

Franklin K2 Athena Uncorrelated Strategies UCITS Fund A USD Acc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Euribor 3 Month Yd USD

Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Fund is to seek to achieve long-term capital appreciation with lower volatility relative to the broader equity markets and substantially less correlation to traditional asset classes over a full market cycle. The Fund seeks to achieve its investment objective by pursuing various risk premia strategies, which for these purposes the Investment Manager considers to be systematic strategies that seek to profit from persistent behavioral and/or structural anomalies or other factors and which are developed by the Investment Manager and/or its affiliates or which are sourced from third-party broker-dealers.

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,94	3Y Sharpe Ratio	0,66
3Y Beta	-0,23	3Y Std Dev	9,27
3Y R-Squared	14,15	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,34	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	10,87	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,90	6,68	7,55
6-Mesi	6,22	8,29	9,28
1-Anno	9,67	12,02	12,14
3-Anni Ann.ti	9,02	5,64	8,94
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	6,53	1,66	-0,43	6,68
2023	-1,12	-0,79	6,70	-6,40
2022	3,99	12,34	5,80	-5,28
2021	-	-	0,47	1,60

Portafoglio 30/09/2024



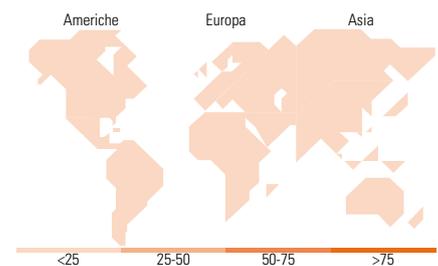
Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	0,07
● Liquidità	100,37
● Altro	-0,44

Fixed Income

Style Box™

		Qualità Credito	
		Alto	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa		
	Alta		

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	-



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills	-	16,10
Equity Trs, Index	-	0,27
Equity Trs, Index	-	0,10
2 Year Treasury Note Future...	-	0,08
Equity Trs, Index	-	0,03
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		16,58
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		4

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	16,10
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	82,41
📁 Derivati	1,49

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Franklin Templeton International Services S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	3,49 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000 USD
		(04/02/2025)		Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Telefono	+352 46 66 67 212	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,54%
Web	www.franklintempleton.lu	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,51%
Data di Partenza	18/06/2021	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	03/06/2024	ISIN	LU2303826205		

Franklin K2 Athena Uncorrelated Strategies UCITS Fund A USD Acc

NAV (04/02/2025)	USD 11,73
Patrimonio Netto (Mln)	120,41 USD

(30/09/2024)