Janus Henderson Capital

Con fines meramente promocionales

INTECH GLOBAL INCOME MANAGED VOLATILITY FUND

I USD Acc - Todos los datos a 31 octubre 2018

Janus Henderson INVESTORS

Alternativas al índice que buscan alta rentabilidad

Janus Henderson cree que puede aportar valor mediante el uso de la volatilidad natural del precio de las acciones mediante un proceso de gestión del riesgo con base matemática. La empresa no elige acciones individuales o pronósticos de alta rentabilidad, sino que utiliza la volatilidad natural del precio de las acciones y las características de correlación para generar una mayor rentabilidad. En esencia, Janus Henderson ajusta los pesos de los valores de la cartera de un índice para hallar combinaciones potencialmente más eficientes.

Rentabilidad Anualizada

	1 A	3 A	5 A	10 A	Desde el inicio I$acc
I$acc clase	0,49	4,57	2,47	-	3,85
Índice	-0,35	6,60	4,79	-	6,07

Rentabilidad acumulada (%)

	1 M	3 M	YTD	1 A	3 A	5 A	10 A	Desde el inicio I$acc
I$acc clase	-2,45	-1,98	-1,91	0,49	14,35	12,99	-	23,50
Índice	-4,58	-3,58	-3,38	-0,35	21,13	26,38	-	39,03

Rentabilidad acumulada de cinco años (%)

El rendimiento pasado no garantiza resultados futuros. Fuente: Morningstar.

Copyright © 2018 Morningstar UK Limited. Todos los derechos reservados. La información que se incluye en el presente documento: (1) es propiedad de Morningstar y/o de sus proveedores de contenidos; (2) no se puede copiar ni distribuir; y (3) no incluye garantías en relación con su precisión, exhaustividad ni oportunidad. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenidos son responsables de los daños y perjuicios provocados por cualquier uso de esta información. No se muestra la calificación de Morningstar si el fondo tiene menos de tres años de antiguedad o está por debajo de las 3 estrellas.

Puntos clave

- Su objetivo es superar al índice MSCI World High Dividend Yield Index, a la vez que reduce el riesgo de un bajo rendimiento significativo
- Fuente potencial de alta rentabilidad con un riesgo similar al del índice de referencia
- Inversión no-emocional: las carteras se re-equilibran como parte del proceso matemático de inversión

Riesgos Principales

- Riesgo de inversión
- Riesgo de utilización de un modelo de negociación propio
- Concentración de las inversiones

Datos sobre el Fondo◊

Gestor de cartera	Adrian Banner, Ph.D.; Vassilios Papathanakos, Ph.D.; Philip Whitman, Ph.D.; Joseph Runnels, CFA
Mandato en el fondo	28 Mar 2013
Divisa de referencia	USD
Sede	Irlanda
Índice de referencia	MSCI World High Dividend Yield NR
Categoria	EAA OE Global Equity Income
Total de activos netos	
(Mills. de USD)	$2,2
(Mills. de EUR)	€2,0
Negociación	Una vez al día

	I$acc
Lanzamiento	28 Mar 2013
Valor liquidativo	$12,35
ISIN	IE00B7GPMH84
SEDOL	B7GPMH8
Bloomberg	JAIIUAC

Características de riesgo en comparación con el índice†

	I$acc	Índice
Alfa	-0,58	-
Beta	0,75	-
R2	71,13	-
Desviación estándar	7,32	8,19
Error de seguimiento	4,44	-
Coeficiente Sharpe	0,51	0,70
Coeficiente de información	-0,46	-

Características del fondo‡

Número total de participaciones	92
Tasa de rotación de la cartera	77.7%
Capitalización de mercado media ponderada (Miles de mills. de USD)	$44,8
(Miles de mills. de EUR)	€39,6
Capitalización de mercado media (Miles de mills. de USD)	$16,7
(Miles de mills. de EUR)	€14,7
Active share	50,00

◊La renta a distribuir refleja los importes que se espera repartir durante lospróximos doce meses como porcentaje del valor liquidativo en la fechaindicada. La renta subyacente refleja los ingresos del fondo en términosanuales, como porcentaje del valor liquidativo en la fecha indicada. Ambasmedidas se basan en una instantánea de la cartera en dicho día, son netos conrespecto a gastos y brutos con respecto a impuestos.

†Fuente: Morningstar. Tres años de seguimiento utilizando la Citigroup 3 month Tbill como tasa libre de riesgo.

‡Fuente: Janus Henderson Investors.

