

## 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 30.06.2011

Информация об ошибках, приведших к изменению стоимости чистых активов в расчете на одну акцию

1. акционерного инвестиционного фонда или расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более процентов, отсутствуют.
- 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.
2. 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 :

Наименование ценной бумаги	Дата фиксации	Ставка, руб.	Количество ценных бумаг, шт.	Сумма дивидендов, руб.
Аэрофлот, ао	11.05.2011	1,0851	700	759,57
ОАО Банк ВТБ, ао	21.04.2011	0,00058	4 020 000	2 331,60
ОАО "Газпром", ао	12.05.2011	3,85	12 620	48 587,00
Газпром нефть, ао	25.04.2011	4,44	630	2 797,20
ОАО "ГМК "Норильский никель", ао	16.05.2011	180	248	44 640,00
ОАО "ИНТЕР РАО ЭЭС", ао	17.05.2011	0,00001544	2 200 000	33,97
ОАО "Нефтяная компания "ЛУКОЙЛ", ао	06.05.2011	59	1 413	83 367,00
ОАО "Магнит", ао	06.05.2011	11,24	138	1 551,12
ОАО "Магнитогорский металлургический комбинат", ао	04.04.2011	0,33	3 700	1 221,00
ОАО "Мобильные ТелеСистемы", ао	10.05.2011	14,54	2 700	39 258,00
Мосэнерго, ао	12.05.2011	0,02	22 000	440,00
НОВАТЭК, ао	22.03.2011	2,5	3 070	7 675,00
Новолипецкий металлургический комбинат, ао	16.04.2011	1,2	2 430	2 916,00
Полюс Золото, ао	12.04.2011	11,25	257	2 891,25
ОАО НК "Роснефть", ао	21.04.2011	2,76	4 300	11 868,00
Сбербанк России, ао	15.04.2011	0,92	22 710	20 893,20
Сбербанк России, ап	15.04.2011	1,15	2 400	2 760,00
Северсталь, ао	22.05.2011	2,42	1 100	2 662,00
Северсталь, ао	22.05.2011	3,9	1 100	4 290,00
ОАО "Сургутнефтегаз", ао	13.05.2011	0,5	20 300	10 150,00
ОАО "Сургутнефтегаз", ап	13.05.2011	1,18	14 500	17 110,00
ОАО "Татнефть" им.В.Д.Шашина, ао	06.05.2011	5,02	4 000	20 080,00
Уралкалий, ао	24.05.2011	4,55	1 960	8 918,00
ОАО "Федеральная сетевая компания Единой энергетической системы", ао	16.05.2011	0,0020523650155	743 300	1 525,52
ИТОГО:				337 965,86

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, %
Мосэнерго ао	31.03.2011	2,9478	30.06.2011	2,4996	-15,20
Новолипецкий металлург. комбинат ао	31.03.2011	125,2400	30.06.2011	109,0700	-12,91
Ростелеком ао	31.03.2011	171,1000	30.06.2011	191,9500	12,19
Газпром нефть ао	31.03.2011	148,3600	30.06.2011	129,7100	-12,57
Банк ВТБ ао	31.03.2011	0,0988	30.06.2011	0,0859	-13,05
Магнитогорский металлургический к-т ао	31.03.2011	31,8900	30.06.2011	24,5220	-23,10
Газпром ао	31.03.2011	229,5100	30.06.2011	203,1500	-11,49
ЛУКОЙЛ НК ао	31.03.2011	2 024,4000	30.06.2011	1 767,0000	-12,71
Мобильные ТелеСистемы ао	31.03.2011	259,2000	30.06.2011	229,4800	-11,47
Сургутнефтегаз ап	31.03.2011	17,1720	30.06.2011	13,8300	-19,46
ИнтерРАОао	31.03.2011	0,0418	30.06.2011	0,0374	-10,43
Холдинг МРСК, ао	31.03.2011	4,8530	30.06.2011	3,6820	-24,13
Распадская ао	31.03.2011	190,9100	30.06.2011	164,9500	-13,60

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. /

"Первый специализированный депозитарий"



ЯКУМЕДА СС