

# Franklin K2 Cat Bond UCITS Fund Y USD Acc

**Categoria Morningstar™**

Obbligazionari Altro

**Benchmark Morningstar**

Not Categorized

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

**Morningstar Rating™**

Senza rating

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The Fund's investment objective is to seek to generate attractive risk-adjusted returns over time with limited correlation to other asset classes through investment in a portfolio of natural catastrophe bonds. The Investment Manager seeks to achieve the Fund's investment objective through a systematic, proprietary rules-based process. Return is sought from a managed composition of the portfolio based on a set of rules that narrows the universe of catastrophe bonds through a screening and scoring process.

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	1,01
3Y Beta	-	3Y Std Dev	8,02
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

**Rendimenti**


Rend. Cumulati %		Fondo	Rendimenti Trimestrali %			
			Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi		-7,89	-2,57	-	-	-
6-Mesi		0,96	6,24	1,77	2,18	11,35
1-Anno		5,59	1,71	3,56	7,28	-2,22
3-Anni Ann.ti		8,00	2,71	5,91	4,53	-7,20
5-Anni Ann.ti		-	-	-	2,93	2,92
10-Anni Ann.ti		-	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 16/04/2025

**Portafoglio 30/09/2024**


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	89,79
● Liquidità	10,21
● Altro	0,00

**Fixed Income Style Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Credit Quality %

Fond

Credit Quality %

Fond

0

0

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Sd Re Ltd	—	2,88
Gateway Re Ltd.	—	2,54
Everglades Re II Ltd	—	2,45
Queen Street 2023 Re DAC	—	2,41
International Bank for...	—	2,19
Everglades Re II Ltd	—	2,07
Ursa Re II Limited	—	2,06
Sakura Re Limited	—	1,96
Veraison Re Ltd.	—	1,94
Wrigley Re Limited	—	1,90
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		22,39
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		85

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
🏛️ Governativo	5,40
⚙️ Societario	84,26
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
👤 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	9,96
📑 Derivati	0,38
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
0 coupon	76,63
Da 0 a 4 cedole	3,26
Da 4 a 6 cedole	1,49
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	18,62

**Scadenze %**

	Fondo
da 1 a 3	68,98
da 3 a 5	7,88
da 5 a 7	1,27
da 7 a 10	3,45
da 10 a 15	0,00
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	0,00
oltre 30	0,00

**Anagrafica**

Società di Gestione	Franklin Templeton International Services S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	51,61 USD	Investimento Min. Ingresso	-
		(17/04/2025)		Investimento Min. Successivo	-
		Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,14%
Telefono	+352 46 66 67 212	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,11%
Web	www.franklintempleton.lu	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	18/06/2021	Inc/Acc	Acc		
Nome del Gestore	-	ISIN	LU2303827351		
Data Inizio Gestione	03/06/2024				
NAV (16/04/2025)	USD 13,69				
Patrimonio Netto (Mln)	139,54 USD				

(30/09/2024)