

**Ежемесячный бюллетень**

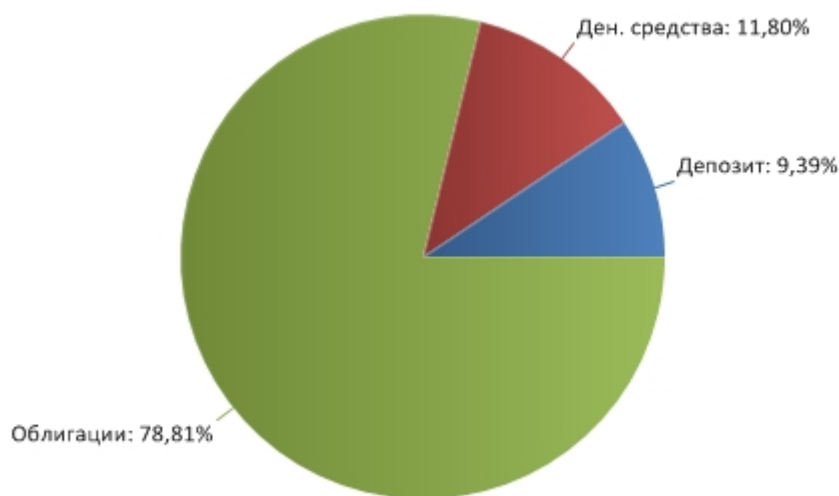
**Период:** с 01.10.2015 по 31.10.2015  
**Фонд:** Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Либра - Пенсионный Капитал"  
**Правила ДУ:** 0982-94130523 от 31.10.2007

**Динамика стоимости пая за период**

	Расчетная стоимость пая		Бенчмарк *	
Текущее значение	13 655		637	
<b>Доходность</b>				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12,6%	4,2%	24,8%	8,3%
с начала текущего года	8,1%	9,7%	17,5%	21,0%
за 1 год	7,4%	7,4%	13,4%	13,4%
за 6 месяцев	3,9%	7,8%	5,8%	11,6%
за 3 месяца	1,5%	6,0%	2,9%	11,6%
за месяц	0,4%	4,8%	2,5%	30,0%
<b>Показатели качества управления</b>				
Коэффициент Шарпа	1,1		0,8	
Волатильность	4,0%		10,0%	
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	0,07
<b>Тип инструмента</b>		<b>Финансовый результат</b>	
Прочие доходы и расходы		524 503	
Депозит		180 055	
Облигации		2 853 437	
<b>Итого</b>		<b>3 557 994</b>	
<b>Фин. рез. с начала года</b>		<b>25 041 086</b>	

Тор 10 прибыльных позиций	Прибыль	Тор 10 убыточных позиций	Убыток
Банк ЗЕНИТ обл. 11	1 669 543		
ОФЗ обл. 25077	599 368		
Норильский никель обл. БО-02	198 450		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	180 055		
Россельхозбанк обл. 03	132 995		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	91 182		
Росбанк обл. БО-6	81 700		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	40 870		
Русфинанс Банк обл. БО-07	39 327		

**Структура портфеля облигаций и депозитов**

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25077	RUB	47,52%	20.01.2016	10,41%
Банк ЗЕНИТ обл. 11	RUB	13,81%	16.10.2018	5,64%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	13,07%	25.02.2016	11,28%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	RUB	10,65%	12.11.2015	10,60%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	7,87%	09.02.2017	11,82%
Росбанк обл. БО-6	RUB	5,29%	30.01.2016	11,98%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,79%	24.04.2018	11,95%

**Структура портфеля акций**

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

**Валютная структура портфеля**

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%