

Ежемесячный бюллетень
Период: Апрель 2013

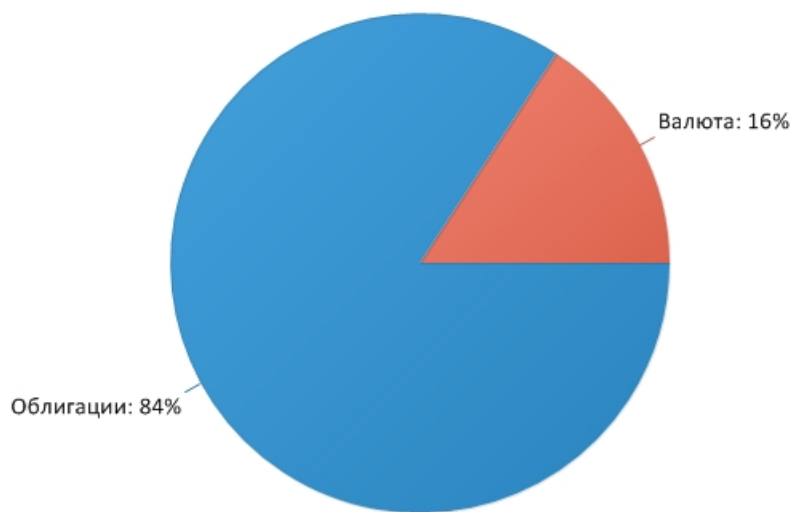
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: №0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 568		521	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	10.6%	3.5%	18.2%	6.1%
с начала текущего года	1.8%	5.5%	1.1%	3.3%
за 1 год	3.9%	3.9%	5.1%	5.1%
за 6 месяцев	3.7%	7.4%	3.5%	7.0%
за 3 месяца	-0.2%	-0.8%	-1.0%	-4.0%
за месяц	0.4%	4.8%	-0.1%	-1.2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0.9		1.0	
Волатильность	3.9%		5.9%	
Максимальное снижение	-5.3%		-7.8%	

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


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0.28	Коэффициент Бета	0.17
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-112 121
Облигации	883 978
Прочие доходы и расходы	-76 765
Итого	695 092

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Росбанк обл. БО-6	267 304	ЕвразХолдинг Финанс обл.01	-604 690
Камаз обл. БО-02	159 400	Газпром аои	-127 845
Сургутнефтегаз аои	152 595	НК ЛУКОЙЛ аои	-53 439
Русал Братск обл.07	149 940	Северсталь аои	-46 254
Альфа-Банк обл. БО-03	149 774	Банк ВТБ аои	-40 831
Россельхозбанк обл. 03	137 870	Роснефть аои	-40 781
МТС обл.04	121 875	НЛМК аои	-25 185
Банк Зенит обл. 08	88 600	Татнефть аои	-13 354
Банк Зенит обл. 05	82 800	Мостотрест аои	-9 743
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	82 000	Транснефть апи	-6 457

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Росбанк обл. БО-6	10.67%	30.01.2016	8.12%
Камаз обл. БО-02	10.46%	04.02.2014	8.57%
Альфа-Банк обл. БО-03	10.36%	28.09.2015	7.53%
Россельхозбанк обл. 03	8.99%	09.02.2017	7.41%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	8.80%	13.03.2020	-0.16%
Русал Братск обл.07	8.56%	22.02.2018	12.64%
МТС обл.04	6.87%	13.05.2014	7.60%
Банк Зенит обл. 05	6.38%	04.06.2013	7.08%
Газпромбанк обл. БО-04	5.35%	20.12.2014	7.71%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5.30%	07.12.2017	9.54%
Банк Зенит обл. 08	5.23%	23.08.2017	7.52%
ВТБ 24 вып.4	5.22%	20.02.2014	7.87%
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	5.19%	23.09.2013	8.19%
ВТБ обл. БО-06	2.62%	19.12.2014	7.76%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
---------------	-----------------------	------------------------