

Ежемесячный бюллетень
Период: Сентябрь 2013

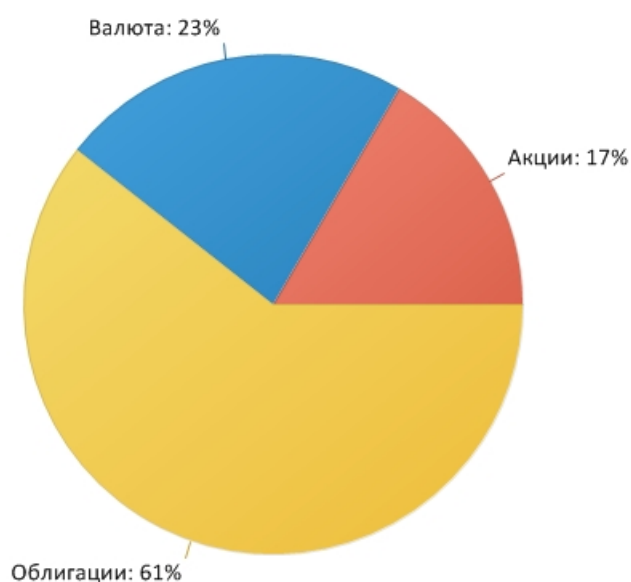
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 720		545	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	11.5%	3.8%	18.6%	6.2%
с начала текущего года	3.0%	4.0%	4.8%	6.4%
за 1 год	4.8%	4.8%	7.3%	7.3%
за 6 месяцев	1.6%	3.2%	3.6%	7.2%
за 3 месяца	1.7%	6.8%	4.3%	17.2%
за месяц	1.7%	20.4%	2.3%	27.6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1.1		1.1	
Волатильность	3.3%		5.6%	
Максимальное снижение	-4.8%		-7.8%	

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


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0.28	Коэффициент Бета	0.16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	3 527 063
Облигации	1 015 260
Прочие доходы и расходы	-51 893
Итого	4 490 430

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Сбербанк России аои	926 632	Банк ВТБ аои	-80 467
Газпром аои	499 941	Сбербанк России апи	-47 791
НК ЛУКОЙЛ аои	336 176	Русал Братск обл.07	-26 690
Магнит аои	317 124	Группа ЛСР аои	-1 260
Сургутнефтегаз аои	305 941		
МТС аои	289 795		
НОВАТЭК аои	249 650		
Камаз обл. БО-02	193 400		
Уралкалий аои	186 257		
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	166 430		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	14.49%	23.02.2016	7.66%
Камаз обл. БО-02	14.49%	04.02.2014	7.99%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	12.64%	13.10.2015	8.25%
Росбанк обл. БО-6	12.59%	30.01.2016	7.86%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	12.17%	13.03.2020	8.94%
Русал Братск обл.07	11.61%	22.02.2018	22.74%
Газпромбанк обл. БО-04	7.39%	20.12.2014	7.59%
Уралвагонзавод НПК обл.01	7.35%	07.12.2017	8.38%
Россельхозбанк обл. 03	7.28%	09.02.2017	6.81%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	15.42%	▲ +6.83
Газпром аои	14.10%	▲ +9.78
Сбербанк России апи	8.80%	▲ +7.92
Магнит аои	7.43%	▲ +11.32
Сбербанк России аои	7.22%	▲ +10.18
Сургутнефтегаз аои	6.31%	▲ +8.26
Роснефть аои	5.73%	▲ +6.65
МТС аои	5.49%	▲ +11.67
Банк ВТБ аои	4.38%	▼ -4.27
НОВАТЭК аои	4.15%	▲ +6.76
Норильский никель аои	3.85%	▲ +7.40
Уралкалий аои	3.52%	▲ +8.46
Татнефть аои	2.60%	▲ +3.13
Сургутнефтегаз апи	2.15%	▲ +4.60
Транснефть апи	1.98%	▲ +10.14
Башнефть апи	1.92%	▲ +4.39
Мостотрест аои	1.57%	▲ +3.74
Аэрофлот аои	1.36%	▲ +10.39
Северсталь аои	0.79%	▲ +2.44
Другие	1.23%	

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 паевым инвестиционным фондом. 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>