

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 30.09.2011

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
Газпром ао	12.05.2011	3,85	8 350	32 147,50
Северсталь ао (1 полугодие 2011г.)	24.08.2011	4,37	1 320	5 768,40
ИТОГО:				37 915,90

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, %
Сбербанк России ао	30.06.2011	99,8100	30.09.2011	72,0000	-27,86
Банк ВТБ ао	30.06.2011	0,0859	12.09.2011	0,0728	-15,34
Северсталь ао	30.06.2011	510,2000	30.09.2011	345,3000	-32,32
Газпром ао	30.06.2011	203,1500	12.09.2011	164,6200	-18,97
Мобильные ТелеСистемы ао	19.07.2011	239,8000	30.09.2011	179,8700	-24,99
Машиностроительный завод, ао	30.06.2011	5 999,9884	30.09.2011	4 784,4818	-20,26
ФСК ЕЭС ао	19.07.2011	0,3786	30.09.2011	0,2381	-37,12
Полиметалл, ао	19.07.2011	589,8000	30.09.2011	506,9000	-14,06

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"

ХМЕЛЬНИЦКАЯ, Е.В.