

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.08.2016 по 31.08.2016

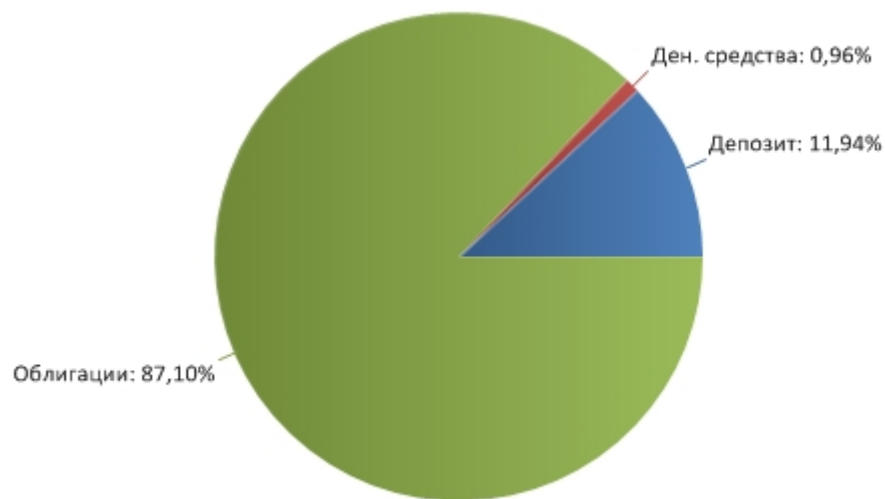
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	14 578		726	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	16,6%	5,5%	34,0%	11,3%
с начала текущего года	5,6%	8,5%	9,9%	14,8%
за 1 год	7,9%	7,9%	15,2%	15,2%
за 6 месяцев	4,0%	8,0%	6,9%	13,8%
за 3 месяца	1,9%	7,8%	3,3%	13,1%
за месяц	0,7%	8,8%	1,1%	13,4%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,7		1,1	
Волатильность	3,3%		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	0,46	Коэффициент Бета	-0,03
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	529 582
Депозит	391 066
Облигации	3 707 762
Итого	4 628 410
Фин. рез. с начала года	17 687 289

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Газпромбанк обл. 07	571 270		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	557 080		
Россельхозбанк обл. 03	532 900		
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	509 010		
Ростелеком обл. БО-01	476 000		
Фольксваген Банк РУС обл. 09	430 920		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	231 230		
Русфинанс Банк обл. БО-07	204 873		
Русфинанс Банк обл. БО-12	198 350		
МТС обл.08	168 600		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	12,75%	16.10.2018	10,97%
Газпромбанк обл. 07	RUB	12,69%	17.10.2016	8,20%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	12,39%	09.02.2017	9,38%
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	RUB	12,25%	27.05.2020	9,67%
Фольксваген Банк РУС обл. 09	RUB	11,62%	20.10.2019	10,38%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	10,75%	16.05.2025	10,16%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-165	RUB	6,22%	10.11.2016	9,75%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	RUB	5,83%	24.05.2016	9,75%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	5,16%	24.04.2018	10,11%
МТС обл.08	RUB	4,28%	03.11.2020	8,05%
Русфинанс Банк обл. БО-12	RUB	4,17%	26.02.2021	9,73%
ОФЗ обл. 26206	RUB	1,87%	14.06.2017	9,00%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%

АО Управляющая компания «Либра Капитал» (Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00663 выдана ФСФР России 06 октября 2009 г., срок действия - бессрочная). Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Либра – Пенсионный Капитал» под управлением АО Управляющей компании «Либра Капитал». Правила доверительного управления зарегистрированы ФСФР России 20.09.2007 № 0982-94130523. Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем. Государство не гарантирует доходность инвестиций в паевые инвестиционные фонды. Прежде чем приобрести инвестиционные паи, внимательно ознакомьтесь с Правилами доверительного управления паевого инвестиционного фонда. Правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами, находящимися под управлением ЗАО Управляющая компания «Либра Капитал», предусмотрены надбавки при приобретении паев и скидки к расчетной стоимости паев при их погашении. Обращаем Ваше внимание на то, что взимание скидок уменьшает доходность инвестиций в инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов. Информация о местах, где до приобретения инвестиционных паев можно получить информацию о Фонде и ознакомиться с Правилами и иными документами: 119017, Москва, ул. Большая Ордынка, д. 40, стр. 3, тел. (495) 580-77-81 Адрес в сети Интернет: <http://www.libra-am.ru>