

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.04.2015 по 30.04.2015

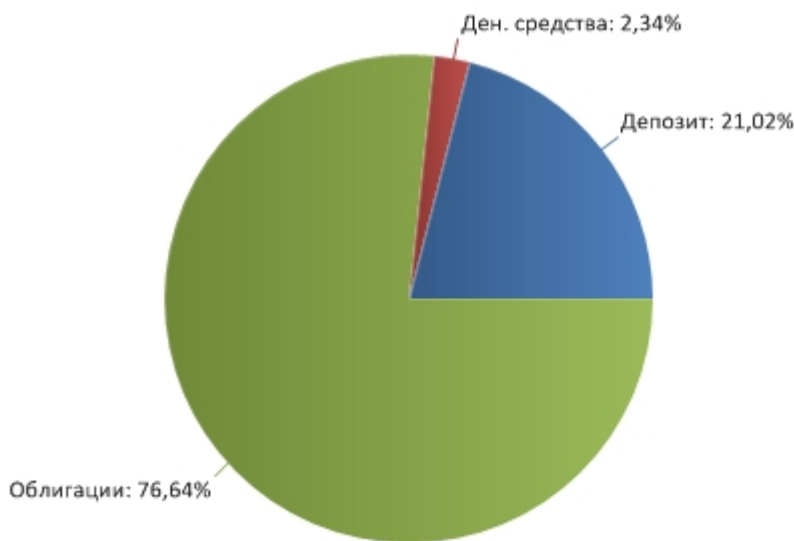
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 132		617	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	8,5%	2,8%	19,9%	6,6%
с начала текущего года	4,0%	12,2%	11,2%	34,1%
за 1 год	4,1%	4,1%	12,0%	12,0%
за 6 месяцев	3,3%	6,6%	8,1%	16,2%
за 3 месяца	3,1%	12,4%	7,6%	30,4%
за месяц	1,3%	15,6%	3,4%	40,8%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,0		1,1	
Волатильность	2,7%		5,9%	
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	0,18	Коэффициент Бета	0,09
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	578 623
Депозит	560 000
Облигации	3 341 034
Итого	4 479 657
Фин. рез. с начала года	11 135 285

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Норильский никель обл. БО-02	852 000		
ОФЗ обл. 25079	802 793		
Магнит обл. БО-07	332 400		
Русфинанс Банк обл. БО-07	331 365		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	302 539		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-041	267 534		
Банк Зенит обл. 11	231 900		
Россельхозбанк обл. 03	183 000		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	178 736		
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 4	168 767		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25079	RUB	32,95%	03.06.2015	10,50%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-116	RUB	12,89%	14.05.2015	13,50%
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 4	RUB	8,64%	09.06.2015	14,00%
Магнит обл. БО-07	RUB	8,49%	21.09.2015	14,29%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	RUB	8,41%	13.10.2015	13,77%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	8,38%	25.02.2016	12,97%
Банк Зенит обл. 11	RUB	6,35%	16.10.2018	15,52%
Росбанк обл. БО-6	RUB	4,23%	30.01.2016	14,12%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	4,18%	09.02.2017	14,26%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	RUB	4,05%	13.10.2015	12,99%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,43%	24.04.2018	14,32%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%