

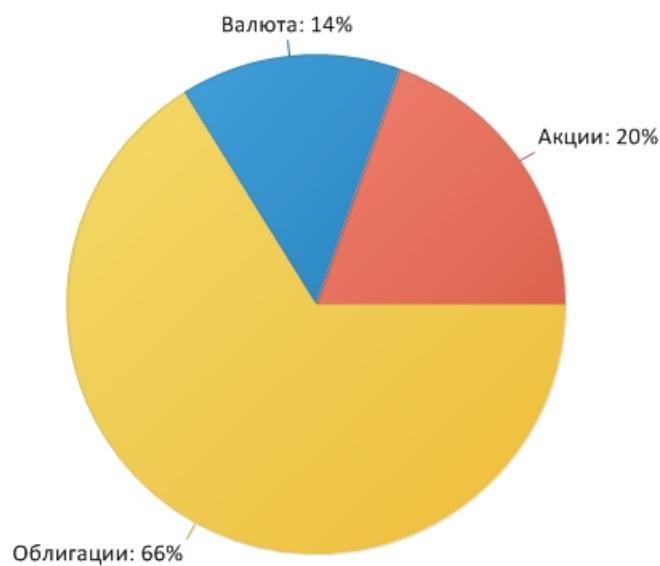
**Ежемесячный бюллетень**

**Период:** Август 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	12 507		519	
<b>Доходность</b>				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	11.7%	3.9%	18.3%	6.1%
с начала текущего года	1.3%	2.0%	2.6%	3.9%
за 1 год	3.4%	3.4%	6.1%	6.1%
за 6 месяцев	-0.1%	-0.2%	0.9%	1.8%
за 3 месяца	0.1%	0.4%	1.4%	5.6%
за месяц	0.1%	1.2%	0.3%	3.6%
<b>Показатели качества управления</b>				
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	0.28	Коэффициент Бета	0.16
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	-120 507
Облигации	1 011 399
Прочие доходы и расходы	-48 829
<b>Итого</b>	<b>842 063</b>

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Газпром аои	389 231	Сбербанк России аои	-726 761
Роснефть аои	193 079	Магнит аои	-421 887
Башнефть апи	190 231	Банк ВТБ аои	-98 939
ЮниКредит Банк обл. БО-08	184 400	Аэрофлот аои	-58 856
Уралкалий аои	184 381	Сбербанк России апи	-54 504
Камаз обл. БО-02	140 000	Норильский никель аои	-50 054
МТС аои	127 853	Транснефть апи	-48 227
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	126 480	НК ЛУКОЙЛ аои	-47 346
Росбанк обл. БО-6	125 460	Сургутнефтегаз аои	-21 053
ВымпелКом-Инвест обл. 06	114 750	Группа ЛСР аои	-12 801

**Структура портфеля облигаций и депозитов**

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ЮниКредит Банк обл. БО-08	13.41%	23.02.2016	7.79%
Камаз обл. БО-02	13.38%	04.02.2014	8.81%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	11.73%	13.03.2020	9.00%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	11.71%	13.10.2015	8.25%
Росбанк обл. БО-6	11.62%	30.01.2016	8.02%
Русал Братск обл.07	10.84%	22.02.2018	18.23%
Банк Санкт-Петербург обл. БО-02	6.93%	23.09.2013	5.57%
Газпромбанк обл. БО-04	6.84%	20.12.2014	7.66%
Уралвагонзавод НПК обл.01	6.80%	07.12.2017	8.69%
Россельхозбанк обл. 03	6.74%	09.02.2017	6.99%

**Структура портфеля акций**

Ценная бумага	Доля в портфеле акций	Изменение за период, %
Сбербанк России аои	21.27%	▼ -6.41
Газпром аои	11.94%	▲ +1.92
НК ЛУКОЙЛ аои	11.90%	▼ -1.66
НОВАТЭК аои	7.76%	▲ +1.89
МТС аои	7.58%	▲ +4.51
Банк ВТБ аои	6.22%	▼ -4.16
Магнит аои	5.66%	▼ -8.32
Сургутнефтегаз аои	4.81%	▼ -1.19
Роснефть аои	4.43%	▲ +4.47
Норильский никель аои	3.96%	▼ -1.68
Башнефть апи	2.62%	▲ +13.24
Татнефть аои	2.10%	▲ +1.64
Аэрофлот аои	2.04%	▼ -13.63
Транснефть апи	1.90%	▼ -4.00
Сургутнефтегаз апи	1.68%	▲ +3.81
Мостотрест аои	1.30%	▼ -0.24
Сбербанк России апи	0.92%	▼ -6.79
Северсталь аои	0.66%	▲ +9.52
НЛМК аои	0.60%	▲ +9.46
Другие	0.66%	