

Ежемесячный бюллетень
Период: Январь 2015

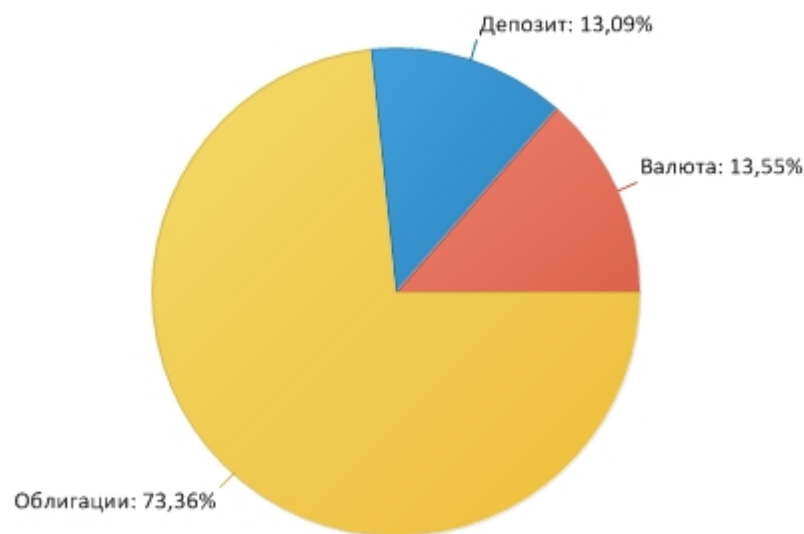
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 20.09.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	12 741		590	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	5,8%	1,9%	13,0%	4,3%
с начала текущего года	0,9%	10,6%	3,6%	42,4%
за 1 год	-0,9%	-0,9%	1,0%	1,0%
за 6 месяцев	0,7%	1,4%	1,6%	3,2%
за 3 месяца	0,2%	0,8%	0,7%	2,8%
за месяц	0,9%	10,8%	3,6%	43,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,7		0,8	
Волатильность	3,0%		5,7%	
Максимальное снижение	-4,4%		-6,5%	

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


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,12	Коэффициент Бета	0,11
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Акции	51 000
Облигации	841 229
Депозит	929 819
Прочие доходы и расходы	-46 003
Итого	1 776 044

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-14-324	287 671	Россельхозбанк обл. 03	-458 800
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 1	279 452		
Магнит обл. БО-07	241 200		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-005	236 712		
ЮниКредит Банк обл. БО-08	218 345		
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	169 908		
Банк Зенит обл. 11	149 700		
Норильский никель обл. БО-02	134 200		
Депозит в Сбербанк России ОАО 017640216	125 984		
Русфинанс Банк обл. БО-07	125 974		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-005	15,15%	15.02.2015	18,00%
ЮниКредит Банк обл. БО-08	10,30%	23.02.2016	19,04%
Магнит обл. БО-07	10,13%	21.09.2015	12,67%
ОФЗ обл. 25079	9,90%	03.06.2015	14,60%
Норильский никель обл. БО-02	9,60%	25.02.2016	16,44%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	9,56%	13.10.2015	20,34%
ЕвразХолдинг Финанс обл.01	8,40%	13.03.2020	9,28%
Банк Зенит обл. 11	7,75%	16.10.2018	12,17%
Русфинанс Банк обл. БО-07	5,10%	24.04.2018	10,39%
Росбанк обл. БО-6	4,86%	30.01.2016	12,47%
Россельхозбанк обл. 03	4,63%	09.02.2017	10,98%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	4,61%	13.10.2015	19,68%

Структура портфеля акций

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