

Пояснительная записка
к справке о стоимости чистых активов паевого инвестиционного фонда
ОТКРЫТЫЙ ПАЕВОЙ ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ФОНД АКЦИЙ

«УралСиб Фонд Первый»
под управлением ЗАО «Управляющая Компания УралСиб»
(далее –паевой инвестиционный фонд)

г. Москва

30 сентября 2011 г.

1. Информация о фактах и оценка последствий исправления ошибок, существенно влияющих на расчетную стоимость инвестиционного пая

- 1.1. Существенными ошибками, влияющими на расчетную стоимость инвестиционного пая, являются ошибки, приводящие к изменению расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более процентов.
- 1.2. По состоянию за прошедший отчетный период существенных ошибок, влияющих на расчетную стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда, выявлено не было.

2. Забалансовые риски

2.1. По состоянию на 30 сентября 2011года в состав активов паевого инвестиционного фонда входили требования и обязательства, не включаемые в расчет стоимости чистых активов:

Вид	Тип	Наименование	Полный код контракта	Базовый инструмент	Дата исполнения	Кол-во	Цена (руб.)
Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-12.11	Индекс РТС	15.12.2011	5 000,00	85 494,76

2.2. Сведения о сделках в отчетный период (по состоянию на 30 сентября 2011 года обязательства по контрактам закрыты):

Дата	Цена (в пунктах)	Покупка/продажа	Кол-во	Сумма (в рублях)	Вид	Тип	Наименование
12.07.2011	187630	Покупка	1	106466,9	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС
12.07.2011	20091	Продажа	1	20091	Фьючерс	Поставочный	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром"
12.07.2011	190150	Продажа	1	107896,8	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС
12.07.2011	20286	Покупка	1	20286	Фьючерс	Поставочный	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром"

02.09.2011	6095	Продажа	7500	26561550	Опцион	Американский	Маржируемый Опцион колл на фьючерсный контракт на Индекс РТС
02.09.2011	5960	Продажа	7500	25973175	Опцион	Американский	Маржируемый Опцион колл на фьючерсный контракт на Индекс РТС
22.09.2011	1435	Покупка	15000	13754400	Опцион	Американский	Маржируемый Опцион колл на фьючерсный контракт на Индекс РТС

2.2.1. Сведения об активах, составляющих покрытие совокупной короткой позиции по Опциону колл на 02.09.2011 г.:

Ценная бумага	Регистрационный номер	Кол-во	Стоимость, руб.
Северсталь АОИ2	1-02-00143-A	200 000	87 339 013,78
Сургутнефтегаз АОИО	1-01-00155-A	7 000 000	145 788 114,10
ЛУКОЙЛ НК АОИО	1-01-00077-A	80 000	78 145 972,27
Сургутнефтегаз АПИО	2-01-00155-A	16 000 000	173 529 073,41
ГАЗПРОМ АОИ2	1-02-00028-A	4 000 000	622 152 933,59
Роснефть АОО2	1-02-00122-A	1 750 000	363 756 913,89
РусГидро АОИО	1-01-55038-E	50 000 000	35 552 339,66

1 506 264 360,69

3. Сведения о событиях, которые оказали существенное влияние на стоимость чистых активов

3.1. По состоянию на последний рабочий день III квартала 2011 года паевой инвестиционный фонд не имеет:

- объявленные, но не полученные суммы дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда;

- начисленные, но не полученные доходы по инвестиционным паям закрытых паевых инвестиционных фондов, составляющим активы паевого инвестиционного фонда;

- прочие события, которые существенно (на 10 и более процентов за отчетный квартал) повлияли на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда.

3.2. Существенные изменения (на 10 и более процентов за отчетный квартал с 30 июня по 30 сентября) признаваемых котировок ценных бумаг на российских фондовых биржах и цены закрытия рынка ценных бумаг на иностранных фондовых биржах, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

№№	Ценная бумага	Регистрационный номер	% изменения котировки	Биржа
1	Magnitogorsk Iron and Steel Works REGS	US5591892048	-52.31	Блумберг
2	VIMPELCOM LTD ADR REG	US92719A1060	-15.21	Блумберг
3	АЭРОФЛОТ АОО	1-01-00010-A	-22.26	ММВБ
4	ГАЗПРОМ АОИ2	1-02-00028-A	-23.76	ММВБ
5	Газпром нефть	1-01-00146-A	-13.77	ММВБ
6	Дальневост.морское пар-во АОО	1-03-00032-A	-33.86	ММВБ
7	МЕЧЕЛ аоп1	2-01-55005-E	-40.19	ММВБ

8	ОАО Банк Санкт-Петербург, ап	20200436В	-24.14	ММВБ
9	РАСПАДСКАЯ АОИ1	1-04-21725-N	-42.92	ММВБ
10	Роснефть АОО2	1-02-00122-A	-19.12	ММВБ
11	ХОЛДИНГ МРСК АОИО	1-01-55385-E	-39.90	ММВБ
12	Энел ОГК-5 ао1	1-01-50077-A	-20.52	ММВБ

Генеральный директор
 ЗАО "Управляющая Компания УралСиб"

_____ А.В. Пугач

Руководитель дирекции сопровождения операций
 ПИФ ЗАО "Управляющая Компания УралСиб"

_____ В.В. Бобкова

Руководитель Дирекции контроля деятельности
 ОПИФ и ИПИФ ЗАО "СД Центр"

_____ О.С. Волкова