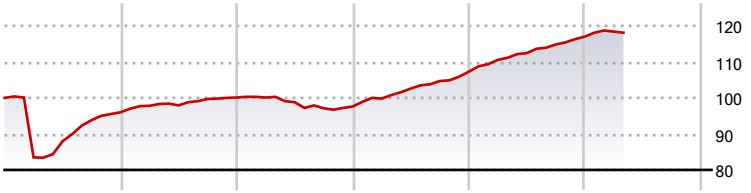
Franklin K2 Ellington Mortgage Income UCITS Fund EO PF (acc) EUR-H1

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Altro	Not Categorized Usato nel Report	HFRX RV Fixed Income AssetBacked(FF) USD	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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-04	
-3,98	4,25	-2,49	9,89	9,09	0,94	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	1,35
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,42
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,25
6-Mesi	2,59
1-Anno	6,44
3-Anni Ann.ti	5,69
5-Anni Ann.ti	7,27
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 02/05/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	1,19	-	-	-
2024	3,06	1,71	2,12	1,91
2023	2,24	2,79	2,04	2,47
2022	0,00	-1,29	-1,71	0,51
2021	1,87	0,10	1,83	0,40

Portafoglio 31/03/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	95,78
Liquidità	4,22
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Mortgage...	—	5,66
Accunia European Clo I Dac...	—	4,99
Lifetime Mortgage Funding 1...	—	4,48
CONNECTICUT AVENUE...	—	4,30
Federal Home Loan Mortgage...	—	4,26
TRICON RESIDENTIAL 2021-SFR1	—	3,73
Freddie Mac Stacr Trust...	—	3,65
Ares Euro CLO I B.V.	—	3,35
BLACKROCK MT HOOD CLO X LLC	—	3,13
Crown Point CLO 7 LTD/LLC	—	3,09
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		40,63
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		51

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,41
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	94,97
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	4,58
Derivati	0,04

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	6,36
Da 0 a 4 cedole	11,20
Da 4 a 6 cedole	14,01
Da 6 a 8 cedole	5,78
Da 8 a 10 cedole	19,12
Da 10 a 12 cedole	12,84
Oltre 12 cedole	30,68

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,17
da 5 a 7	10,04
da 7 a 10	13,97
da 10 a 15	25,06
da 15 a 20	17,51
da 20 a 30	31,80
oltre 30	1,45

Anagrafica

Società di Gestione	Franklin Templeton International Services S.à r.l.
Telefono	+352 46 66 67 212
Web	www.franklintempleton.lu
Data di Partenza	30/09/2019
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	30/09/2019
NAV (02/05/2025)	EUR 11,90
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2025)	64,79 USD

Patrimonio Classe (Mln) (02/05/2025)	5,44 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2039786269

Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
T.E.R.	-
Spese correnti	0,95%
Commissione di incentivo	-

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.