

Ежемесячный бюллетень
Период: Февраль 2014

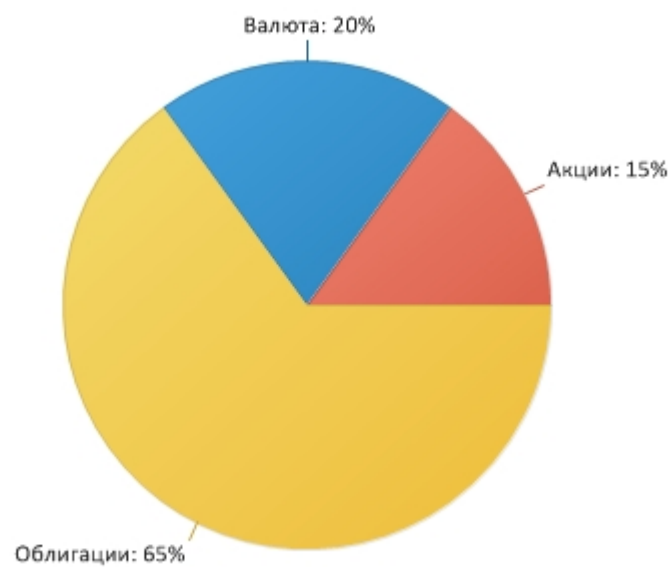
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 876		546	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	6,5%	2,2%	13,4%	4,5%
с начала текущего года	0,0%	0,0%	-0,3%	-1,9%
за 1 год	2,9%	2,9%	5,0%	5,0%
за 6 месяцев	3,0%	6,0%	4,0%	8,0%
за 3 месяца	0,8%	3,2%	0,7%	2,8%
за месяц	0,0%	0,0%	0,2%	2,4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,7		0,8	
Волатильность	3,2%		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	68 987 585
Облигации	164 146 823
Итого	233 134 408

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Камаз обл. БО-02	20 698 800		
ЮниКредит Банк обл. БО-08	20 616 600		
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	17 400 350		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	16 089 298		
Магнит обл. БО-07	15 594 600		
Банк Зенит обл. 11	15 157 950		
Русал Братск обл.07	14 865 000		
Росбанк обл. БО-6	13 164 125		
Сбербанк России аои	10 386 912		
Россельхозбанк обл. 03	10 378 700		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Магнит обл. БО-07	13,99%	21.09.2015	8,04%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	13,74%	13.10.2015	8,25%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	13,37%	23.02.2016	7,72%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	11,67%	13.03.2020	9,08%
Банк Зенит обл. 11	10,23%	16.10.2018	8,66%
Русал Братск обл.07	9,97%	22.02.2018	12,37%
Газпромбанк обл. БО-04	6,80%	20.12.2014	7,76%
Росбанк обл. БО-6	6,79%	30.01.2016	8,06%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6,78%	07.12.2017	9,15%
Россельхозбанк обл. 03	6,66%	09.02.2017	5,64%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Сбербанк России аои	13,58%	▼ -5,37
НК ЛУКОЙЛ аои	13,39%	▼ -0,42
Газпром аои	13,38%	▼ -4,65
Магнит аои	6,41%	▲ +4,96
Сургутнефтегаз аои	6,03%	▲ +0,27
НОВАТЭК аои	5,99%	▲ +4,90
Роснефть аои	5,69%	▼ -0,62
Башнефть аои	5,52%	▲ +0,54
Норильский никель аои	5,30%	▲ +9,61
МТС аои	4,55%	▼ -6,35
Банк ВТБ аои	4,07%	▼ -8,03
Уралкалий аои	3,75%	▼ -3,38
Сургутнефтегаз апи	2,34%	▲ +6,52
Татнефть аои	2,31%	▲ +6,50
Башнефть апи	1,72%	▼ -3,13
Сбербанк России апи	1,02%	▼ -0,21
Мостотрест аои	1,00%	▼ -7,70
Транснефть апи	0,94%	▲ +0,63
Северсталь аои	0,82%	▲ +2,52
Другие	2,18%	