

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.07.2016 по 31.07.2016

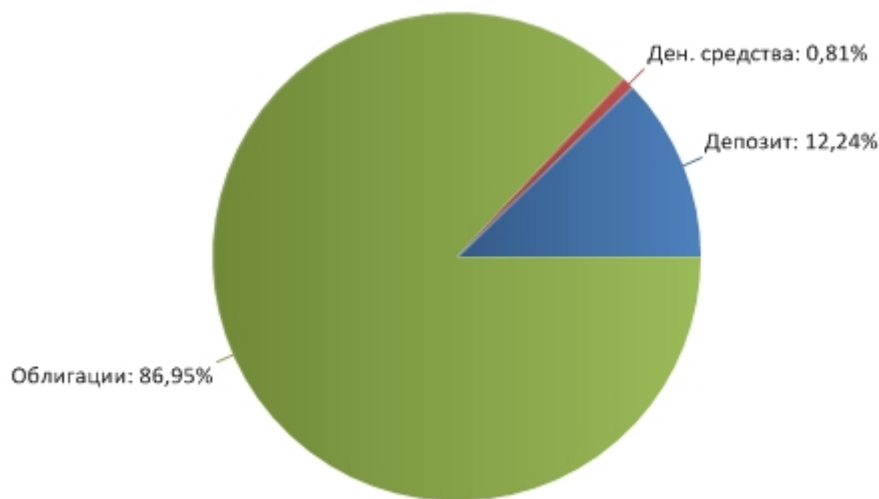
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	14 473		719	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	15,3%	5,1%	32,6%	10,9%
с начала текущего года	4,9%	8,4%	8,6%	14,8%
за 1 год	7,6%	7,6%	15,1%	15,1%
за 6 месяцев	3,8%	7,7%	7,8%	15,6%
за 3 месяца	1,8%	7,4%	2,1%	8,2%
за месяц	0,5%	5,9%	1,1%	13,1%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,4		1,0	
Волатильность	3,5%		10,3%	
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	0,44	Коэффициент Бета	-0,03
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	575 754
Депозит	245 000
Облигации	1 733 919
Итого	2 554 673
Фин. рез. с начала года	14 323 172

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Фольксваген Банк РУС обл. 09	287 390		
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	278 400		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	261 290		
Газпромбанк обл. 07	250 270		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	245 000		
Россельхозбанк обл. 03	243 310		
Русфинанс Банк обл. БО-12	188 400		
Ростелеком обл. БО-01	173 500		
Русфинанс Банк обл. БО-07	37 550		
ОФЗ обл. 26203	13 809		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Россельхозбанк обл. 03	RUB	13,64%	09.02.2017	-11,87%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,25%	16.10.2018	11,16%
Фольксваген Банк РУС обл. 09	RUB	13,21%	20.10.2019	10,01%
Газпромбанк обл. 07	RUB	13,18%	17.10.2016	9,61%
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	RUB	13,11%	27.05.2020	9,89%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	RUB	12,34%	24.05.2016	9,75%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	11,36%	16.05.2025	10,35%
Русфинанс Банк обл. БО-12	RUB	6,99%	26.02.2021	10,05%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,56%	24.04.2018	10,17%
ОФЗ обл. 26203	RUB	1,36%	03.08.2016	10,79%

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%

Структура портфеля акций

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