

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"

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 30.12.2011

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
Северсталь ао (за 9 месяцев 2011г.)	15.11.2011	3,36	1 320	4 435,20
ИТОГО:				4 435,20

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, %
Банк ВТБ ао	07.10.2011	0,0654	30.12.2011	0,0584	-10,79
Газпром ао	07.10.2011	151,3800	30.12.2011	171,3300	13,18
ГМК Норильский Никель ао	07.10.2011	6 385,0000	30.12.2011	4 950,0000	-22,47
Роснефть ао	07.10.2011	191,6700	30.12.2011	212,3000	10,76
Сургутнефтегаз ап	30.09.2011	14,0340	30.12.2011	16,4940	17,53
Машиностроительный завод, ао	13.10.2011	3 464,5912	26.12.2011	2 899,6000	-16,31
ФСК ЕЭС ао	30.09.2011	0,2381	30.12.2011	0,2796	17,45

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.