

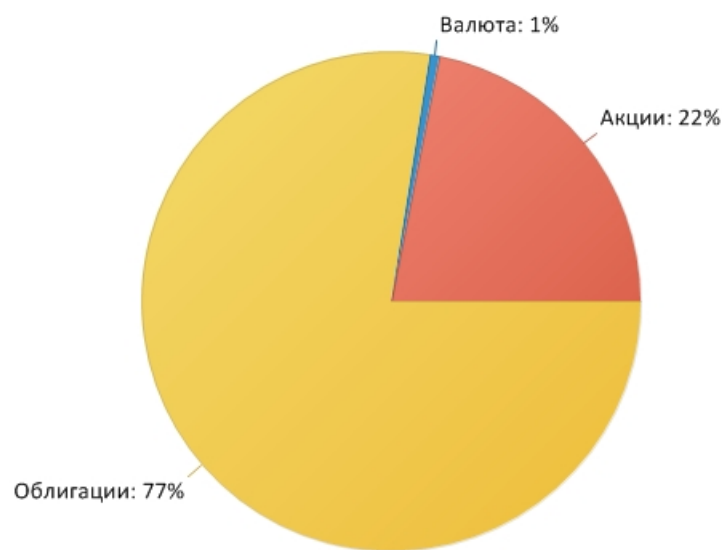
Ежемесячный бюллетень

Период: Июль 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	12 499		521	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	11.8%	3.9%	18.0%	6.0%
с начала текущего года	1.2%	2.1%	2.3%	4.0%
за 1 год	4.4%	4.4%	6.8%	6.8%
за 6 месяцев	-0.6%	-1.2%	0.2%	0.4%
за 3 месяца	-0.6%	-2.4%	1.1%	4.4%
за месяц	0.0%	0.0%	1.7%	20.4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1.2		1.1	
Волатильность	3.3%		5.6%	
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	0.30	Коэффициент Бета	0.16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-900 363
Облигации	1 497 239
Прочие доходы и расходы	-50 582
Итого	546 294

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Газпром аои	589 698	Уралкалий аои	-1 053 585
ЮниКредит Банк обл. БО-08	204 400	Сбербанк России аои	-199 583
Росбанк обл. БО-6	147 390	Норильский никель аои	-133 431
Россельхозбанк обл. 03	147 050	Роснефть аои	-65 238
ВымпелКом-Инвест обл. 06	147 050	НК ЛУКОЙЛ аои	-32 935
Камаз обл. БО-02	142 200	Татнефть аои	-29 126
Русал Братск обл.07	140 250	НОВАТЭК аои	-20 963
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	126 310	Башнефть апи	-16 484
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	85 400	ММК аои	-13 637
МТС обл.04	81 500	Сургутнефтегаз аои	-10 524

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Камаз обл. БО-02	11.84%	04.02.2014	8.76%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	11.82%	23.02.2016	7.97%
Россельхозбанк обл. 03	10.19%	09.02.2017	6.97%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	9.95%	13.03.2020	8.99%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	9.94%	13.10.2015	8.24%
Росбанк обл. БО-6	9.86%	30.01.2016	8.05%
Русал Братск обл.07	9.66%	22.02.2018	15.31%
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	5.88%	23.09.2013	7.64%
Газпромбанк обл. БО-04	5.80%	20.12.2014	7.79%
МТС обл.04	5.79%	13.05.2014	7.24%
Уралвагонзавод НПК обл.01	5.75%	07.12.2017	9.58%
Альфа-Банк обл. БО-03	3.52%	28.09.2015	6.88%

Структура портфеля акций

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Газпром аои	15.22%	▲ +19.14
НК ЛУКОЙЛ аои	14.76%	▲ +4.67
Сбербанк России аои	14.67%	▲ +1.39
Магнит аои	6.42%	▲ +9.31
Сургутнефтегаз аои	5.91%	▲ +2.32
Роснефть аои	5.61%	▲ +4.39
НОВАТЭК аои	5.26%	▲ +1.47
Норильский никель аои	5.18%	▼ -5.68
МТС аои	4.69%	▲ +6.43
Уралкалий аои	4.47%	▼ -33.01
Банк ВТБ аои	4.28%	▼ -0.85
Татнефть аои	2.60%	▲ +5.47
Транснефть апи	2.40%	▲ +10.08
Сургутнефтегаз апи	2.17%	▲ +4.92
Башнефть апи	1.58%	▲ +19.32
Мостотрест аои	1.17%	▼ -2.99
Сбербанк России апи	1.11%	▲ +6.40
Северсталь аои	0.81%	▲ +20.85
НЛМК аои	0.73%	▲ +11.97
Другие	0.95%	