Las diez principales participaciones (%)

CLP Holdings Ltd	
CME Group Inc	
Consolidated Edison Inc	
Daito Trust Construction Co Ltd	
Darden Restaurants Inc	
Kimberly-Clark Corp	
Lockheed Martin Corp	
McDonald's Corp	
Power Assets Holdings Ltd	
Valero Energy Corp	
Total	37,3

Desglose por sector (%)

Servicios públicos	30,42
Bienes de consumo discrecional	17,33
Communication Services	10,12
Industria	9,94
Bienes de consumo básico	9,65
Finanzas	8,15
Real Estate	6,39
Energía	3,27
Asistencia sanitaria	2,74
Tecnología de la información	0,91
Efectivo/equivalentes similares al efectivo	1,08

Principales participaciones países (%)

Estados Unidos	56,69
Japón	16,32
Hong Kong	16,16
Canadá	4,37
Australia	1,95
Singapur	1,44
Nueva Zelanda	0,77
Reino Unido	0,50
Suiza	0,20
Alemania	0,20

Capitalización de mercado (% de valores)

Over $100B	10,79
$25B to $100B	38,46
$15B to $25B	14,70
$2B to $15B	34,97

Asignación de activos (%)

Las acciones ordinarias EE.UU.	56,68
Non-US acciones ordinarias	42,24
Efectivo/equivalentes similares al efectivo	1,08

Fuente: Janus Henderson Investors

Información importante. ESTE DOCUMENTO ESTA DESTINADO EXCLUSIVAMENTE A PROFESSIONALES.

Todo el contenido de este documento es solo para información o uso general y no es específico a los requisitos particulares de ningún cliente. Publicado en: (a) Europa por Janus Capital International Limited ("JCIL"); autorizado y regulado en el Reino Unido por la Financial Conduct Authority y en (b) Dubái por JCIL; autorizado y regulado por la Dubai Financial Services Authority como Oficina Representante. Janus Henderson Capital Funds Plc es una UCITS establecida según la legislación irlandesa, con responsabilidad segregada entre sus fondos. Las acciones de los Fondos de JHCF (los "Fondos") no se pueden ofrecer ni vender directa o indirectamente a Personas de los EE. UU. Y no pueden ser ofrecidas ni vendidas en ninguna jurisdicción en la cual esté prohibido tal ofrecimiento o venta. Para una definición de Persona de los EE. UU. consulte el actual prospecto del Fondo, cuya copia puede encontrarse en https://en-us.janushenderson.com/offshore, junto con el Documento de Información Clave del Inversor (KIID, por sus siglas en inglés). Los Fondos están autorizados para la venta pública en ciertas jurisdicciones y las exenciones de colocación privadas pueden estar disponibles en otras. Una lista de aquellos países en los cuales las acciones de JHCF estén registradas para distribución pública está disponible en https://en-us.janushenderson.com/offshore. Póngase en contacto con su representante de Janus si no está seguro de la disponibilidad de los Fondos en la jurisdicción de su cliente. Es responsabilidad de cualquier persona que desee distribuir y/o comprar acciones de los Fondos cumplir con todas las leyes y reglamentaciones vigentes en la jurisdicción en la cual se distribuyen o venden las acciones de los Fondos o cualquier literatura al respecto. Este documento no constituye un asesoramiento legal, tributario o inversionista, ni tampoco es un ofrecimiento o solicitud de compra de acciones de los Fondos, y puede no cumplir con todas las leyes aplicables a los materiales de marketing. Una inversión en un Fondo conlleva riesgos, los cuales se describen en el prospecto del Fondo y el KIID. Los asesores financieros son responsables por la determinación de la idoneidad y la clase de acción de una inversión en los Fondos por parte de sus clientes. El valor de las acciones de un Fondo y los ingresos recibidos de este pueden subir o bajar, y los inversores pueden no recuperar el monto total de lo invertido. Un rendimiento anterior no es un indicador o garantía de rendimiento a futuro. Esta comunicación solo debe ser leída por inversores institucionales, asesores financieros profesionales y, a su exclusiva discreción, por los clientes elegibles. No debe ser distribuido a las Personas de los EE. UU. excepto los destinatarios anteriormente mencionados. Una inversión en los Fondos no está asegurado por la FDIC, puede perder valor y no está garantizada por bancos. Janus Capital Management LLC, Janus Capital Singapore Limited, Intech Investment Management LLC y Perkins Investment Management LLC actuarán como subasesores para Janus Capital International Limited © 2018, Janus Henderson Investors. El nombre Janus Henderson Investors incluye a HGI Group Limited, Henderson Global Investors (gestión de marca) Sarl y Janus International Holding LLC.

Saber más

☎ +34 91 562 6245

✉ info.spain@janushenderson.com

🖳 www.janushenderson.com

O poniéndose en contacto con su representante de Janus Henderson Investors habitual. PUBLICIDAD.