

Franklin K2 Athena Uncorrelated Strategies UCITS Fund I (acc) EUR

Risikoaufschläge LU2511869013 Factsheet. Stand: 31. Oktober 2024

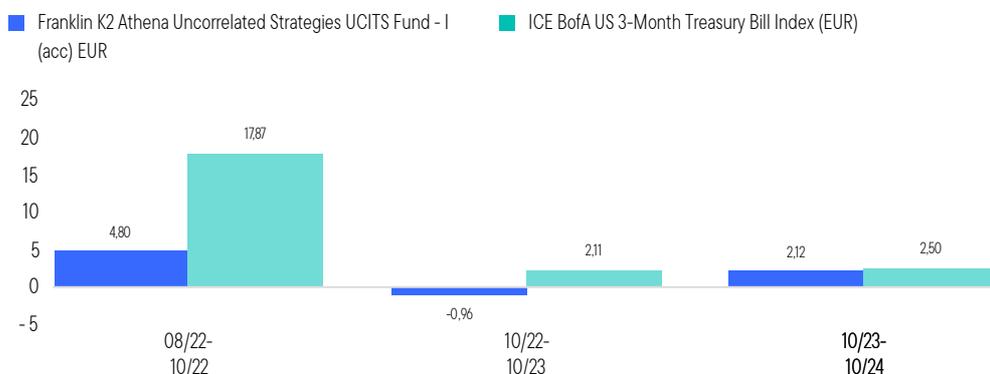
Dies ist eine Marketingmitteilung. Bitte lesen Sie vor jeder abschließenden Anlageentscheidung den Verkaufsprospekt des OGAW und das Basisinformationsblatt (BiB).

Zusammenfassung der Anlageziele

Der Fonds ist bestrebt, den Wert seiner Anlagen mittel- bis langfristig zu steigern. Dabei zielt er auf eine geringere Volatilität im Vergleich zu den Aktienmärkten insgesamt und auf eine geringere Korrelation mit herkömmlichen Anlageklassen ab. Der Fonds verfolgt eine aktiv verwaltete Anlagestrategie und investiert hauptsächlich in unkorrelierte Strategien. Dabei handelt es sich um systematische Handelsstrategien auf der Grundlage einer quantitativen Analyse von Kursen und Fundamentaldaten mittels intern oder extern entwickelter Algorithmen.

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftigen Renditen.

Wertentwicklung seit Auflegung (MiFID) in Währung der Anteilsklasse (%)



Wertentwicklung in Währung der Anteilsklasse (%)

	Kumuliert			Jährliche Wertentwicklung					Date		
	1 Monat	3 Monate	Lfd. Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Aufl.	3 Jahre		5 Jahre	
I (acc) EUR	1,63	0,57	10,19	2,12	—	—	6,00	—	—	2,70	25.8.2022
Vgl. Index (EUR)	2,73	0,79	6,00	2,50	—	—	1,73	—	—	0,79	—
Peer-Group-Durchschnitt	1,89	-1,00	6,44	3,04	—	—	0,44	—	—	0,20	—
Quartil-Ranking	3	2	1	3	—	—	—	—	—	—	—

Jährliche Erträge

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
I (acc) EUR	-1,23	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Vgl. Index (EUR)	1,81	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Peer-Group-Durchschnitt	0,78	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Der Wert der Anteile am Fonds und die damit erzielten Erträge können sowohl steigen als auch fallen und Anleger erhalten den ursprünglich investierten Betrag unter Umständen nicht vollständig zurück.

Wertentwicklung nach BVI-Methode in der jeweiligen Währung der Anteilsklasse. Berechnungsbasis: Nettoinventarwert, ohne Ausgabeaufschläge oder sonstige mit dem Kauf/Verkauf verbundene Depot- oder Transaktionskosten bzw. Steuern, die sich bei Berücksichtigung negativ auf die Wertentwicklung auswirken könnten. Ausschüttungen wieder angelegt. Bitte entnehmen Sie die tatsächlich anfallenden Kosten dem jeweiligen Preisverzeichnis der ausführenden/depotführenden Stelle. Angaben zum Index ("Benchmark") wurden lediglich zu Vergleichszwecken aufgeführt.

Fondsübersicht

Basiswährung des Fonds	USD
Auflegungsdatum des Fonds	18.06.2021
Auflegungsdatum d. Anteilsklasse	25.08.2022
ISIN	LU2511869013
WKN	A3DUGQ
Bloomberg-Ticker	FKBIAER LX
Morningstar Kategorie	Multistrategy USD
Mindestanlagebetrag (USD/EUR)	5.000.000

Benchmark(s) und Typ

ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index	Vergleichsindex
---	-----------------

Gebühren

Ausgabeaufschlag	0,00%
Austrittsgebühr	—
Laufende Kosten	0,90%
Erfolgsabhängige Vergütung	—

Die Gebühren stellt der Fonds den Anlegern in Rechnung, um die Kosten für den Betrieb des Fonds abzudecken. Zusätzliche Kosten, einschließlich Transaktionsgebühren, fallen ebenfalls an. Diese Kosten werden vom Fonds abgezogen und beeinflussen die Gesamterträge des Fonds. Die Fondsgebühren fallen in mehreren Währungen an, sodass die Zahlungen infolge von Wechselkursschwankungen unterschiedlich hoch sein können.

