

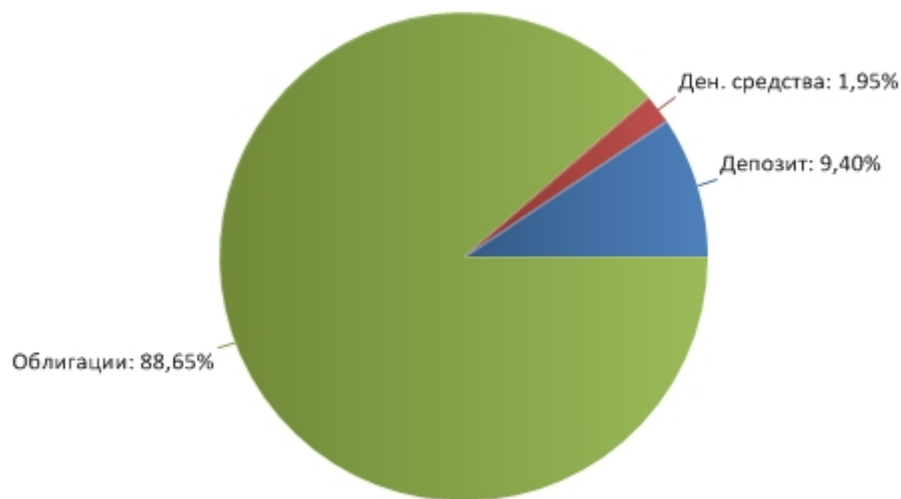
Ежемесячный бюллетень

Период: с 01.08.2015 по 31.08.2015
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"
Правила ДУ: 0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 508		636	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	11,7%	3,9%	23,7%	7,9%
с начала текущего года	7,0%	10,5%	15,1%	22,7%
за 1 год	6,5%	6,5%	12,2%	12,2%
за 6 месяцев	5,0%	10,0%	7,6%	15,2%
за 3 месяца	2,0%	8,0%	3,4%	13,6%
за месяц	0,3%	3,6%	0,8%	9,6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,6		1,4	
Волатильность	2,4%		5,8%	
Максимальное снижение	-4,1%		-6,5%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММБВ + 75% Индекс ММБВ корпоративных облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,26	Коэффициент Бета	0,07
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	536 440
Депозит	168 932
Облигации	1 242 399
Итого	1 947 771
Фин. рез. с начала года	20 006 805

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25077	329 828		
Норильский никель обл. БО-02	194 200		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	176 965		
Магнит обл. БО-07	169 200		
Банк Зенит обл. 11	121 200		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	104 548		
Россельхозбанк обл. 03	78 200		
Росбанк обл. БО-6	67 800		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	66 678		
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 5	64 384		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25077	RUB	38,09%	20.01.2016	10,13%
Магнит обл. БО-07	RUB	9,89%	21.09.2015	12,61%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	RUB	9,77%	13.10.2015	14,22%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	RUB	9,59%	12.11.2015	10,60%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	9,38%	25.02.2016	11,89%
Банк Зенит обл. 11	RUB	7,43%	16.10.2018	14,69%
Росбанк обл. БО-6	RUB	4,74%	30.01.2016	12,46%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	4,70%	09.02.2017	12,60%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	RUB	4,69%	13.10.2015	14,69%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,71%	24.04.2018	12,15%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%