

**Ежемесячный бюллетень**
**Период:** с 01.09.2015 по 30.09.2015

**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	13 594		616	
<b>Доходность</b>				
	в %	в % годовых	в %	в % годовых
за 3 года	12,0%	4,0%	22,0%	7,3%
с начала текущего года	7,7%	10,3%	14,7%	19,7%
за 1 год	7,1%	7,1%	11,7%	11,7%
за 6 месяцев	4,9%	9,8%	6,8%	13,6%
за 3 месяца	1,8%	7,2%	1,6%	6,4%
за месяц	0,6%	7,2%	0,1%	1,2%
<b>Показатели качества управления</b>				
Коэффициент Шарпа	1,0		0,7	
Волатильность	4,1%		9,9%	
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
-------------------	------	------------------	------

Тип инструмента	Финансовый результат
Прочие доходы и расходы	521 560
Депозит	174 247
Облигации	1 835 340
<b>Итого</b>	<b>2 531 146</b>
<b>Фин. рез. с начала года</b>	<b>22 011 993</b>

Тор 10 прибыльных позиций	Прибыль	Тор 10 убыточных позиций	Убыток
ОФЗ обл. 25077	678 400		
ВымпелКом-Инвест обл. 06	232 354		
Норильский никель обл. БО-02	207 800		
Банк Зенит обл. 11	198 900		
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	174 247		
Магнит обл. БО-07	142 400		
Росбанк обл. БО-6	126 300		
ВымпелКом-Инвест обл. 07	119 157		
Россельхозбанк обл. 03	92 000		
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	42,21%	20.01.2016	9,95%
ВымпелКом-Инвест обл. 06	RUB	10,86%	13.10.2015	13,13%
Депозит в Банк ВТБ Д810-22-15-212	RUB	10,63%	12.11.2015	10,60%
Норильский никель обл. БО-02	RUB	10,42%	25.02.2016	11,54%
Банк Зенит обл. 11	RUB	8,27%	16.10.2018	11,77%
Росбанк обл. БО-6	RUB	5,28%	30.01.2016	11,46%
Россельхозбанк обл. 03	RUB	5,22%	09.02.2017	12,74%
ВымпелКом-Инвест обл. 07	RUB	5,21%	13.10.2015	12,18%
Русфинанс Банк обл. БО-07	RUB	1,90%	24.04.2018	12,06%

**Структура портфеля акций**

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

**Валютная структура портфеля**

Валюта	Доля СЧА
RUB	100,00%