

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.05.2015 по 29.05.2015

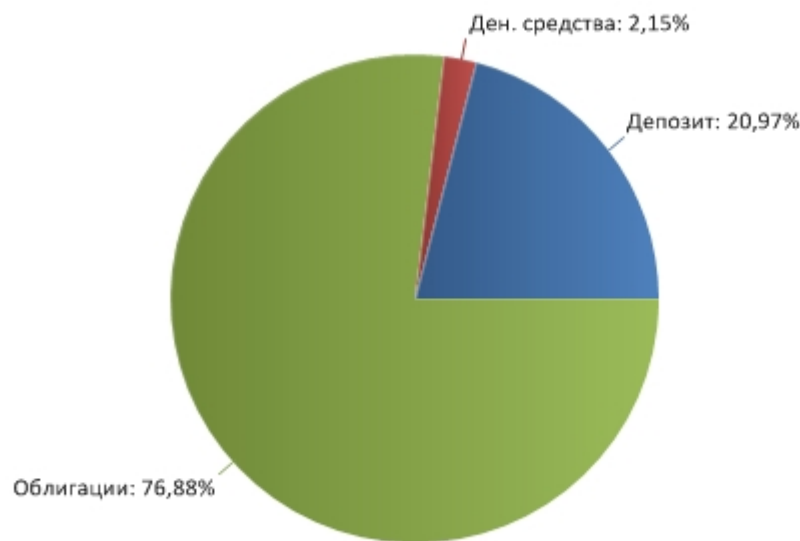
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 248		601	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	11,8%	3,9%	23,9%	8,0%
с начала текущего года	4,9%	12,0%	11,3%	27,7%
за 1 год	4,8%	4,8%	9,1%	9,1%
за 6 месяцев	3,9%	7,8%	7,0%	14,0%
за 3 месяца	3,0%	12,0%	4,3%	17,2%
за месяц	0,8%	9,6%	0,3%	3,6%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,5		1,4	
Волатильность	2,7%		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	564 976
Депозит	525 753
Облигации	2 121 419
Итого	3 212 148
Фин. рез. с начала года	13 777 883

Тор 10 прибыльных позиций	Прибыль	Тор 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25079	590 175		
Магнит обл. БО-07	343 400		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	319 736		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-116	303 288		
Банк Зенит обл. 11	283 950		
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 4	222 466		
Росбанк обл. БО-6	150 900		
Норильский никель обл. БО-02	125 400		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	123 667		
Русфинанс Банк обл. БО-07	108 392		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25079	RUB	32,86%	03.06.2015	12,83%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-116	RUB	12,78%	14.05.2015	12,00%
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 4	RUB	8,65%	09.06.2015	14,00%
Магнит обл. БО-07	RUB	8,55%	21.09.2015	11,93%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	RUB	8,46%	13.10.2015	12,00%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	8,35%	25.02.2016	13,48%
Банк Зенит обл. 11	RUB	6,41%	16.10.2018	13,35%
Росбанк обл. БО-6	RUB	4,25%	30.01.2016	13,30%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	4,17%	09.02.2017	14,74%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	RUB	4,06%	13.10.2015	12,00%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,46%	24.04.2018	13,33%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%