

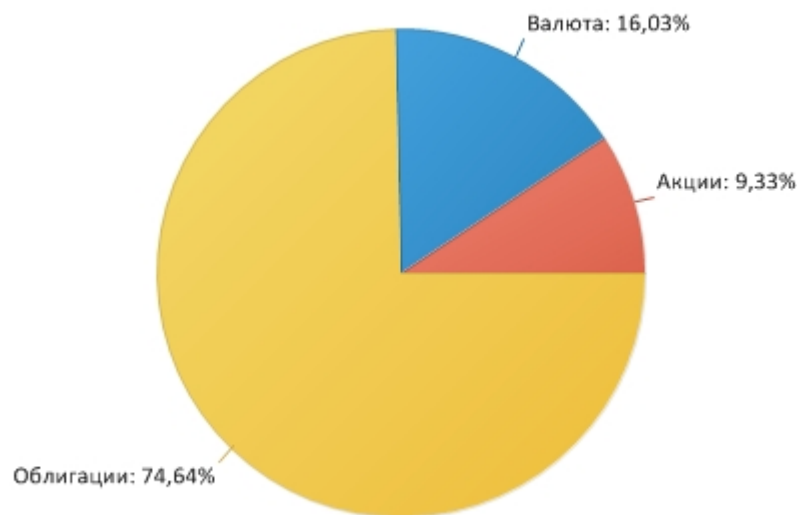
Ежемесячный бюллетень

Период: Июнь 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	12 679		555	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	4,0%	1,3%	13,2%	4,4%
с начала текущего года	-1,5%	-3,0%	0,8%	1,6%
за 1 год	1,4%	1,4%	7,4%	7,4%
за 6 месяцев	-1,5%	-3,0%	0,8%	1,6%
за 3 месяца	0,4%	1,6%	4,1%	16,4%
за месяц	0,3%	3,6%	1,7%	20,4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,4		0,7	
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	0,16	Коэффициент Бета	0,14
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-204 388
Облигации	1 669 867
Прочие доходы и расходы	-47 969
Итого	1 417 510

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Норильский никель обл. БО-02	429 800	Банк ВТБ аои	-103 308
Магнит обл. БО-07	202 400	НК ЛУКОЙЛ аои	-92 003
ВымпелКом-Инвест обл. 06	162 400	Сургутнефтегаз аои	-45 316
Банк Зенит обл. 11	154 500	Башнефть апи	-19 307
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	139 067	Транснефть апи	-12 760
ЮниКредит Банк обл. БО-08	134 000	Башнефть аои	-9 005
ВымпелКом-Инвест обл. 07	119 200	Норильский никель аои	-6 950
Русфинанс Банк обл. БО-07	106 300	Северсталь аои	-6 898
Уралвагонзавод НПК обл.01	74 000	МТС аои	-6 143
Россельхозбанк обл. 03	67 000	Татнефть аои	-5 311

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Магнит обл. БО-07	11,79%	21.09.2015	9,20%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,73%	23.02.2016	10,04%
Норильский никель обл. БО-02	11,72%	25.02.2016	8,73%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,55%	13.10.2015	9,78%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,44%	13.03.2020	9,66%
Банк Зенит обл. 11	8,74%	16.10.2018	9,64%
Росбанк обл. БО-6	5,93%	30.01.2016	9,55%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,89%	24.04.2018	9,99%
Россельхозбанк обл. 03	5,86%	09.02.2017	5,81%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5,80%	07.12.2017	9,15%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,78%	13.10.2015	9,76%
Газпромбанк обл. БО-04	5,77%	20.12.2014	9,06%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Сбербанк России аои	15,37%	▼ -1,41
Газпром аои	15,13%	▲ +3,77
НК ЛУКОЙЛ аои	14,52%	▲ +2,45
Магнит аои	7,86%	▲ +0,21
Норильский никель аои	7,63%	▲ +0,63
Сургутнефтегаз аои	5,70%	▲ +2,41
НОВАТЭК аои	5,56%	▲ +10,66
Роснефть аои	5,25%	▲ +8,61
МТС аои	5,07%	▲ +5,75
Банк ВТБ аои	4,13%	▼ -14,33
Татнефть аои	2,50%	▲ +5,76
Уралкалий аои	1,92%	▼ -0,02
Транснефть апи	1,91%	▼ -6,56
Башнефть аои	1,48%	▲ +5,65
Сургутнефтегаз апи	1,39%	▲ +6,94
Аэрофлот аои	1,36%	▲ +1,67
Северсталь аои	0,92%	▼ -6,93
Башнефть апи	0,87%	▼ -1,04
НЛМК аои	0,73%	▼ -0,88
Сбербанк России апи	0,68%	▲ +0,49

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>