IM Variable Euro

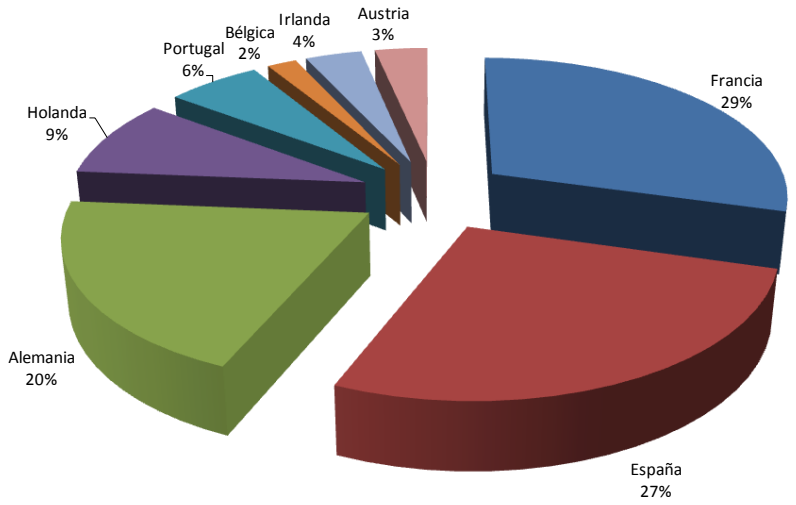
Informe situación

30 de Noviembre 2016

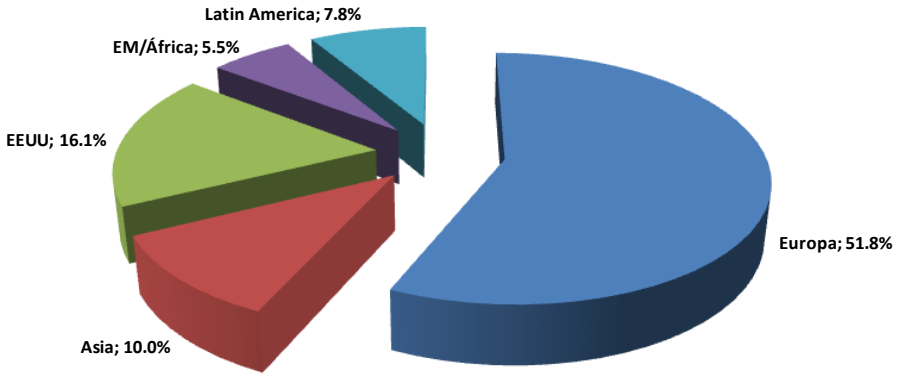
intermoney gestión sgiic

1. IM Variable Euro: Cartera Renta Variable

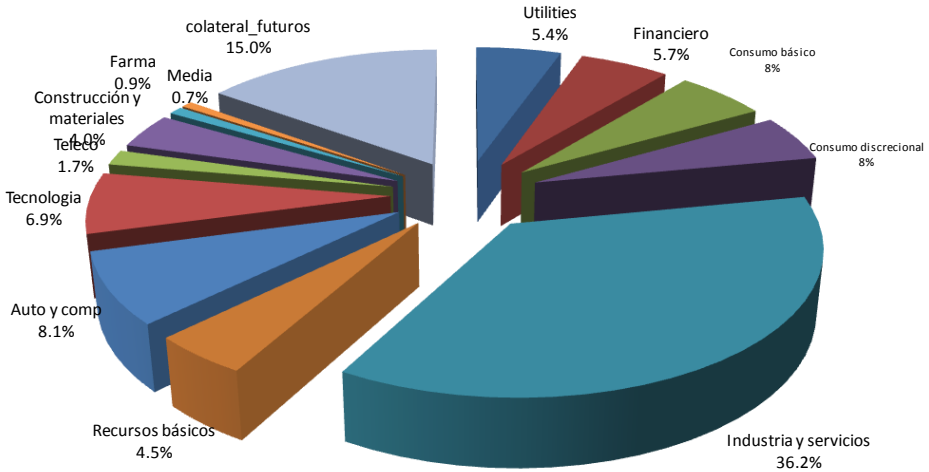
¿Dónde cotizan las compañías?



