

Ежемесячный бюллетень
Период: Август 2014

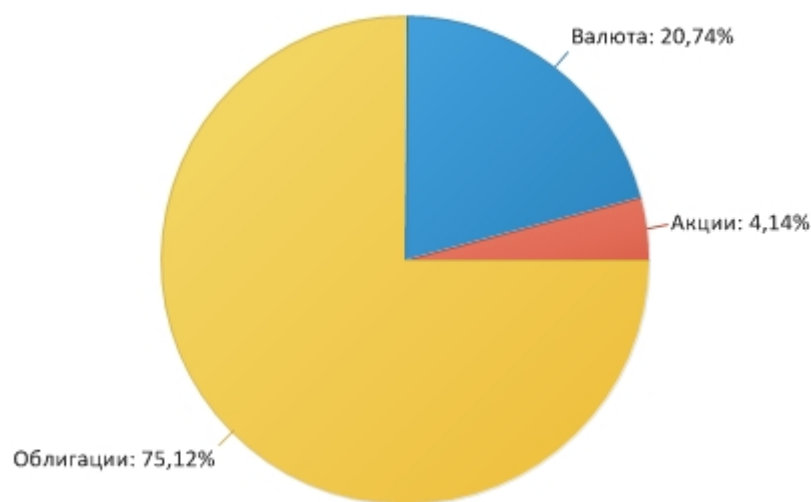
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 678		537	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	6,2%	2,1%	14,1%	4,7%
с начала текущего года	-1,5%	-2,3%	-0,2%	-0,3%
за 1 год	1,3%	1,3%	4,1%	4,1%
за 6 месяцев	-1,5%	-3,0%	0,1%	0,2%
за 3 месяца	0,3%	1,2%	0,6%	2,4%
за месяц	0,2%	2,4%	0,4%	4,8%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,7		0,8	
Волатильность	3,1%		5,8%	
Максимальное снижение	-4,4%		-5,6%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММБВ + 75% Индекс ММБВ корпоративных облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,18	Коэффициент Бета	0,13
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	499 231
Облигации	746 802
Прочие доходы и расходы	-46 850
Итого	1 199 183

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
ЮниКредит Банк обл. БО-08	192 562	Россельхозбанк обл. 03	-213 700
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	183 253	Норильский никель обл. БО-02	-111 800
Газпром аои	177 072	Банк ВТБ аои	-25 142
ВымпелКом-Инвест обл. 06	144 978	Аэрофлот аои	-14 665
Банк Зенит обл. 11	114 300	ВымпелКом-Инвест обл. 07	-10 500
Магнит обл. БО-07	97 200	Сбербанк России апи	-4 858
Газпромбанк обл. БО-04	96 200	Башнефть аои	-1 781
Русфинанс Банк обл. БО-07	93 009		
Росбанк обл. БО-6	84 800		
Уралвагонзавод НПК обл.01	76 500		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Магнит обл. БО-07	11,95%	21.09.2015	9,61%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11,74%	13.10.2015	9,97%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11,48%	23.02.2016	10,05%
Норильский никель обл. БО-02	11,28%	25.02.2016	9,93%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9,71%	13.03.2020	9,40%
Банк Зенит обл. 11	8,89%	16.10.2018	10,94%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,98%	24.04.2018	10,07%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5,89%	07.12.2017	9,23%
Газпромбанк обл. БО-04	5,87%	20.12.2014	8,99%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	5,86%	13.10.2015	10,23%
Росбанк обл. БО-6	5,78%	30.01.2016	9,54%
Россельхозбанк обл. 03	5,56%	09.02.2017	6,97%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	18,54%	▲ +3,12
Газпром аои	10,81%	▲ +0,04
Сбербанк России аои	9,63%	▼ -0,59
НОВАТЭК аои	8,03%	▲ +0,73
Норильский никель аои	7,25%	▲ +2,59
Роснефть аои	6,47%	▲ +2,01
МТС аои	6,29%	▲ +3,75
Магнит аои	5,76%	▼ -0,84
Банк ВТБ аои	5,19%	▼ -4,08
Сургутнефтегаз аои	4,77%	▲ +4,46
Татнефть аои	3,26%	▲ +7,69
Сургутнефтегаз апи	3,01%	▲ +3,48
Транснефть апи	2,55%	▲ +9,99
Аэрофлот аои	1,58%	▼ -7,28
Сбербанк России апи	1,45%	▼ -3,39
Уралкалий аои	1,21%	▲ +0,17
Северсталь аои	1,12%	▲ +4,28
Башнефть аои	1,11%	▼ -1,25
Башнефть апи	1,06%	▼ -2,28
НЛМК аои	0,92%	▲ +10,63