

Ежемесячный бюллетень
Период: Декабрь 2013

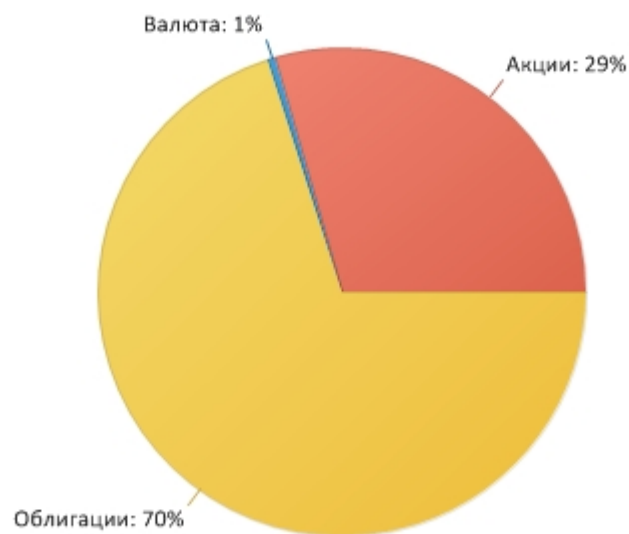
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 876		559	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	7,9%	2,6%	16,3%	5,4%
с начала текущего года	4,3%	4,3%	7,1%	7,1%
за 1 год	4,3%	4,3%	7,1%	7,1%
за 6 месяцев	3,0%	6,0%	6,6%	13,2%
за 3 месяца	1,2%	4,8%	2,1%	8,4%
за месяц	0,8%	9,6%	1,0%	12,0%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,8		1,0	
Волатильность	3,3%		5,5%	
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	0,25	Коэффициент Бета	0,15
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	1 368 883
Облигации	1 251 527
Прочие доходы и расходы	-54 752
Итого	2 565 658

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Русал Братск обл.07	449 250	Газпром аои	-38 237
Норильский никель аои	300 025	Сбербанк России апи	-19 538
Магнит обл. БО-07	217 864	Мостотрест аои	-15 554
Роснефть аои	167 823	Росбанк обл. БО-6	-5 802
Банк ВТБ аои	166 945	ММК аои	-1 743
Аэрофлот аои	148 950		
Башнефть апи	143 492		
Камаз обл. БО-02	136 200		
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	126 310		
МТС аои	101 109		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Камаз обл. БО-02	12,61%	04.02.2014	8,31%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	12,56%	23.02.2016	8,04%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	10,60%	13.03.2020	8,97%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	9,80%	13.10.2015	8,41%
Магнит обл. БО-07	9,50%	21.09.2015	8,06%
Банк Зенит обл. 11	9,23%	16.10.2018	8,99%
Русал Братск обл.07	9,06%	22.02.2018	36,63%
Росбанк обл. БО-6	8,02%	30.01.2016	8,10%
Россельхозбанк обл. 03	6,32%	09.02.2017	6,23%
Газпромбанк обл. БО-04	6,16%	20.12.2014	7,65%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6,13%	07.12.2017	9,15%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Сбербанк России аои	15,06%	▼ -1,52
НК ЛУКОЙЛ аои	14,99%	▼ -0,81
Газпром аои	13,72%	▼ -2,93
Магнит аои	7,73%	▲ +0,53
Сургутнефтегаз аои	6,02%	▲ +2,92
НОВАТЭК аои	5,58%	▲ +0,75
МТС аои	5,46%	▲ +5,58
Роснефть аои	5,29%	▲ +5,02
Норильский никель аои	5,05%	▲ +8,94
Банк ВТБ аои	4,15%	▲ +7,15
Уралкалий аои	3,59%	▲ +4,76
Татнефть аои	2,43%	▲ +1,47
Сургутнефтегаз апи	2,22%	▲ +9,87
Башнефть апи	1,86%	▲ +4,61
Транснефть апи	1,86%	▲ +0,90
Сбербанк России апи	1,39%	▼ -6,02
Аэрофлот аои	1,24%	▲ +41,75
Северсталь аои	0,78%	▲ +5,76
Мостотрест аои	0,60%	▼ -3,65
Другие	0,98%	

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>