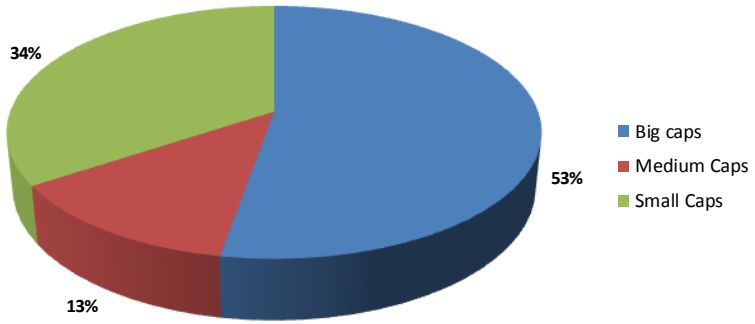
¿Dónde venden las compañías?



Distribución sectorial



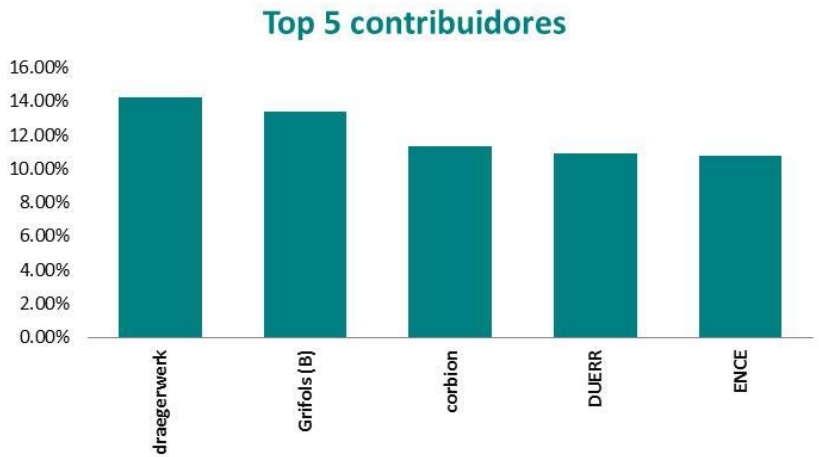
Distribución Cartera por Capitalización

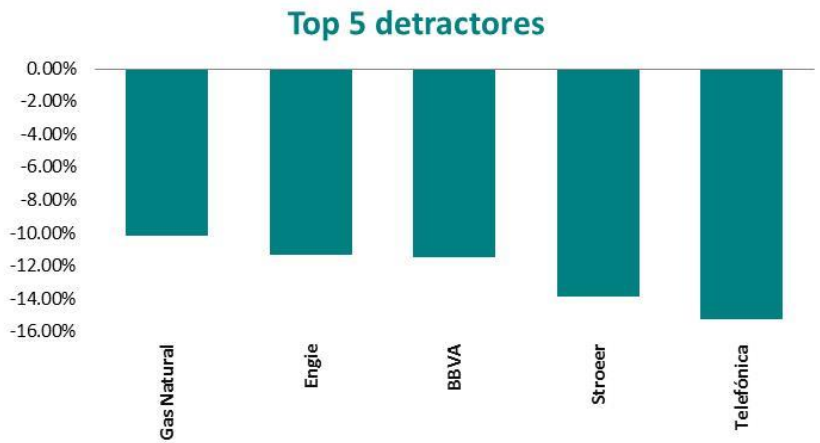


intermoney gestión sgiic

2. Cartera Renta Variable: Comportamiento mensual

AÑO	IM Variable Euro	Eurostoxx 50 (Ex div)	Ibex 35 (Ex div)	Eurostoxx 50 (Div Neto)	Ibex 35 (Div Neto)
2013	21.47%	17.95%	21.42%	22.50%	26.28%
2014	1.57%	1.20%	3.66%	4.71%	7.48%
2015	13.52%	3.85%	-7.15%	7.20%	-4.39%
2016 (YTD noviembre)	2.38%	-6.61%	-8.97%	-3.00%	-5.79%
Acumulada	38.93%	16.39%	8.95%	31.41%	23.58%
Media	11.12%	4.68%	2.56%	8.97%	6.74%

