

Ежемесячный бюллетень
Период: Октябрь 2013

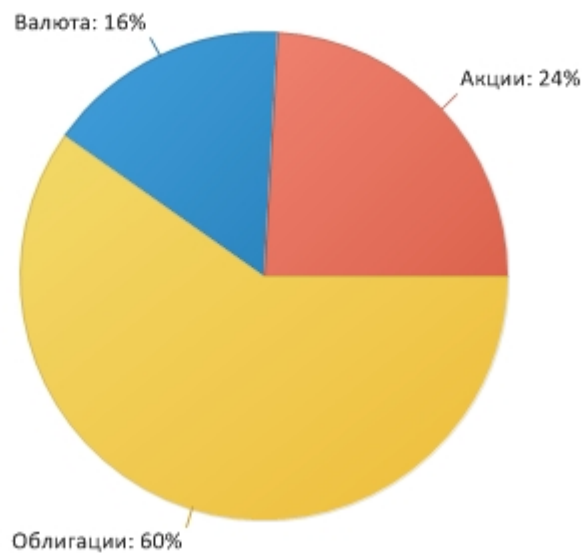
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 756		558	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	10,4%	3,5%	18,1%	6,0%
с начала текущего года	3,3%	4,0%	6,2%	7,4%
за 1 год	5,2%	5,2%	8,6%	8,6%
за 6 месяцев	1,5%	3,0%	5,1%	10,2%
за 3 месяца	2,1%	8,4%	4,0%	16,0%
за месяц	0,3%	3,6%	1,3%	15,6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,0		1,1	
Волатильность	3,3%		5,6%	
Максимальное снижение	-4,8%		-7,8%	

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


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,26	Коэффициент Бета	0,16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	804 826
Облигации	593 600
Прочие доходы и расходы	-54 910
Итого	1 343 516

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Магнит аои	190 612	Русал Братск обл.07	-257 550
ВымпелКом-Инвест обл. 06	182 750	Роснефть аои	-144 875
Сбербанк России аои	170 211	Транснефть апи	-48 183
НОВАТЭК аои	145 888	Сургутнефтегаз аои	-43 272
ЮниКредит Банк обл. БО-08	138 400	Мостотрест аои	-36 941
Камаз обл. БО-02	128 000	Северсталь аои	-10 675
Росбанк обл. БО-6	123 590	Сургутнефтегаз апи	-4 747
Башнефть апи	123 234		
МТС аои	122 704		
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	99 110		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	14,60%	23.02.2016	7,62%
Камаз обл. БО-02	14,59%	04.02.2014	8,09%
Росбанк обл. БО-6	12,68%	30.01.2016	7,83%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	12,28%	13.10.2015	8,02%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	12,25%	13.03.2020	8,97%
Русал Братск обл.07	11,44%	22.02.2018	35,96%
Газпромбанк обл. БО-04	7,44%	20.12.2014	7,64%
Уралвагонзавод НПК обл.01	7,41%	07.12.2017	7,65%
Россельхозбанк обл. 03	7,31%	09.02.2017	7,39%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	15,11%	▲ +1,32
Сбербанк России аои	14,82%	▲ +4,81
Газпром аои	13,56%	▲ +3,93
Магнит аои	7,49%	▲ +5,15
Сургутнефтегаз аои	6,11%	▲ +0,06
МТС аои	5,74%	▲ +4,85
Роснефть аои	5,71%	▼ -4,15
Норильский никель аои	5,01%	▲ +3,11
НОВАТЭК аои	5,00%	▲ +7,18
Банк ВТБ аои	3,90%	▲ +3,08
Уралкалий аои	3,66%	▲ +0,91
Татнефть аои	2,59%	▲ +2,23
Сургутнефтегаз апи	2,23%	▲ +1,83
Транснефть апи	2,17%	▼ -2,92
Башнефть апи	1,78%	▲ +16,76
Сбербанк России апи	1,31%	▲ +9,98
Аэрофлот аои	1,20%	▲ +3,81
Мостотрест аои	1,00%	▼ -6,15
Северсталь аои	0,84%	▼ -0,53
Другие	0,75%	

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>