Fondsmerkmale

	Fonds
Rücknahmepreis-I (acc) EUR	€10,60
Fondsvolumen	\$124,27 Millionen
Anzahl der Emittenten - Short (ohne liquide Mittel)	408
Anzahl der Emittenten - Long (ohne liquide Mittel)	448
Standardabweichung (1 Jahr)	7,83%

Strategieallokation (in % des investierten Kapitals)

	Contribution
Hedge	0,34
Rates Multi-Style	0,05
Equity Momentum	0,05
Equity Flows	0,03
Rates Flows	-0,01
Equity Value	-0,02
FX Carry	-0,02
Equity Low Beta	-0,13
Cross Asset Trend	-0,50
FX Value	-0,69
Liquide Mittel	0,42

Engagement nach Anlageklasse (%)

	Long Exposition (% des NAV)	Short Exposition (% des NAV)	% der Risikoallokati on
Aktien	64,56	-40,97	66,67
Währung	54,59	-43,06	19,37
Staatsanleihen	21,40	-3,63	26,40
Liquide Mittel			-12,44

Fondsmanagement

	Unternehmens- zugehörigkeit (in	Branchenerfahrung (in Jahren)
Paul Fraynt	7	26
Robert Christian	14	34
Vaneet Chadha, CFA	12	18

Welche wesentlichen Risiken bestehen?

Der Fonds bietet weder eine Kapitalgarantie noch einen Kapitalschutz; Sie erhalten möglicherweise nicht den gesamten investierten Betrag zurück. Der Fonds unterliegt den folgenden Risiken, die von wesentlicher Relevanz sind: **Kontrahentenrisiko:** Das Risiko, dass Finanzinstitute oder andere Akteure (die als Kontrahenten von Finanzkontrakten agieren) ihren Verpflichtungen aufgrund von Insolvenz, Konkurs oder aus anderen Gründen nicht nachkommen. **Kreditrisiko:** Das Risiko eines Verlusts, der entsteht, wenn ein Emittent fällige Kapital- oder Zinszahlungen nicht leistet. Dieses Risiko ist höher, wenn der Fonds niedrig eingestufte Sub-Investment-Grade-Wertpapiere hält. **Liquiditätsrisiko:** Das Risiko, das entsteht, wenn negative Marktbedingungen die Möglichkeit beeinträchtigen, Vermögenswerte zu verkaufen, wenn dies notwendig ist. Dieses Risiko kann unter anderem durch unerwartete Ereignisse wie Naturkatastrophen oder Pandemien ausgelöst werden. Eine geringere Liquidität kann den Kurswert der Vermögenswerte beeinträchtigen. **Mit Derivaten verbundenes Risiko:** Das Risiko des Verlusts in Bezug auf ein Finanzinstrument, wenn eine geringfügige Veränderung des Werts einer Basisanlage einen größeren Einfluss auf den Wert des betreffenden Finanzinstruments haben kann. Derivate können zusätzlichen Liquiditäts-, Kredit- und Kontrahentenrisiken unterliegen. **Modellrisiko:** Möglicher Verlust als Folge von Entscheidungen, die hauptsächlich auf den Ergebnissen interner Modelle beruhen, und zwar aufgrund von Fehlern bei der Entwicklung, Umsetzung oder Verwendung solcher Modelle. Wenn sich das Modellrisiko bewahrheiten sollte, kann sich dies nachteilig auf die Wertentwicklung des Fonds auswirken. Vollständige Informationen über die Risiken einer Anlage in dem Fonds finden Sie im Verkaufsprospekt des Fonds.

Glossar

Ausgabeaufschlag: Der Ausgabeaufschlag ist bezogen auf die Nettoanlage. **Laufende Kosten:** Die Zahl zu den laufenden Gebühren (Ongoing Charges Figure, OCF) umfasst die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageverwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle gezahlten Gebühren und gewisse sonstige Aufwendungen. Die OCF wird wie folgt berechnet: Die wichtigsten relevanten Fondskosten, die im angegebenen Zwölfmonatszeitraum gezahlt wurden, geteilt durch das durchschnittliche Nettovermögen im selben Zeitraum. Die OCF enthält nicht alle vom Fonds gezahlten Aufwendungen (so sind zum Beispiel die Aufwendungen des Fonds für den Kauf und Verkauf von Wertpapieren nicht enthalten). Eine umfassende Liste der Kosten, die vom Fondsvermögen abgezogen werden, ist im Prospekt enthalten. Die aktuellen jährlichen Gesamtkosten sowie hypothetische Performance-Szenarien mit den Auswirkungen, die unterschiedliche Renditen auf eine Anlage in den Fonds haben könnten, sind dem Basisinformationsblatt zu entnehmen.