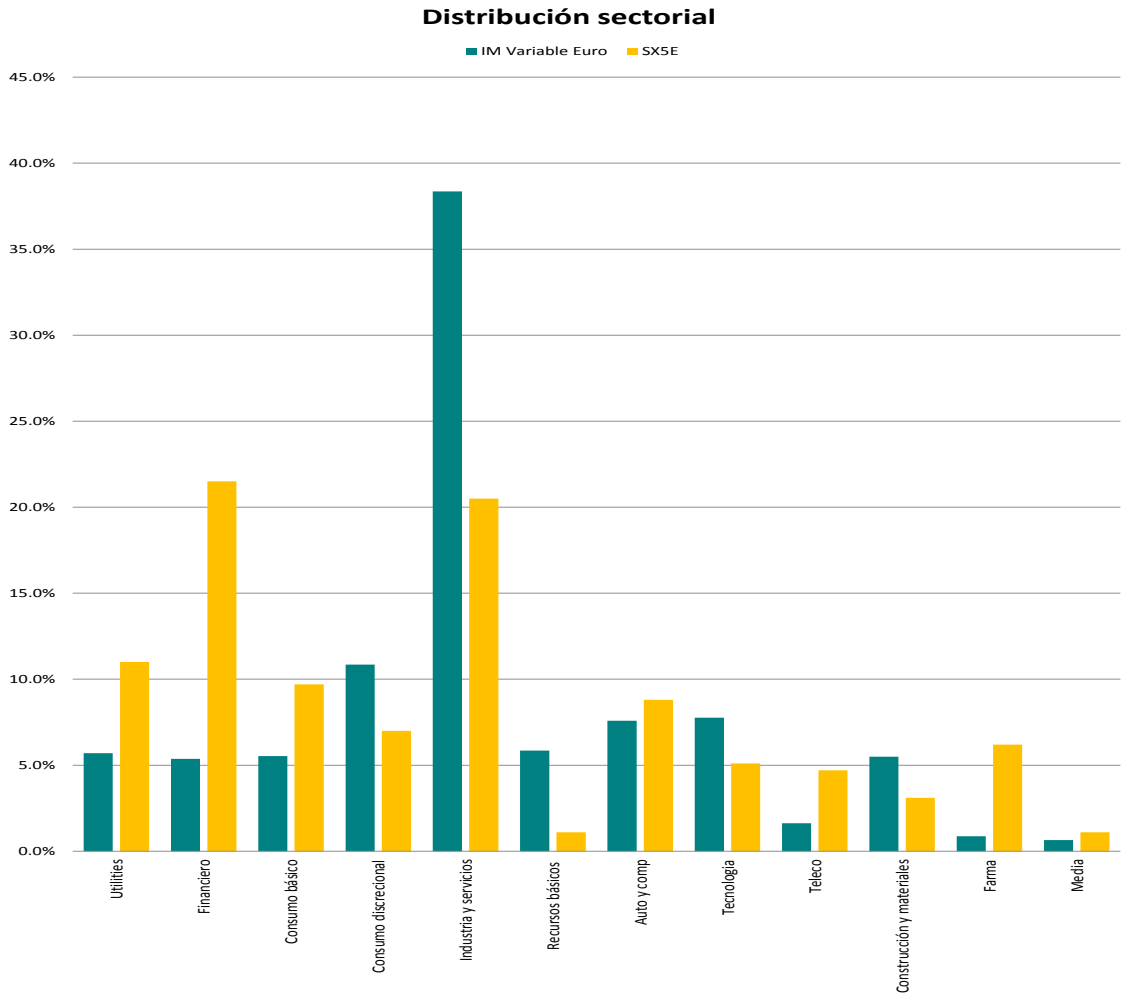




intermoney gestión sgiic

3. IM Variable Euro

	IM Variable Euro	Eurostoxx 50	Ibex 35
Volatilidad	18.38%	20.72%	21.94%
Ratio de Sharpe	2.1	0.8	0.4
Beta	0.90		



