

## ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

### к Справке о стоимости чистых активов

#### Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Паллада - фонд смешанных инвестиций"

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

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

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 процентов, отсутствуют.
2. Информация о сумме объявленных, но не полученных дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда:

Наименование ценной бумаги	Дата	Ставка	Количество ценных	Сумма дивидендов
Банк ВТБ	21.04.2011	0,00058	14 720 000	8 537,60
Газпром ао	12.05.2011	3,85	8 350	32 147,50
ГМК Норильский Никель ао	16.05.2011	180,00	257	46 260,00
Лукойл ао	06.05.2011	59,00	737	43 483,00
Сбербанк России ао	15.04.2011	0,92	18 300	16 836,00
Северсталь ао (1 квартал 2011г.)	22.05.2011	2,42	1 320	3 194,40
Северсталь ао (2010г.)	22.05.2011	3,90	1 320	5 148,00
Сургутнефтегаз ап	13.05.2011	1,18	83 700	98 766,00
Роснефть ао	21.04.2011	2,76	5 588	15 422,88
Удмуртнефть ап	12.05.2011	1 202,78	2	2 405,56
ИТОГО:				272 200,94

3. 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.
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, %
Ашинский металлургический завод ао	31.03.2011	16,5220	30.06.2011	13,4120	-18,82
Банк ВТБ ао	31.03.2011	0,0988	30.06.2011	0,0859	-13,05
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
Сургутнефтегаз ап	31.03.2011	17,1720	30.06.2011	13,8300	-19,46
Ковровский механический завод ао	06.04.2011	3 009,1000	30.06.2011	2 511,8000	-16,53

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"

\_\_\_\_\_ **ЭССЕТ МЕНЕДЖМЕНТ** ООО