

Ежемесячный бюллетень
Период: с 01.11.2015 по 30.11.2015

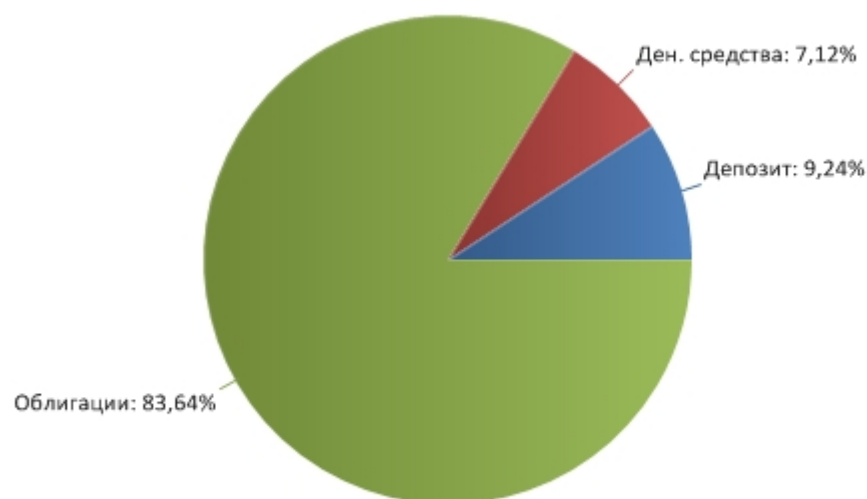
Фонд: Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"

Правила ДУ: 0982-94130523 от 31.10.2007

Динамика стоимости пая за период

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 722		654	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12,9%	4,3%	26,6%	8,9%
с начала текущего года	8,7%	9,5%	19,4%	21,2%
за 1 год	7,6%	7,6%	14,7%	14,7%
за 6 месяцев	3,6%	7,2%	7,2%	14,4%
за 3 месяца	1,6%	6,4%	3,5%	14,0%
за месяц	0,5%	6,0%	1,6%	19,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,1		0,9	
Волатильность	4,0%		10,0%	
Максимальное снижение	-4,1%		-6,5%	

* Бенчмарк = 25% Индекс ММВБ + 75% Индекс ММВБ корп. облигаций


Структура портфеля по типам инструментов

Структура прибыли и убытков за период

Коэффициент Альфа	0,29	Коэффициент Бета	0,06
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	544 263
Депозит	174 247
Облигации	157 021
Итого	875 531
Фин. рез. с начала года	25 367 714

Топ 10 прибыльных позиций	Прибыль	Топ 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25077	727 110	Банк ЗЕНИТ обл. 11	-1 108 750
Норильский никель обл. БО-02	204 750		
Росбанк обл. БО-6	175 883		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	174 247		
Россельхозбанк обл. 03	120 000		
Русфинанс Банк обл. БО-07	38 029		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25077	RUB	45,53%	20.01.2016	10,57%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	12,58%	16.10.2018	12,51%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	12,53%	25.02.2016	11,59%
Росбанк обл. БО-6	RUB	10,14%	30.01.2016	11,94%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	RUB	9,95%	12.11.2015	10,60%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	7,55%	09.02.2017	12,54%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,72%	24.04.2018	11,81%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%