intermoney gestión sgiic

4. IM Variable Euro: Ficha

MORNINGSTAR®
★★★★
Overall Morningstar Rating™

Informe semanal 30 de noviembre de 2016

Intermoney Variable Euro

DETALLES DEL FONDO

Sociedad gestora	Intermoney Gestión SGIIC, S.A
Sociedad depositaria	RBC (grupo Banca March)
Forma jurídica	Fondo de inversión, UCITS IV
Lugar de registro	España
Fecha constitución	31/05/2001
Cálculo del valor liquidativo	Diario
Comisión de gestión	1.50%
Núm Registro CNMV	69
Código ISIN	ES0155142039
Código Bloomberg	INTVAEU SM
Asset Class	Renta Variable Euro
Índice de referencia	100% Euro Stoxx 5^
Dividendos	No reparte
Patrimonio	20,243,877.24 €
Valor liquidativo	137.888

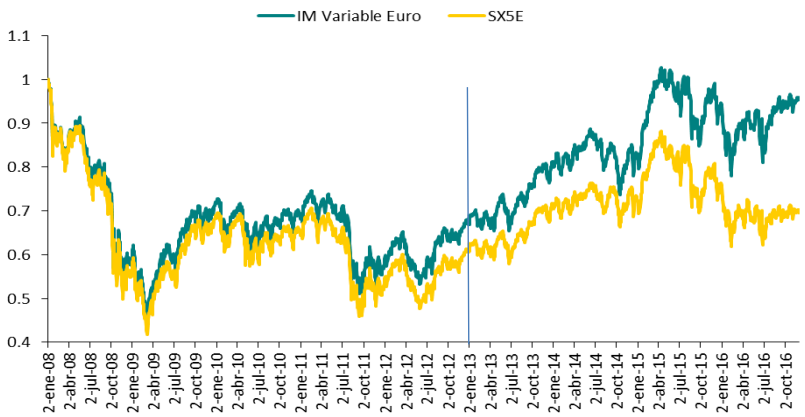
Evolución Rentabilidad-Riesgo

	Rentabilidad			Volatilidad	
	Fondo	índice	Diferencial	Fondo	índice
a 3 meses	2.13%	0.69%	1.44%	11.32%	14.30%
a 6 meses	3.05%	-1.24%	4.29%	19.31%	21.62%
a 12 meses	-3.24%	-12.97%	9.73%	20.29%	22.55%
YTD	2.38%	-6.61%	8.98%	20.80%	23.02%
a 2 años	13.83%	-6.13%	19.96%	20.16%	22.83%
a 3 años	18.89%	-1.01%	19.90%	17.97%	20.14%
a 5 años	64.24%	30.95%	33.29%	18.12%	20.01%

Máximas posiciones Fondo

Nº	compañía	Peso
1	Michelin	2.34%
2	Sonae	1.98%
3	SAP	1.90%
4	AXA	1.79%
5	Vinci	1.79%
6	Navigator	1.77%
7	Gas Natural	1.73%
8	Chargeurs	1.73%
9	DUERR	1.72%
10	Deutsche post	1.68%

Evolución Fondo vs. Benchmark (Largo plazo)



* 31 de diciembre del año 2012 entrada del nuevo gestor

Información técnica

Ratio de Sharpe	1.8
Ratio de Treynor	0.3
Alpha Jensen	0.3
Tracking Error	5.7%
Ratio de Información	3.5
Beta	0.90

Datos 3 años

intermoney gestión sgiic