки с иностранными финансовыми инструментами, квалифицированными в соответствии с законодательством Российской Федерации в качестве ценных бумаг, за исключением задолженности, предусмотренной в строке 280   | 340 | 0                | 1   | 0                |
| Остаток денежных средств организации (клиентов организации-брокера), переданных по договорам на брокерское обслуживание, в пределах которого могут быть осуществлены расчеты по сделкам, совершенным за счет организации (клиентов организации-брокера) без предоставления ей в заем   | 350 | 0                | 1   | 0                |
| Денежные средства организации, находящиеся в доверительном управлении  | 360 | 0                | 1   | 0                |
| Дебиторская задолженность по возврату клиринговыми организациями средств, переданных им в качестве обеспечения исполнения заключенных организацией сделок  | 370 | 1 471 801 634,02 | 1   | 1 471 801 634,02 |
| Дебиторская задолженность по возврату средств, переданных в качестве взносов в фонды, созданные клиринговой  | 380 | 20 000 000       | 1   | 20 000 000       |
| Займы, предоставленные по маржинальным сделкам   | 390 | 0                | 1   | 0                |
| Начисленное, но не удержанное вознаграждение по договору доверительного управления   | 400 | 0                | 1   | 0                |
| Задолженность, возникшая в результате использования организацией собственных денежных средств для выплаты денежной компенсации владельцам инвестиционных паев  | 410 | 0                | 1   | 0                |
| Начисленные, но не удержанные средства по возмещению необходимых расходов по договору доверительного управления  | 420 | 0                | 1   | 0                |
| Задолженность клиентов организации по депозитарным договорам, договорам по оплате услуг специализированного депозитария, по договорам на ведение реестра ипотечного покрытия   | 430 | 0                | 1   | 0                |
| Дебиторская задолженность по договорам на ведение реестра именных ценных бумаг, реестра владельцев инвестиционных паев, реестра владельцев ипотечных сертификатов участия  | 440 | 0                | 1   | 0                |
| Дебиторская задолженность по выплате вознаграждения организации по договору о брокерском обслуживании  | 450 | 25 109 744,21    | 1   | 25 109 744,21    |
| Задолженность клиентов организации по оплате ее услуг, связанных с организацией торговли, распространением информации о результатах торгов и обеспечением допуска к участию в торгах   | 460 | 0                | 1   | 0                |
| Задолженность клиентов организации по оплате ее услуг, связанных с осуществлением клиринговой деятельности   | 470 | 0                | 1   | 0                |
| Иная задолженность по выплате организации вознаграждений и возмещению расходов по  | 480 | 295 607 642,64   | 1   | 295 607 642,64   |
| Накопленный купонный доход по облигациям   | 490 | 0                | 1   | 0                |
| Прочая дебиторская задолженность   | 500 | 0                | 1   | 0                |
| Итого по строкам 280 – 510   | 510 | 1 812 519 020,87 | X   | 1 812 519 020,87 |
| <b>Денежные средства</b>   |     |                  |     |                  |
| Денежные средства организации, находящиеся в кассе, на расчетных счетах и на валютных счетах в кредитных организациях  | 520 | 425 068 692,88   | 1   | 425 068 692,88   |
| Суммарная стоимость активов (с учетом коэффициентов)<br>(060 + 090 + 120 + 270 + 510 + 520)  |     |                  |     | 2 263 642 760,62 |
| Стоимость активов с учетом требований пунктов 4 – 5 Положения о порядке расчета собственных средств профессиональных участников рынка ценных бумаг, управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, товарных бирж и биржевых посредников, заключающих в биржевой торговле договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар, утвержденного Приказом ФСФР от 23 октября 2008 года № 08-41/пз-н. |     |                  |     | 2 263 642 760,62 |
| <b>СУММА ПАССИВОВ</b>  |     |                  |     |                  |
| Целевое финансирование, если условия договора целевого финансирования не исполнены организацией (для коммерческих организаций)   | 530 | 0                | X   | 0                |
| Долгосрочные обязательства банкам и иным юридическим и физическим лицам  | 540 | 0                | X   | 0                |
| Краткосрочные кредиты банков и займы юридических и физических лиц  | 550 | 0                | X   | 0                |
| Кредиторская задолженность   | 560 | 1 551 422 826,12 | X   | 1 551 422 826,12 |
| Доходы будущих периодов, за исключением средств, полученных организацией безвозмездно  | 570 | 0                | X   | 0                |
| Резервы предстоящих расходов и платежей, а также резервы по сомнительным долгам  | 580 | 72 641 139,9     | X   | 72 641 139,9     |
| Сумма поручительств, выданных организациям, за исключением выданных брокером поручительств, обеспечивающих исполнение обязательств по сделкам, совершенным на торгах организатора торговли на рынке ценных бумаг   | 590 | 0                | X   | 0                |

|   |     |   |   |                  |
|---|-----|---|---|------------------|
| Сумма отложенных налоговых обязательств                                 | 600 | 0 | X | 0                |
| Сумма задолженности перед участниками (учредителями) по выплате доходов | 610 | 0 | X | 0                |
| Прочие обязательства организации, в том числе сумма                     | 620 | 0 | X | 0                |
| Итого по строкам 530 – 620  |     |   |   | 1 624 063 966,02 |
| <b>РАЗМЕР СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ</b>                                       |     |   |   |                  |
| Собственные средства  |     |   |   | 639 578 794,6    |

Едиличный исполнительный орган

Сергей Львович Васильев  
(инициалы, фамилия)

Контролер

Оксана Владимировна Двойнишникова  
(инициалы, фамилия)



*А.С.*

