

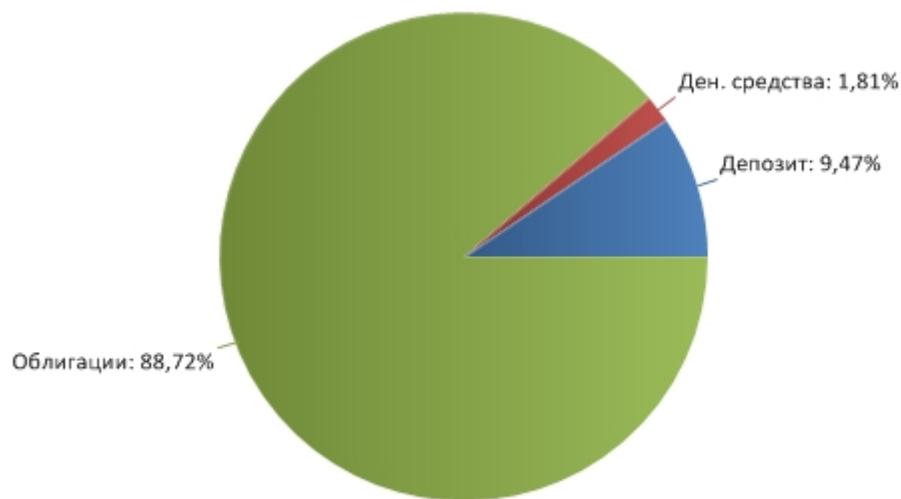
Ежемесячный бюллетень

Период: с 01.06.2015 по 30.06.2015
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	13 349		614	
Доходность				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12,1%	4,0%	24,2%	8,1%
с начала текущего года	5,7%	11,5%	13,1%	26,4%
за 1 год	5,3%	5,3%	8,9%	8,9%
за 6 месяцев	5,7%	11,4%	13,1%	26,2%
за 3 месяца	3,0%	12,0%	5,9%	23,6%
за месяц	0,8%	9,6%	1,6%	19,2%
Показатели качества управления				
Коэффициент Шарпа	1,5		1,4	
Волатильность	2,6%		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	0,27	Коэффициент Бета	0,08
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	574 588
Депозит	237 260
Облигации	2 037 990
Итого	2 849 838
Фин. рез. с начала года	16 166 693

Тор 10 прибыльных позиций	Прибыль	Тор 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25077	568 448		
Норильский никель обл. БО-02	249 800		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	220 356		
Банк Зенит обл. 11	189 750		
Магнит обл. БО-07	186 400		
Россельхозбанк обл. 03	184 900		
Росбанк обл. БО-6	176 400		
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 5	128 767		
ОФЗ обл. 25079	98 850		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	98 051		

Структура портфеля облигаций и депозитов

Ценная бумага/Депозит	Валюта	Доля в портфеле облигаций	Дата погашения	Доходность к погашению, %
ОФЗ обл. 25077	RUB	38,04%	20.01.2016	10,24%
Магнит обл. БО-07	RUB	9,75%	21.09.2015	12,03%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	RUB	9,67%	13.10.2015	11,41%
Депозит в МФ ОАО "Липецккомбанк" 5	RUB	9,64%	10.08.2015	11,75%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	9,55%	25.02.2016	13,13%
Банк Зенит обл. 11	RUB	7,33%	16.10.2018	12,57%
Росбанк обл. БО-6	RUB	4,89%	30.01.2016	11,91%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	4,80%	09.02.2017	13,40%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	RUB	4,64%	13.10.2015	11,72%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,68%	24.04.2018	12,29%

Структура портфеля акций

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

Валютная структура портфеля

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%