

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

29 июня 2012 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 29 июня 2012 года в состав активов паевого инвестиционного фонда не входили требования и обязательства, не включаемые в расчет стоимости чистых активов.
- 2.2. Сведения о сделках в отчетный период:

Дата	Цена	Покупка/ продажа	Коли- чество	Сумма (в рублях)	Вид	Тип	Наименование	Полный код контракта
30.03.2012	159055	Продажа	1	93343,02	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159055	Продажа	1	93343,02	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159055	Продажа	3	280029,06	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159055	Продажа	34	3173662,68	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159060	Продажа	1	93345,95	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159060	Продажа	3	280037,85	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159060	Продажа	24	2240302,8	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159060	Продажа	50	4667297,5	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159065	Продажа	1	93348,89	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159065	Продажа	1	93348,89	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159065	Продажа	1	93348,89	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159065	Продажа	4	373395,56	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159065	Продажа	14	1306884,46	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159070	Продажа	1	93351,82	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159070	Продажа	1	93351,82	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159070	Продажа	1	93351,82	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159070	Продажа	1	93351,82	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
30.03.2012	159070	Продажа	3	280055,46	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12

31.05.2012	33255	Продажа	100	3325500	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	84	2793420	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	212	7050060	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	12	399060	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	12	399060	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	12	399060	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	20	665100	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	50	1662750	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
31.05.2012	33255	Продажа	98	3258990	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	49	4220175,96	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	50	4306302	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	50	4306302	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132005	Продажа	1	86129,3	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132005	Продажа	1	86129,3	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132005	Продажа	3	258387,9	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	42	3617293,68	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	5	430630,2	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	48	4134049,92	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	250	21539665	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	25	2153966,5	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	1	86158,66	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	4	344634,64	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	18	1550855,88	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	16	1378016,64	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132000	Продажа	234	20153493,3 6	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132050	Продажа	202	17404049,3 2	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	132495	Продажа	3500	301357490	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на Индекс РТС	RTS-6.12
15.06.2012	32417	Покупка	1000	32417000	Фьючерс	Расчетный	Фьючерсный контракт на курс рубль-доллар	Si-6.12

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

3.1. По состоянию на последний рабочий день II квартала 2012 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 марта 2012г. по 29 июня 2012г.) 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	OJSC PHOSAGRO-REGS-GDR	US71922G2093	25.84	Лондонская Фондовая биржа
2	VIMPELCOM LTD ADR REG	US92719A1060	-18.26	Нью-Йоркская Фондовая Биржа
3	ГАЗПРОМ АОИ2	1-02-00028-A	-15.11	ММВБ-РТС
4	МЕЧЕЛ аоп1	2-01-55005-E	-25.35	ММВБ-РТС
5	МЕЧЕЛ ADR	US5838401033	-19.21	Нью-Йоркская Фондовая Биржа
6	НОВАТЭК АО02	1-02-00268-E	-17.66	ММВБ-РТС
7	ОАО Банк Санкт-Петербург, ап	20200436В	-20.89	ММВБ-РТС
8	СБЕРБАНК РОССИИ АОИЗ	10301481В	-10.20	ММВБ-РТС
9	Сургутнефтегаз АПИО	2-01-00155-A	-11.65	ММВБ-РТС
10	ТНК-ВР ХОЛДИНГ АПИ1	2-01-55034-E	-22.57	ММВБ-РТС

Генеральный директор
ЗАО "Управляющая Компания УралСиб"

_____ Э.А. Колузанов

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