

Franklin K2 Ellington Mortgage Income UCITS Fund EO PF (acc) USD

Categoria Morningstar™

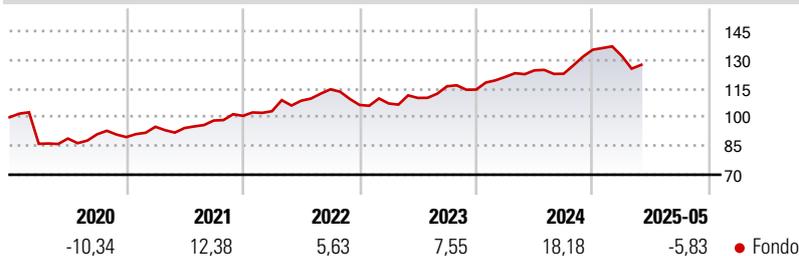
Obbligazionari Altro

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	0,47
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,95
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	-4,59
6-Mesi	-4,12
1-Anno	3,21
3-Anni Ann.ti	5,96
5-Anni Ann.ti	8,03
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 05/06/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-2,47	-	-	-
2024	5,78	2,82	-1,42	10,22
2023	0,72	2,71	5,52	-1,48
2022	2,41	5,30	5,47	-7,12
2021	6,00	-0,70	4,15	2,51

Portafoglio 30/04/2025


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	95,51
● Liquidità	4,49
● Altro	0,00

Fixed Income
Style Box™

Qualità Credito	Sensibilità ai Tassi		
	Bassa	Med	Alta
Alto			
Med			
Basso			

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond
0		0

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Mortgage...	—	5,69
Accunia European Clo I Dac...	—	5,21
CONNECTICUT AVENUE...	—	4,31
Federal Home Loan Mortgage...	—	4,19
TRICON RESIDENTIAL 2021-SFR1	—	3,78
Freddie Mac Stacr Trust...	—	3,70
Lifetime Mortgage Funding 1...	—	3,57
Ares Euro CLO I B.V.	—	3,51
Eurohome UK Mortgages 2007-1...	—	3,17
BLACKROCK MT HOOD CLO X LLC	—	3,12
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		40,26
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		51

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
🏛️ Governativo	0,31
🏢 Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	94,75
🏘️ Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	5,86
📄 Derivati	-0,92

Coupon Range %

Intervallo	Fondo
0 coupon	4,51
Da 0 a 4 cedole	15,18
Da 4 a 6 cedole	13,70
Da 6 a 8 cedole	4,70
Da 8 a 10 cedole	20,30
Da 10 a 12 cedole	13,72
Oltre 12 cedole	27,88

Scadenze %

Intervallo	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,17
da 5 a 7	14,39
da 7 a 10	13,67
da 10 a 15	21,14
da 15 a 20	17,62
da 20 a 30	31,51
oltre 30	1,50

Anagrafica

Società di Gestione	Franklin Templeton International Services S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	6,13 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000.000 USD
Telefono	+352 46 66 67 212	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Web	www.franklintempleton.lu	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	30/09/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,95%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	30/09/2019	ISIN	LU2039786343		
NAV (05/06/2025)	USD 13,07				
Patrimonio Netto (Mln)	64,41 USD				

(30/04/2025)