

Ежемесячный бюллетень
Период: Сентябрь 2014

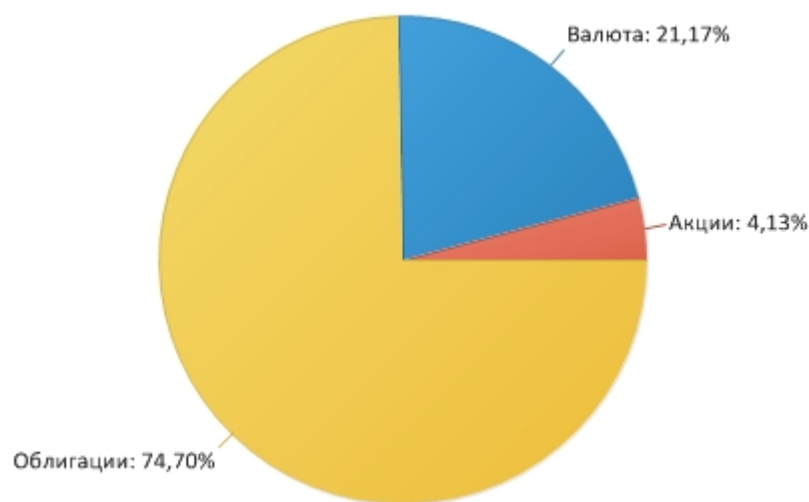
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 689		539	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	7,3%	2,4%	17,2%	5,7%
с начала текущего года	-1,5%	-2,0%	0,0%	0,0%
за 1 год	-0,2%	-0,2%	2,1%	2,1%
за 6 месяцев	0,5%	1,0%	3,2%	6,4%
за 3 месяца	0,1%	0,4%	-0,8%	-3,2%
за месяц	0,1%	1,2%	0,2%	2,4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,8		1,0	
Волатильность	3,0%		5,5%	
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	0,13
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	99 735
Облигации	773 626
Прочие доходы и расходы	-74 166
Итого	799 195

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	202 146	Магнит обл. БО-07	-53 600
ЮниКредит Банк обл. БО-08	193 952	Башнефть апи	-46 158
Банк Зенит обл. 11	133 500	НК ЛУКОЙЛ аои	-41 382
Норильский никель обл. БО-02	127 800	Росбанк обл. БО-6	-38 700
Уралвагонзавод НПК обл.01	73 900	Башнефть аои	-37 334
Русфинанс Банк обл. БО-07	71 329	МТС аои	-26 796
НОВАТЭК аои	65 987	Россельхозбанк обл. 03	-17 100
Газпромбанк обл. БО-04	57 800	Аэрофлот аои	-11 424
Магнит аои	41 292	ВымпелКом-Инвест обл. 06	-3 599
Сбербанк России аои	37 261		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,80%	13.10.2015	10,87%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,65%	23.02.2016	9,55%
Магнит обл. БО-07	11,46%	21.09.2015	10,82%
Норильский никель обл. БО-02	11,41%	25.02.2016	10,03%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,45%	13.03.2020	9,28%
Банк Зенит обл. 11	9,01%	16.10.2018	10,75%
Русфинанс Банк обл. БО-07	6,05%	24.04.2018	10,11%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5,96%	07.12.2017	9,23%
Газпромбанк обл. БО-04	5,93%	20.12.2014	9,68%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,90%	13.10.2015	10,84%
Росбанк обл. БО-6	5,79%	30.01.2016	10,52%
Россельхозбанк обл. 03	5,58%	09.02.2017	7,33%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	18,13%	▼ -2,34
Газпром аои	10,81%	▲ +3,35
Сбербанк России аои	9,64%	▲ +3,98
НОВАТЭК аои	8,52%	▲ +8,70
Норильский никель аои	7,32%	▲ +0,84
Роснефть аои	6,55%	▲ +1,21
Магнит аои	6,20%	▲ +7,51
МТС аои	5,89%	▼ -4,62
Банк ВТБ аои	5,35%	▲ +2,81
Сургутнефтегаз аои	4,82%	▲ +0,83
Татнефть аои	3,31%	▲ +1,43
Сургутнефтегаз апи	3,05%	▲ +1,49
Транснефть апи	2,73%	▲ +7,07
Сбербанк России апи	1,51%	▲ +4,19
Аэрофлот аои	1,46%	▼ -7,60
Северсталь аои	1,24%	▲ +10,74
Уралкалий аои	1,18%	▲ +2,05
НЛМК аои	0,99%	▲ +7,11
Башнефть аои	0,72%	▼ -35,12
Башнефть апи	0,57%	▼ -45,75

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>