

**Ежемесячный бюллетень**
**Период:** Февраль 2013

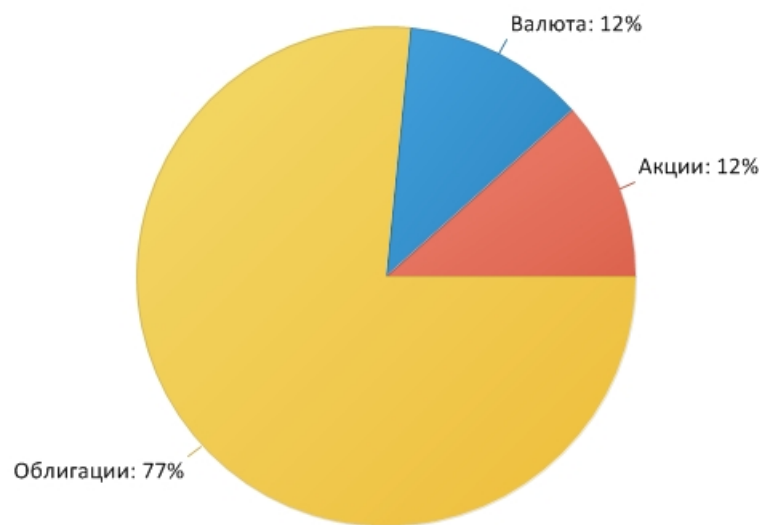
**Фонд:** Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

**Правила ДУ:** №0982-94130523 от 20.09.2007

**Динамика стоимости пая за период**

	Стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 519		543	
<b>Доходность</b>				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	14.6%	4.9%	24.0%	8.0%
с начала текущего года	1.4%	8.7%	1.7%	10.5%
за 1 год	2.2%	2.2%	5.1%	5.1%
за 6 месяцев	3.3%	6.6%	4.8%	9.6%
за 3 месяца	3.4%	13.6%	4.3%	17.2%
за месяц	-0.4%	-4.8%	-0.5%	-6.0%
<b>Показатели качества управления</b>				
Коэффициент Шарпа	1.1		1.3	
Волатильность	4.3%		6.0%	
Максимальное снижение	-7.5%		-7.8%	

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


**Структура портфеля по типам инструментов**

**Структура прибыли и убытков за период**

Коэффициент Альфа	0.29	Коэффициент Бета	0.20
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-1 514 428
Облигации	1 159 206
Прочие доходы и расходы	-40 257
<b>Итого</b>	<b>-395 479</b>

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Кубаньэнерго аои	232 827	Газпром аои	-303 056
Русал Братск обл.07	217 090	Норильский никель аои	-262 493
Камаз обл. БО-02	132 000	Сбербанк России аои	-194 177
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	120 700	Роснефть аои	-188 658
МТС обл.04	86 625	Северсталь аои	-151 051
Россельхозбанк обл. 03	84 830	ММК аои	-142 691
Банк Зенит обл. 08	80 500	НЛМК аои	-141 412
Уралвагонзавод НПК обл.01	70 900	Татнефть аои	-126 720
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	70 000	Сургутнефтегаз аои	-101 737
Банк Зенит обл. 05	69 720	НК ЛУКОЙЛ аои	-100 988

**Структура портфеля облигаций и депозитов**

Ценная бумага	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Камаз обл. БО-02	11.38%	04.02.2014	8.73%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	10.03%	13.03.2020	9.45%
Россельхозбанк обл. 03	9.79%	09.02.2017	7.78%
Русал Братск обл.07	9.33%	22.02.2018	11.98%
Росбанк обл. БО-6	8.63%	30.01.2016	8.60%
МТС обл.04	7.47%	13.05.2014	7.90%
Банк Зенит обл. 05	6.95%	04.06.2013	8.25%
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	5.88%	23.09.2013	9.01%
Альфа-Банк обл. БО-03	5.88%	28.09.2015	8.07%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5.77%	07.12.2017	9.43%
Банк Зенит обл. 08	5.69%	23.08.2017	8.36%
ВТБ 24 вып.4	5.68%	20.02.2014	8.10%
Газпромбанк обл. БО-04	2.91%	20.12.2014	8.01%
ВТБ обл. БО-06	2.90%	19.12.2014	7.99%
Респ. САХА (Якутия) обл. 35001	1.72%	11.04.2013	6.99%

**Структура портфеля акций**

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
НК ЛУКОЙЛ аои	15.80%	▼ -1.84
Сбербанк России аои	15.33%	▼ -4.06
Газпром аои	12.82%	▼ -3.36
Норильский никель аои	7.95%	▼ -8.54
Роснефть аои	6.52%	▼ -7.55
Татнефть аои	6.10%	▼ -7.20
Уралкалий аои	5.61%	▲ +0.56
НЛМК аои	5.08%	▼ -6.63
ММК аои	4.98%	▼ -6.58
Северсталь аои	4.76%	▼ -7.88
Сургутнефтегаз апи	4.36%	▼ -0.09
НОВАТЭК аои	4.04%	▼ -2.33
Сургутнефтегаз аои	3.68%	▼ -7.07
Банк ВТБ аои	2.98%	▲ +0.97