

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.02.2016 по 29.02.2016

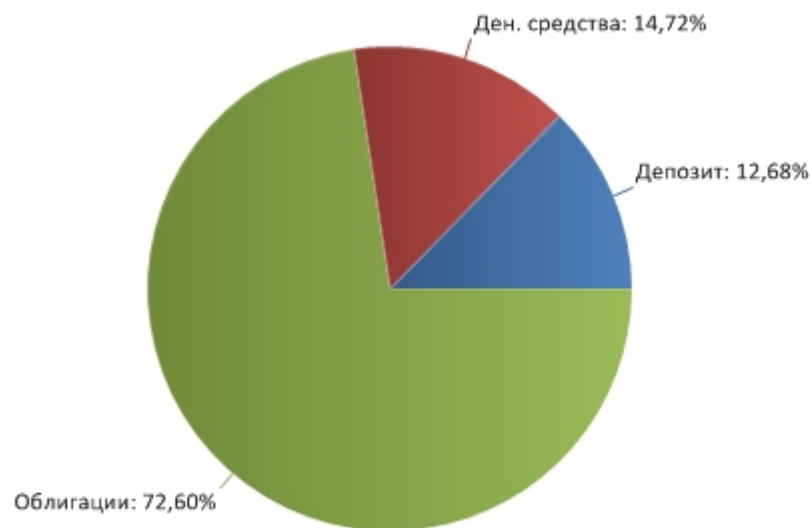
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	14 017		679	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12,0%	4,0%	26,6%	8,9%
с начала текущего года	1,6%	9,8%	2,9%	17,7%
за 1 год	8,9%	8,9%	15,7%	15,7%
за 6 месяцев	3,8%	7,6%	7,2%	14,4%
за 3 месяца	2,2%	8,8%	3,4%	13,6%
за месяц	0,6%	7,2%	2,1%	25,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,1		0,8	
Волатильность	3,7%		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	0,32	Коэффициент Бета	-0,01
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	529 774
Депозит	174 109
Облигации	1 614 639
Итого	2 318 522
Фин. рез. с начала года	3 538 686

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Ростелеком обл. БО-01	338 385		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	286 000		
Росбанк обл. БО-07	208 436		
Норильский никель обл. БО-02	203 000		
Газпром капитал обл. 06	202 250		
Россельхозбанк обл. 03	110 142		
ЮниКредит Банк обл. БО-07	92 500		
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	84 233		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-035	73 672		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	63 716		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ИНГ Банк (Евразия) обл. БО-05	RUB	15,95%	27.05.2020	11,18%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-035	RUB	14,87%	22.03.2016	10,70%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,85%	16.10.2018	12,65%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	13,83%	16.05.2025	10,69%
Росбанк обл. БО-07	RUB	13,80%	01.03.2016	8,45%
Газпромбанк обл. 07	RUB	13,76%	17.10.2016	11,35%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	12,04%	09.02.2017	7,92%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,89%	24.04.2018	11,76%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%