

Ежемесячный бюллетень
Период: Апрель 2014

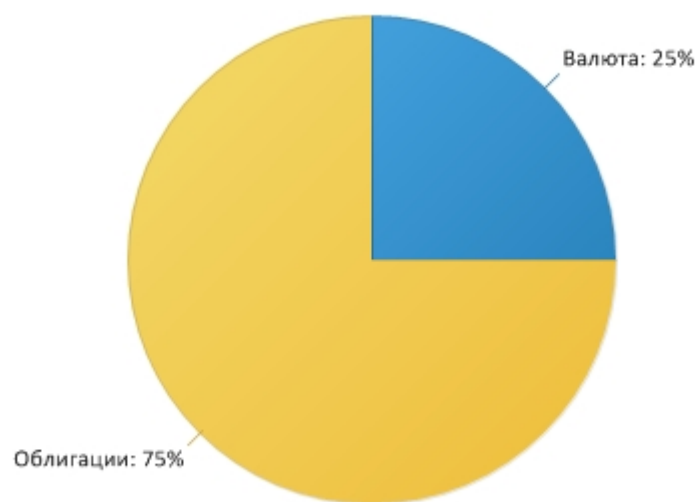
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 621		510	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	3,7%	1,2%	9,5%	3,2%
с начала текущего года	-2,0%	-6,1%	-3,2%	-9,7%
за 1 год	0,4%	0,4%	2,5%	2,5%
за 6 месяцев	-1,3%	-2,6%	-2,5%	-5,0%
за 3 месяца	-1,8%	-7,2%	-2,8%	-11,2%
за месяц	-0,1%	-1,2%	-1,1%	-13,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,4		0,5	
Волатильность	3,2%		5,9%	
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	0,22	Коэффициент Бета	0,16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-400 462
Облигации	778 230
Прочие доходы и расходы	-52 415
Итого	325 354

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Банк Зенит обл. 11	223 500	ЕвразХолдинг Финанс обл.01	-205 870
Россельхозбанк обл. 03	206 000	Росбанк обл. БО-6	-144 700
ВымпелКом-Инвест обл. 07	137 200	Магнит аои	-133 439
ВымпелКом-Инвест обл. 06	136 400	Сбербанк России аои	-107 104
ЮниКредит Банк обл. БО-08	134 000	Газпром аои	-76 670
Газпромбанк обл. БО-04	128 900	Норильский никель обл. БО-02	-38 200
Русфинанс Банк обл. БО-07	98 900	НК ЛУКОЙЛ аои	-33 587
Уралвагонзавод НПК обл.01	73 900	Сургутнефтегаз аои	-24 351
Башнефть аои	66 318	Банк ВТБ аои	-15 896
Магнит обл. БО-07	28 200	Сбербанк России апи	-14 099

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,84%	23.02.2016	7,58%
Магнит обл. БО-07	11,67%	21.09.2015	9,40%
Норильский никель обл. БО-02	11,55%	25.02.2016	9,21%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,42%	13.10.2015	10,04%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,54%	13.03.2020	9,97%
Банк Зенит обл. 11	8,67%	16.10.2018	9,63%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6,02%	07.12.2017	9,15%
Газпромбанк обл. БО-04	6,00%	20.12.2014	8,21%
Росбанк обл. БО-6	5,90%	30.01.2016	9,38%
Россельхозбанк обл. 03	5,83%	09.02.2017	5,98%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,83%	24.04.2018	10,07%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,73%	13.10.2015	9,72%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Магнит аои	100,00%	▼ -12,67