

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

Categoria Morningstar™

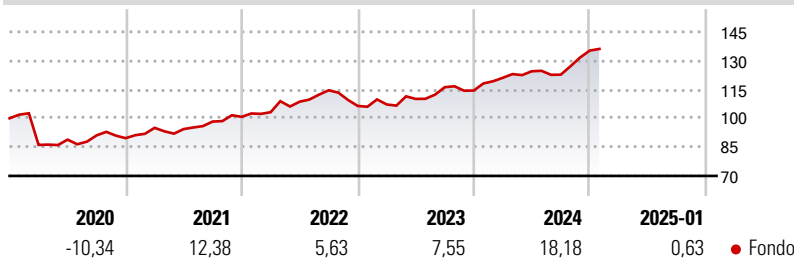
Obbligazionari Altro

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	0,98
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,57
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

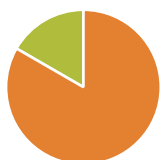
Rend. Cumulati %

Termine	Fondo
3-Mesi	7,69
6-Mesi	10,31
1-Anno	14,84
3-Anni Ann.ti	10,75
5-Anni Ann.ti	5,76
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
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 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
Alto	Basso	
		Bassa
		Med
		Alta

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
-
-
Credit Quality %

Fond 0, Fond 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 %	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)	5,99 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.	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	LU2039786343		
NAV (04/02/2025)	USD 12,78				
Patrimonio Netto (Mln)	88,15 USD				

(31/12/2024)