Vergleichsindex: Die Benchmark wird zum Vergleich der Wertentwicklung des Fonds herangezogen, stellt aber keine Beschränkung der Anlagen des Fonds dar. **Standardabweichung:** Kennzahl über das Ausmaß, in dem die Rendite eines Fonds von dem Durchschnitt früherer Renditen abweicht. Je höher die Standardabweichung ist, umso größer ist die Wahrscheinlichkeit (und das Risiko), dass die Wertentwicklung eines Fonds von der durchschnittlichen Rendite abweicht.

Informationen zu Portfoliodaten

Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente: Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente: 86,86 des Gesamtwerts per 31.10.2024. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente können zur gesamten Risikoallokation des Fonds beitragen, werden aber nicht als Vermögenswerte mit Risikoexposition bewertet.

Mit Wirkung zum 1. September 2023 hat sich der Referenzindex des Fonds geändert. Der neue Referenzindex ist der ICE BofA US 3-Month Treasury Bill Index.

Wichtige Fondsinformationen

Dies ist ein Teilfonds („Fonds“) von Franklin Templeton Alternative Funds („FTAF“), einer in Luxemburg eingetragenen SICAV. Die Zeichnung von Anteilen von FTAF darf nur auf der Grundlage des aktuellen Prospekts sowie, sofern verfügbar, des jeweiligen Basisinformationsblatts (BiB), zusammen mit dem jüngsten verfügbaren geprüften Jahresbericht und dem aktuellen Halbjahresbericht (falls dieser später veröffentlicht wurde), erfolgen. Diese Dokumente können Sie auf unserer Website www.franklinresources.com/all-sites herunterladen oder kostenlos bei Ihrem lokalen FT-Vertreter erhalten. Alternativ können sie über den European Facilities Service von FT unter www.eifs.lu/franklintempleton angefordert werden. Die Fondsdokumente sind in Englisch und Deutsch erhältlich. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte ist zudem hier erhältlich: www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights. Die Zusammenfassung ist in englischer Sprache verfügbar. Der bzw. die Teilfonds von FTAF sind in mehreren EU-Mitgliedstaaten für die Vermarktung gemäß OGAW-Richtlinie registriert. FTAF kann diese Registrierung für jede Anteilsklasse und/oder jeden Teilfonds jederzeit unter Anwendung des Verfahrens in Artikel 93a der OGAW-Richtlinie beenden. Wir weisen Sie darauf hin, dass Sie Anteile an dem Fonds erwerben und nicht unmittelbar in die zugrunde liegenden Vermögenswerte des Fonds investieren, wenn Sie sich für eine Anlage entscheiden.

Angesichts der vielfältigen Anlagemöglichkeiten, die heute zur Verfügung stehen, empfehlen wir Anlegern, einen Finanzberater zu konsultieren.

Vor dem 1. April 2024 hieß der Fonds Franklin K2 Athena Risk Premia UCITS Fund.

CFA® und Chartered Financial Analyst® sind Marken des CFA Institute.

© Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen (1) sind für Morningstar und/oder die Inhaltsanbieter von Morningstar urheberrechtlich geschützt, (2) dürfen nicht vervielfältigt oder verbreitet werden und (3) werden ohne Gewährleistung ihrer Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität zur Verfügung gestellt. Weder Morningstar noch deren Inhaltsanbieter sind verantwortlich für etwaige Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen entstehen.

Indizes werden nicht aktiv gemanagt. Es ist nicht möglich, direkt in einen Index zu investieren. Gebühren, Kosten oder Ausgabeaufschläge sind in den Indizes nicht berücksichtigt. Die Indexdaten, auf die hier Bezug genommen wird, sind Eigentum von Intercontinental Exchange („ICE“) und/oder ihrer Lizenzgeber und wurden zur Verwendung durch Franklin Templeton zugelassen. ICE und ihre Lizenzgeber übernehmen keine Haftung in Verbindung mit ihrer Verwendung.

In Deutschland und Österreich wird sie herausgegeben von Franklin Templeton International Services S.à r.l., Niederlassung Deutschland, Mainzer Landstraße 16, 60325 Frankfurt, 08 00/0 73 80 01 (Deutschland), 08 00/29 59 11 (Österreich), Fax: +49(0)69/2 72 23-120, info@franklintempleton.de, info@franklintempleton.at.

© 2024 Franklin Templeton. Alle Rechte vorbehalten.