

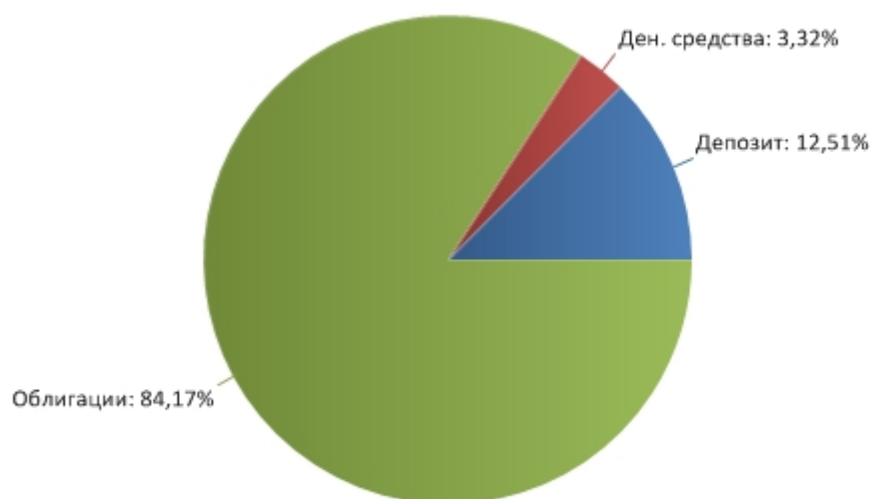
Ежемесячный бюллетень

Период: с 01.04.2016 по 30.04.2016
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	14 210		712	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	13,1%	4,4%	31,7%	10,6%
с начала текущего года	3,0%	9,0%	6,5%	19,6%
за 1 год	8,2%	8,2%	15,2%	15,2%
за 6 месяцев	4,1%	8,2%	9,0%	17,9%
за 3 месяца	1,9%	7,8%	5,7%	22,7%
за месяц	0,7%	8,4%	2,2%	26,3%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,2		1,0	
Волатильность	3,7%		10,5%	
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	0,37	Коэффициент Бета	-0,02
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	591 215
Депозит	245 574
Облигации	3 568 161
Итого	4 404 949
Фин. рез. с начала года	9 534 520

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Газпромбанк обл. 07	1 820 620		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	457 620		
Россельхозбанк обл. 03	343 940		
Фольксваген Банк РУС обл. 09	307 000		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	245 574		
Ростелеком обл. БО-01	240 250		
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	231 130		
Русфинанс Банк обл. БО-12	136 800		
Русфинанс Банк обл. БО-07	30 801		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Газпромбанк обл. 07	RUB	14,02%	17.10.2016	-0,51%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	13,72%	09.02.2017	-4,31%
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	RUB	13,64%	27.05.2020	10,70%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,43%	16.10.2018	10,73%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	RUB	12,94%	24.05.2016	10,70%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	12,10%	16.05.2025	11,06%
Фольксваген Банк РУС обл. 09	RUB	11,52%	20.10.2019	10,64%
Русфинанс Банк обл. БО-12	RUB	7,05%	26.02.2021	10,99%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,57%	24.04.2018	11,24%

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%

Структура портфеля акций

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