

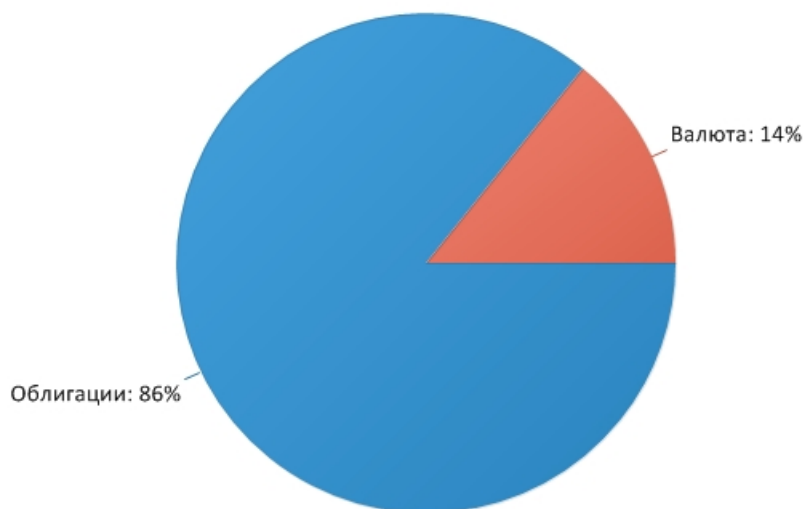
Ежемесячный бюллетень

Период: Июнь 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	12 503		508	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12.3%	4.1%	17.5%	5.8%
с начала текущего года	1.2%	2.4%	0.7%	1.4%
за 1 год	5.1%	5.1%	7.3%	7.3%
за 6 месяцев	1.2%	2.4%	0.7%	1.4%
за 3 месяца	0.0%	0.0%	-0.6%	-2.4%
за месяц	0.1%	1.2%	-0.3%	-3.6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1.2		1.0	
Волатильность	3.3%		5.7%	
Максимальное снижение	-4.8%		-7.8%	

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


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0.31	Коэффициент Бета	0.16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-111 019
Облигации	1 008 308
Прочие доходы и расходы	-61 437
Итого	835 853

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Камаз обл. БО-02	167 200	Мостотрест аои	-41 179
Россельхозбанк обл. 03	146 370	НК ЛУКОЙЛ аои	-15 355
Русал Братск обл.07	114 240	Татнефть аои	-12 664
Банк Зенит обл. 08	80 400	Сбербанк России аои	-11 624
Уралвагонзавод НПК обл.01	76 000	Магнит аои	-9 761
Альфа-Банк обл. БО-03	66 400	Роснефть аои	-4 847
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	59 330	Сбербанк России апи	-3 346
Газпромбанк обл. БО-04	56 800	Норильский никель аои	-3 129
МТС обл.04	51 500	Уралкалий аои	-2 373
Росбанк обл. БО-6	49 980	Башнефть апи	-1 937

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Камаз обл. БО-02	10.62%	04.02.2014	8.70%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	10.56%	23.02.2016	8.21%
Росбанк обл. БО-6	9.21%	30.01.2016	8.13%
Россельхозбанк обл. 03	9.12%	09.02.2017	7.41%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	8.92%	13.03.2020	8.99%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	8.90%	13.10.2015	8.33%
Русал Братск обл.07	8.65%	22.02.2018	14.63%
Банк Зенит обл. 08	7.95%	23.08.2017	8.22%
Альфа-Банк обл. БО-03	5.26%	28.09.2015	7.12%
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	5.26%	23.09.2013	8.59%
Газпромбанк обл. БО-04	5.20%	20.12.2014	7.80%
МТС обл.04	5.19%	13.05.2014	7.50%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5.15%	07.12.2017	9.58%

Структура портфеля акций

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