

Ежемесячный бюллетень
Период: Ноябрь 2013

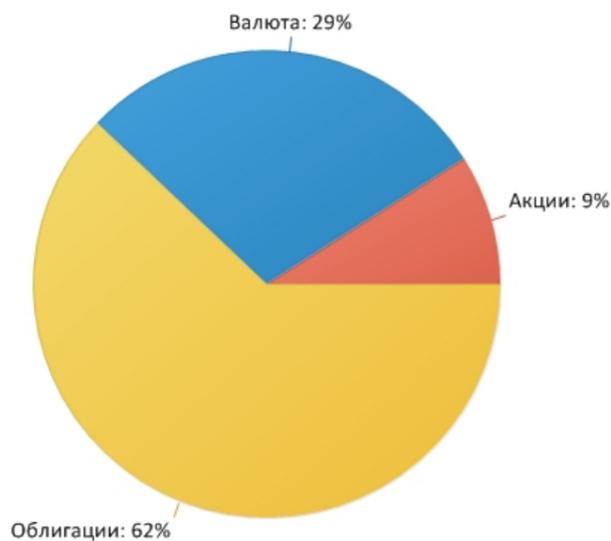
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 771		551	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	8.6%	2.9%	17.2%	5.7%
с начала текущего года	3.4%	3.7%	6.0%	6.6%
за 1 год	5.3%	5.3%	8.5%	8.5%
за 6 месяцев	2.1%	4.2%	4.9%	9.8%
за 3 месяца	2.0%	8.0%	3.3%	13.2%
за месяц	0.1%	1.2%	-0.2%	-2.4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0.9		1.0	
Волатильность	3.3%		5.5%	
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	0.24	Коэффициент Бета	0.15
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-121 185
Облигации	1 111 576
Прочие доходы и расходы	-48 689
Итого	941 702

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Русал Братск обл.07	300 353	Газпром аои	-172 363
НК ЛУКОЙЛ аои	182 256	МТС аои	-160 758
Росбанк обл. БО-6	133 110	Башнефть апи	-110 474
Камаз обл. БО-02	127 400	Роснефть аои	-102 395
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	122 230	НОВАТЭК аои	-52 110
ЮниКредит Банк обл. БО-08	116 000	Татнефть аои	-51 006
ВымпелКом-Инвест обл. 06	95 540	Уралкалий аои	-12 395
Магнит аои	90 482	НЛМК аои	-8 753
Сбербанк России аои	84 633	Группа ЛСР аои	-6 227
Россельхозбанк обл. 03	80 100	Сургутнефтегаз аои	-2 552

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	14.26%	23.02.2016	7.65%
Камаз обл. БО-02	14.25%	04.02.2014	8.20%
Росбанк обл. БО-6	12.40%	30.01.2016	7.76%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11.98%	13.10.2015	8.07%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	11.97%	13.03.2020	8.97%
Русал Братск обл.07	9.99%	22.02.2018	38.99%
Газпромбанк обл. БО-04	7.26%	20.12.2014	7.72%
Уралвагонзавод НПК обл.01	7.24%	07.12.2017	3.67%
Россельхозбанк обл. 03	7.15%	09.02.2017	6.44%
Банк Зенит обл. 11	3.49%	16.10.2018	8.37%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	14.48%	▼ -2.32
Сбербанк России аои	14.30%	▲ +0.17
Газпром аои	13.26%	▼ -4.46
Магнит аои	7.33%	▲ +5.37
Сургутнефтегаз аои	5.86%	▼ -2.80
НОВАТЭК аои	5.55%	▼ -3.51
МТС аои	5.51%	▼ -7.98
Роснефть аои	5.25%	▼ -5.53
Норильский никель аои	5.04%	▲ +2.19
Банк ВТБ аои	3.64%	▲ +4.94
Уралкалий аои	3.36%	▼ -3.76
Транснефть апи	2.43%	▲ +3.48
Татнефть аои	2.42%	▼ -6.69
Сургутнефтегаз апи	2.15%	▼ -0.90
Мостотрест аои	2.04%	▲ +2.24
Башнефть апи	2.00%	▼ -8.23
Аэрофлот аои	1.39%	▲ +5.27
Сбербанк России апи	1.34%	▲ +2.98
Северсталь аои	0.86%	▲ +7.18
Другие	1.78%	

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 Управляющей компании «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>