

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

к Справке о стоимости чистых активов Открытый индексный паевой инвестиционный фонд "Паллада - индекс ММВБ"

Полное фирменное наименование управляющей компании: Закрытое акционерное общество "Паллада Эссет Менеджмент"

Настоящая пояснительная записка составлена в соответствии с приказом ФСФР №05-21/пз-н от 15.06.2005 "Об утверждении положения о порядке и сроках определения стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов, стоимости чистых активов паевых инвестиционных фондов, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, а также стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов в расчете на одну акцию".

Справка предоставлена на 31.03.2011

1. Информация об ошибках, приведших к изменению стоимости чистых активов в расчете на одну акцию акционерного инвестиционного фонда или расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более
2. Информация о забалансовых рисках, не включенных в расчет стоимости чистых активов (в том числе требований и обязательств по опционам, форвардным и фьючерсным контрактам, премий по опционам и активов, обремененных залогом), отсутствует.
3. Информация о сумме объявленных, но не полученных дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда, отсутствует.
4. Информация о существенных (на 10 и более процентов) изменениях признаваемых котировок ценных бумаг, составляющих активы акционерного паевого инвестиционного фонда :

Наименование ценной бумаги	Начало периода	Котировка ценной бумаги	Конец периода	Котировка ценной бумаги	Изменение, %
Новолипецкий металлург. комбинат ао	11.01.2011	145,6600	31.03.2011	125,2400	-14,02
ОГК-3 ао	11.01.2011	1,7150	31.03.2011	1,2843	-25,11
Газнефть ао	11.01.2011	154,3400	31.03.2011	182,4400	18,21
Газпром ао	11.01.2011	193,1100	31.03.2011	229,5100	18,85
ЛУКОЙЛ НК ао	11.01.2011	1 787,1400	31.03.2011	2 024,4000	13,28
НОВАТЭК ао	11.01.2011	323,4200	31.03.2011	377,3500	16,67
Полюс Золото ао	11.01.2011	1 914,0400	31.03.2011	1 691,8000	-11,61
Роснефть ао	11.01.2011	223,1300	31.03.2011	261,3400	17,12
Сургутнефтегаз ао	11.01.2011	34,3400	31.03.2011	30,4990	-11,19
ИнтерРАОао	11.01.2011	0,0482	31.03.2011	0,0418	-13,26
РусГидро, ао (ГидроОГК-ао)	11.01.2011	1,6560	31.03.2011	1,4348	-13,36
ФСК ЕЭС ао	11.01.2011	0,3650	31.03.2011	0,4130	13,15
Холдинг МРСК, ао	11.01.2011	5,4200	31.03.2011	4,8530	-10,46
Распадская ао	11.01.2011	229,4500	31.03.2011	190,9100	-16,80

5. Сведения о прочих событиях, которые существенно повлияли на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда, отсутствуют.

Генеральный директор



/ Руденко И.Ю. /

Зам. генерального директора по операционной работе

/ Дросик А. Я. /

Уполномоченный представитель ЗАО "Первый специализированный депозитарий"

АПРАКСИНА С. Е.