

Ежемесячный бюллетень
Период: Октябрь 2014

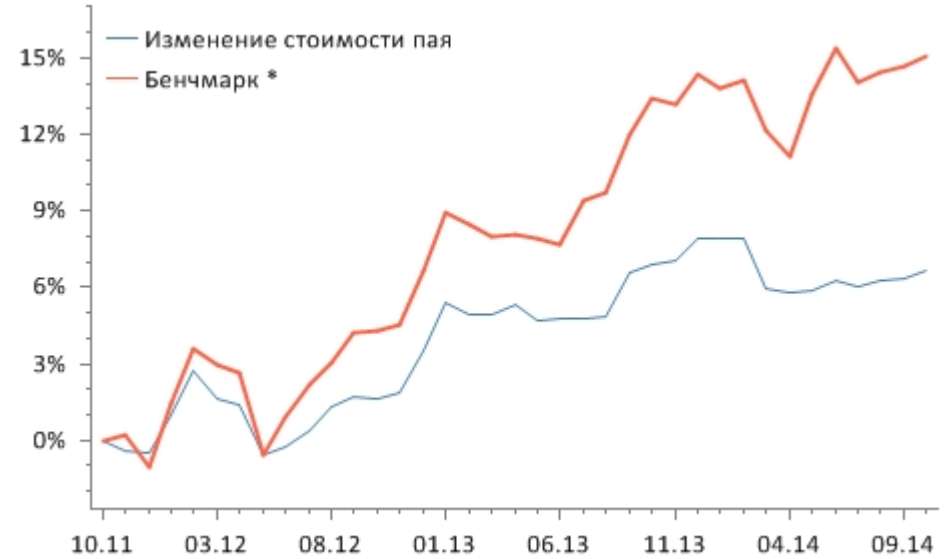
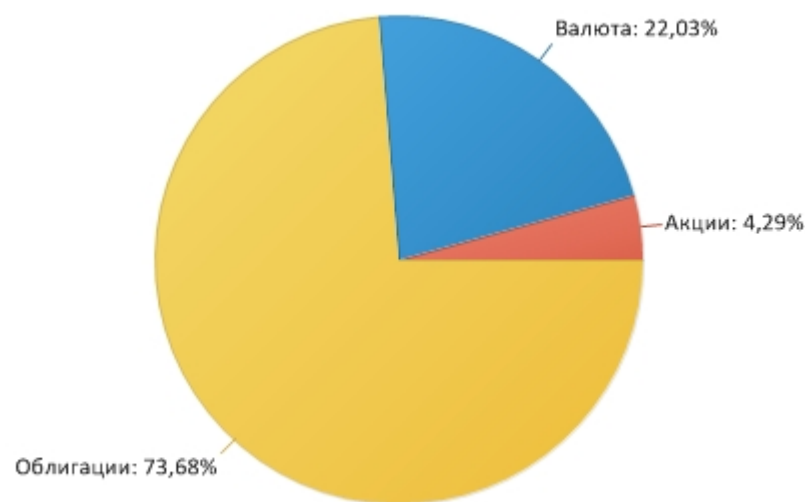
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 721		557	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	6,6%	2,2%	15,0%	5,0%
с начала текущего года	-1,2%	-1,4%	0,6%	0,7%
за 1 год	-0,3%	-0,3%	1,4%	1,4%
за 6 месяцев	0,8%	1,6%	4,2%	8,4%
за 3 месяца	0,6%	2,4%	1,3%	5,2%
за месяц	0,3%	3,6%	0,6%	7,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,8		0,9	
Волатильность	2,9%		5,4%	
Максимальное снижение	-4,4%		-5,6%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММБВ + 75% Индекс ММБВ корпоративных облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,17	Коэффициент Бета	0,14
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	414 322
Облигации	909 162
Прочие доходы и расходы	-47 931
Итого	1 275 553

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Россельхозбанк обл. 03	267 300	Норильский никель обл. БО-02	-57 800
Магнит обл. БО-07	141 200	МТС аои	-28 311
Банк Зенит обл. 11	141 150	Аэрофлот аои	-16 384
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	120 564	Сбербанк России аои	-6 240
Магнит аои	117 882	НЛМК аои	-3 020
Газпромбанк обл. БО-04	85 200	Русфинанс Банк обл. БО-07	-1 898
Уралвагонзавод НПК обл.01	79 500	Сбербанк России апи	-1 200
НОВАТЭК аои	69 563	Росбанк обл. БО-6	-300
НК ЛУКОЙЛ аои	60 192	Башнефть аои	-105
ЮниКредит Банк обл. БО-08	56 386		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,80%	23.02.2016	11,26%
Магнит обл. БО-07	11,67%	21.09.2015	11,03%
Норильский никель обл. БО-02	11,50%	25.02.2016	11,00%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,47%	13.10.2015	11,61%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,63%	13.03.2020	9,28%
Банк Зенит обл. 11	8,83%	16.10.2018	12,11%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6,07%	07.12.2017	9,22%
Газпромбанк обл. БО-04	6,05%	20.12.2014	9,32%
Росбанк обл. БО-6	5,85%	30.01.2016	11,32%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,83%	24.04.2018	10,43%
Россельхозбанк обл. 03	5,80%	09.02.2017	6,24%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,51%	13.10.2015	11,59%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	18,03%	▲ +3,48
Газпром аои	10,63%	▲ +2,29
Сбербанк России аои	9,20%	▼ -0,68
НОВАТЭК аои	8,86%	▲ +8,18
Норильский никель аои	7,56%	▲ +7,50
Магнит аои	7,09%	▲ +18,90
Роснефть аои	6,48%	▲ +2,82
МТС аои	5,25%	▼ -7,30
Банк ВТБ аои	5,18%	▲ +0,74
Сургутнефтегаз аои	4,93%	▲ +6,42
Татнефть аои	3,42%	▲ +7,67
Сургутнефтегаз апи	3,10%	▲ +5,78
Транснефть апи	2,85%	▲ +8,59
Сбербанк России апи	1,44%	▼ -0,83
Северсталь аои	1,36%	▲ +14,53
Аэрофлот аои	1,24%	▼ -11,79
Уралкалий аои	1,23%	▲ +8,68
НЛМК аои	0,92%	▼ -3,24
Башнефть аои	0,63%	▼ -0,15
Башнефть апи	0,62%	▲ +11,79

ЗАО Управляющая компания «Либра Капитал» (Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00663 выдана ФСФР России 06 октября 2009 г., срок действия - бессрочная). Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Либра – Пенсионный Капитал» под управлением ЗАО Управляющей компании «Либра Капитал». Правила доверительного управления зарегистрированы ФСФР России 20.09.2007 № 0982-94130523. Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем. Государство не гарантирует доходность инвестиций в паевые инвестиционные фонды. Прежде чем приобрести инвестиционные паи, внимательно ознакомьтесь с Правилами доверительного управления паевого инвестиционного фонда. Правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами, находящимися под управлением ЗАО Управляющая компания «Либра Капитал», предусмотрены надбавки при приобретении паев и скидки к расчетной стоимости паев при их погашении. Обращаем Ваше внимание на то, что взимание скидок уменьшает доходность инвестиций в инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов. Информация о местах, где до приобретения инвестиционных паев можно получить информацию о Фонде и ознакомиться с Правилами и иными документами: 115054, г. Москва, ул. Бахрушина, д.18, стр.1, тел. (495) 580-77-81 Адрес в сети Интернет: <http://www.libra-am.ru>