

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.06.2016 по 30.06.2016

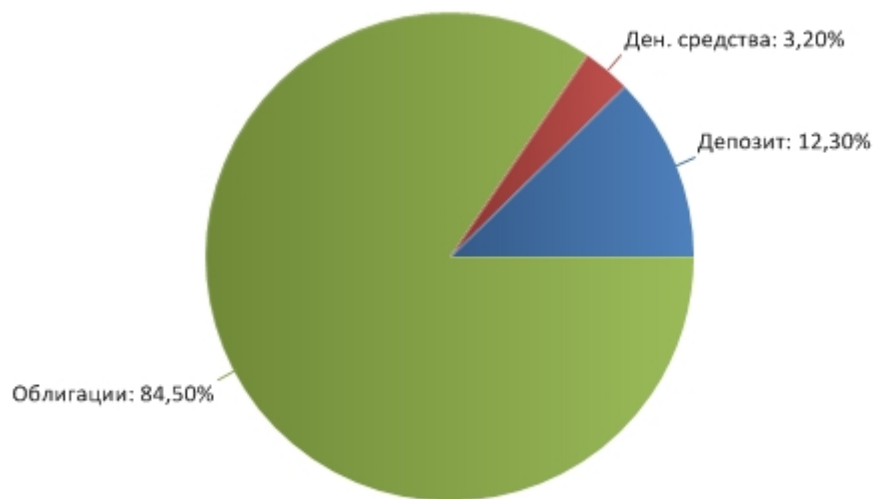
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	14 402		702	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	15,2%	5,1%	33,5%	11,2%
с начала текущего года	4,4%	8,8%	7,3%	14,7%
за 1 год	7,9%	7,9%	14,3%	14,3%
за 6 месяцев	4,4%	8,7%	7,3%	14,7%
за 3 месяца	2,1%	8,3%	3,0%	11,8%
за месяц	0,7%	8,4%	0,9%	10,8%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,4		1,1	
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	0,42	Коэффициент Бета	-0,03
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	571 575
Депозит	240 984
Облигации	2 058 296
Итого	2 870 854
Фин. рез. с начала года	12 348 189

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Россельхозбанк обл. 03	480 530		
Фольксваген Банк РУС обл. 09	356 410		
Газпромбанк обл. 07	328 860		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	286 520		
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	242 440		
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	240 984		
Ростелеком обл. БО-01	215 500		
Русфинанс Банк обл. БО-12	116 700		
Русфинанс Банк обл. БО-07	31 336		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Россельхозбанк обл. 03	RUB	13,81%	09.02.2017	-9,16%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,40%	16.10.2018	11,06%
Фольксваген Банк РУС обл. 09	RUB	13,35%	20.10.2019	10,57%
Газпромбанк обл. 07	RUB	13,34%	17.10.2016	9,83%
ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) АО обл. БО-05	RUB	13,25%	27.05.2020	10,26%
Депозит в Филиал Банка ВТБ (ПАО) в г.Воронеже Д810-22-16-056	RUB	12,70%	24.05.2016	10,50%
Ростелеком обл. БО-01	RUB	11,52%	16.05.2025	10,15%
Русфинанс Банк обл. БО-12	RUB	7,05%	26.02.2021	10,71%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,57%	24.04.2018	10,51%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%