

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.01.2016 по 31.01.2016

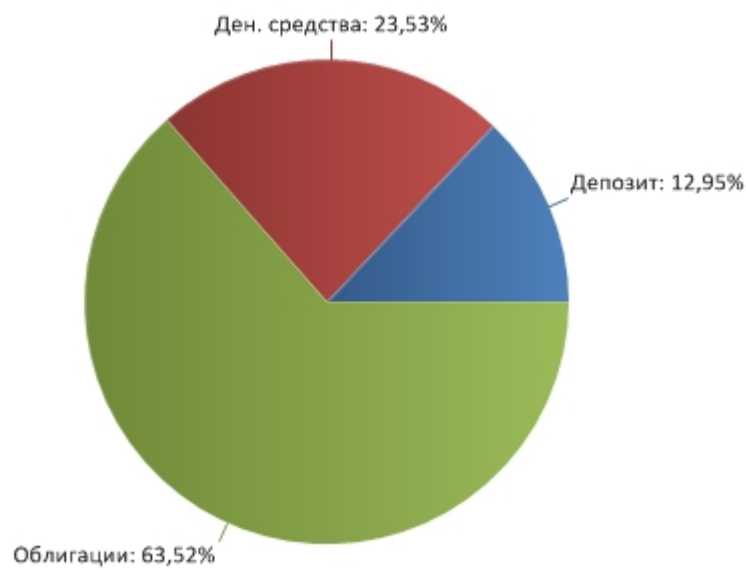
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 932		625	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	10,5%	3,5%	20,6%	6,9%
с начала текущего года	1,0%	11,8%	-1,5%	-17,7%
за 1 год	9,4%	9,4%	14,8%	14,8%
за 6 месяцев	3,6%	7,2%	4,2%	8,4%
за 3 месяца	2,0%	8,0%	0,7%	2,8%
за месяц	1,0%	12,0%	-1,5%	-18,0%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	0,9		0,7	
Волатильность	3,7%		10,3%	
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	0,29	Коэффициент Бета	-0,01
-------------------	------	------------------	-------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	-2 471
Депозит	223 234
Облигации	1 283 163
Итого	1 503 926
Фин. рез. с начала года	1 503 926

Тор 10 прибыльных позиций	Прибыль	Тор 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25077	418 050		
Россельхозбанк обл. 03	238 444		
Банк ЗЕНИТ обл. 11	227 250		
Норильский никель обл. БО-02	221 800		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	162 186		
Росбанк обл. БО-6	147 000		
Депозит в Альфа-Банк 1007370	31 212		
Депозит в Альфа-Банк 1007572	29 836		
ЮниКредит Банк обл. БО-07	14 286		
Газпром капитал обл. 06	9 523		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
Норильский никель обл. БО-02	RUB	15,83%	25.02.2016	10,37%
ЮниКредит Банк обл. БО-07	RUB	13,75%	11.02.2016	12,54%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,68%	16.10.2018	12,90%
Газпром капитал обл. 06	RUB	13,65%	18.02.2016	17,21%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	12,38%	09.02.2017	-7,75%
Росбанк обл. БО-6	RUB	11,04%	30.01.2016	0,00%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	RUB	10,82%	12.11.2015	10,60%
Депозит в Альфа-Банк 1007572	RUB	4,25%	16.02.2016	10,50%
Росбанк обл. БО-07	RUB	2,73%	01.03.2016	10,62%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,86%	24.04.2018	12,33%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%