

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.05.2016 по 31.05.2016

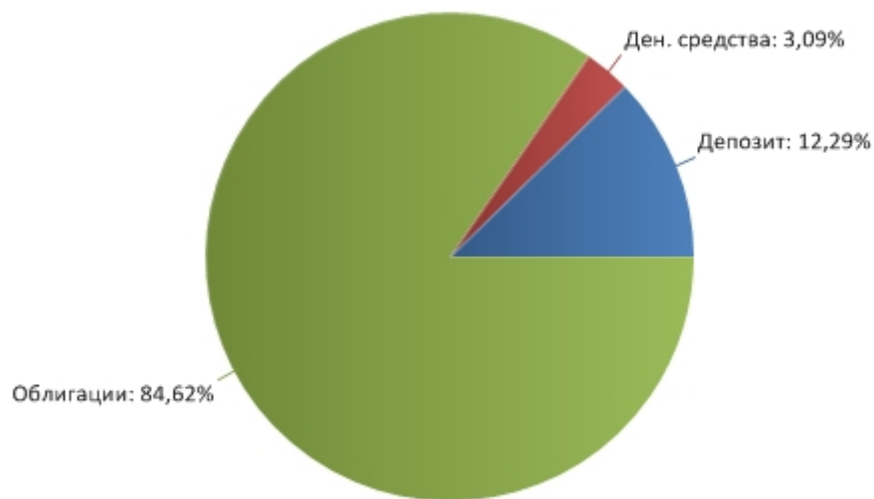
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	14 301		701	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	14,5%	4,8%	32,0%	10,7%
с начала текущего года	3,6%	8,7%	6,5%	15,6%
за 1 год	8,0%	8,0%	15,0%	15,0%
за 6 месяцев	4,2%	8,4%	7,2%	14,3%
за 3 месяца	2,0%	8,1%	3,7%	14,6%
за месяц	0,6%	7,7%	0,1%	0,6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,4		1,0	
Волатильность	3,5%		10,4%	
Максимальное снижение	-4,1%		-6,5%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММБВ + 75% Индекс ММБВ корп. облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,41	Коэффициент Бета	-0,03
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	514 451
Депозит	252 689
Облигации	270 244
Итого	1 037 384
Фин. рез. с начала года	10 053 557

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Ростелеком обл. БО-01	423 500	Газпромбанк обл. 07	-1 281 510
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	310 010		
Россельхозбанк обл. 03	266 510		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	252 689		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	191 690		
Русфинанс Банк обл. БО-12	179 250		
Фольксваген Банк РУС обл. 09	132 569		
Русфинанс Банк обл. БО-07	48 225		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Россельхозбанк обл. 03	RUB	13,68%	09.02.2017	-6,02%
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	RUB	13,62%	27.05.2020	10,31%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,36%	16.10.2018	11,36%
Газпромбанк обл. 07	RUB	13,28%	17.10.2016	10,83%
Фольксваген Банк РУС обл. 09	RUB	13,28%	20.10.2019	11,68%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	RUB	12,68%	24.05.2016	10,50%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	11,49%	16.05.2025	10,20%
Русфинанс Банк обл. БО-12	RUB	7,04%	26.02.2021	10,57%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,57%	24.04.2018	10,61%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%