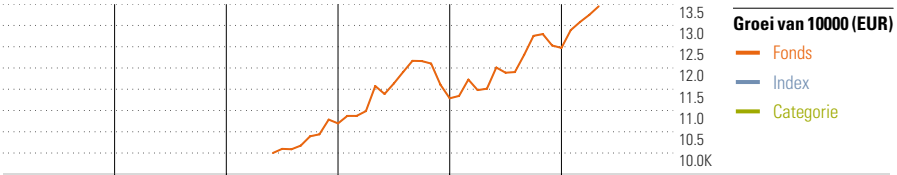
Franklin K2 Cat Bond UCITS Fund Y USD Acc

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	ICE LIBOR 3 Month USD	—	Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

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.



2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
-	-	-	5.52	10.50	7.84	Fonds
-	-	-	-	-	-	+/- Index
-	-	-	-	-	-	+/- Categorie
-	-	-	-	-	-	Percentiel Score

Risicomaatstaven			
Alpha	-	Sharpe Ratio	-
Beta	-	Std Deviatie	-
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-
Tracking Error	-	10-jr Risico	-

Rendementen (17 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.79	-	-
6 Maanden	5.24	-	-
1 jaar	11.89	-	-
3 jr gean.	-	-	-
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	6.24	-	-	-
2023	1.71	3.56	7.28	-2.22
2022	2.71	5.91	4.53	-7.20
2021	-	-	2.93	2.92

Portefeuille 30 sep 2023

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	82.05	0.00	82.05
Kas/ geldmarkt	74.94	56.99	17.95
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

Tijdsduur	-
Effectieve Looptijd	-
Gem Krediet Kwaliteit	-

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Sd Re Ltd	2.94
Long Point Re IV Ltd.	2.83
Cape Lookout Re Ltd.	2.79
Alamo Re Ltd	2.66
Gateway Re Ltd.	2.58
Everglades Re II Ltd	2.58
Queen Street 2023 Re DAC	2.51
Acorn Re Limited	2.21
Sakura Re Limited	2.00
Everglades Re II Ltd	1.98
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	73
% Van Vermogen In Top 10 Posities	25.09

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	59.02
3 tot 5 jaar	5.45
5 tot 7 jaar	0.00
7 tot 10 jaar	3.97
10 tot 15 jaar	0.00
15 tot 20 jaar	0.00
20 tot 30 jaar	0.00
Meer dan 30 jaar	0.00

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	69.94
0% tot 4%	5.91
4% tot 6%	0.00
6% tot 8%	0.00
8% tot 10%	7.51
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	16.64

Fondsinformatie

Fondsgroep	Franklin Templeton...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	+352 46 66 67 212	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	1,000
Website	www.franklintempleton.lu	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	18 jun 2021	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Robert Christian	ISIN	LU2303827351		
Aanvangsdatum	13 mei 2024				
Koers (17 mei 2024)	USD 12.09				
Fondsvermogen (mln)	USD 63.16				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.