

Franklin K2 Ellington Mortgage Income UCITS Fund EO PF (acc) EUR-H1

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

HFRX RV Fixed Income AssetBacked(FF)
USD

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Fund's investment objective is to achieve total return over a full market cycle through a combination of current income, capital preservation and capital appreciation.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	1,51
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,40
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

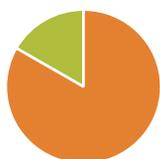
Termine	Fondo
3-Mesi	2,33
6-Mesi	4,12
1-Anno	8,69
3-Anni Ann.ti	5,63
5-Anni Ann.ti	3,16
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Trimestrale %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	3,06	1,71	2,12	1,91
2023	2,24	2,79	2,04	2,47
2022	0,00	-1,29	-1,71	0,51
2021	1,87	0,10	1,83	0,40

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	83,33
● Liquidità	16,67
● Altro	0,00

Fixed Income

Style Box™

Qualità Credito	Sensibilità ai Tassi		
	Bassa	Med	Alta
Alto			
Med			
Basso			

Qualità Credito	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-

Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond
0		0

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Mortgage...	-	4,23
Freddie Mac Stacr Remic Trust	-	3,96
Accunia European Clo I Dac...	-	3,57
Federal Home Loan Mortgage...	-	3,17
Freddie Mac Stacr Remic Trust	-	3,15
Lifetime Mortgage Funding 1...	-	3,07
Freddie Mac Stacr Trust...	-	2,75
TRICON RESIDENTIAL 2021-SFR1	-	2,72
CONNECTICUT AVENUE...	-	2,62
GOLUB CAPITAL PARTNERS 21...	-	2,50
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		31,74
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		58

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
🏛️ Governativo	0,43
⚙️ Societario	0,96
🏠 Cartolarizzazioni	80,36
🏢 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	18,25
📄 Derivati	0,00

Coupon Range %

Categoria	Fondo
0 coupon	5,21
Da 0 a 4 cedole	14,08
Da 4 a 6 cedole	6,91
Da 6 a 8 cedole	7,97
Da 8 a 10 cedole	8,29
Da 10 a 12 cedole	28,06
Oltre 12 cedole	29,49

Scadenze %

Scadenza	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,16
da 5 a 7	6,04
da 7 a 10	21,06
da 10 a 15	25,14
da 15 a 20	17,87
da 20 a 30	29,73
oltre 30	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Franklin Templeton International Services S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	20,23 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Telefono	+352 46 66 67 212	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
Web	www.franklintempleton.lu	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,95%
Data di Partenza	30/09/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,95%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2019	ISIN	LU2039786269		
NAV (04/02/2025)	EUR 11,88				
Patrimonio Netto (Mln)	88,15 USD				

(31/12/2024)