

Franklin K2 Athena Risk Premia UCITS Fund

Klasse I (acc) EUR-H1¹ • ISIN LU2303826114 • Ein Teilfonds des Franklin Templeton Alternative Funds

Die Verwaltungsgesellschaft ist Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Ziele und Anlagepolitik

Der K2 Athena UCITS Fund (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 vornehmlich in:
• auf Risikoaufschläge ausgerichtete Strategien. Dabei handelt es sich um systematische Handelsstrategien auf der Grundlage einer quantitativen Analyse von Kursen und Fundamentaldaten mittels intern oder extern entwickelter Algorithmen.

Der Fonds beabsichtigt direkt oder indirekt (über Publikumsfonds, börsengehandelte Fonds, Derivate oder strukturierte Produkte) ein Engagement in einem breiten Spektrum aus übertragbaren Wertpapieren, Derivaten (zu Anlagezwecken, z. B. Total Return Swaps), Devisentermingeschäften (ein Austausch zweier Währungen zu einem festgelegten Kurs an einem Datum in der Zukunft) sowie anderen Wertpapieren, unter anderem Aktien und aktienbezogene Wertpapiere (darunter Genussscheine und wandelbare Wertpapiere), Schuldtitel jeder Qualität, die von staatlichen Emittenten weltweit ausgegeben werden, Währungen und in anderen zulässigen Wertpapieren. Das Investmentteam kann entscheiden, das gesamte Fondsvermögen in Schuldtiteln anzulegen, die von der EU, der OECD, von Singapur oder anderen G20-Mitgliedstaaten ausgegeben werden.

Der Referenzindex des Fonds ist der EURIBOR 3-Month Index. Der Referenzindex bietet den Anlegern lediglich eine Möglichkeit, die Wertentwicklung des Fonds zu vergleichen. Der Fonds ist nicht verpflichtet, Indexbestandteile zu halten, und kann bis zu 100 % seines Nettovermögens außerhalb der Benchmark anlegen.

Sie können den Verkauf Ihrer Anteile an jedem Luxemburger Geschäftstag beantragen.

Die aus den Anlagen des Fonds erhaltenen Erträge werden thesauriert, wodurch sich der Wert der Anteile erhöht.

Weitere Informationen über die Anlageziele und die Anlagepolitik des Fonds finden Sie im Abschnitt „Fondsinformationen, Anlageziele und Anlagepolitik“ des aktuellen Verkaufsprospekts von Franklin Templeton Alternative Funds.

Begriffserklärungen

Wandelbare Wertpapiere: Schuldtitel, die dem Anleger bei Fälligkeit die Option einräumen, im Austausch entweder Bargeld oder zu einem bestimmten Datum eine festgelegte Anzahl von Aktien des Emittenten zu beziehen.

Derivate: Finanzinstrumente, deren Beschaffenheit und Wert auf der Wertentwicklung eines oder mehrerer Basiswerte beruhen; typischerweise von Wertpapieren, Indizes, Währungen oder Zinssätzen.

Risiko- und Ertragsprofil



Was bedeutet diese Kennzahl und was sind ihre Grenzen?

Diese Kennzahl zeigt Ihnen die Kursbewegungen der entsprechenden Anteilsklasse auf der Grundlage historischer Daten.

Es handelt sich hierbei um keinen zuverlässigen Hinweis auf das zukünftige Risikoprofil des Fonds. Es kann nicht garantiert werden, dass die angezeigte Kategorie fortan unverändert bleibt. Sie kann sich im Laufe der Zeit ändern.

Die niedrigste Kategorie ist nicht gleichbedeutend mit völliger Risikofreiheit.

Da für die Anteilsklasse keine ausreichenden Daten zur Entwicklung in der Vergangenheit vorliegen, wurden stattdessen simulierte Daten, die auf einem repräsentativen Portfoliomodell oder Referenzwerten basieren, verwendet.

Warum ist der Fonds dieser spezifischen Kategorie zugeordnet?

Das Anlageziel soll mit Anlagen in einer großen Bandbreite an zulässigen Wertpapieren und Derivaten erreicht werden, die von verschiedenen auf Risikoaufschläge ausgerichteten Strategien profitieren. Wertpapiere und Anlageinstrumente dieser Art unterliegen erfahrungsgemäß Kursbewegungen, die in der Regel auf Zinsänderungen, die wahrgenommene Kreditwürdigkeit der Wertpapieremittenten oder Bewegungen an den Aktien- und/oder Devisenmärkten zurückzuführen sind. Aufgrund dessen kann die Wertentwicklung des Fonds im Laufe der Zeit erheblich schwanken.

Risiken von erheblicher Relevanz, die von der Kennzahl nicht angemessen erfasst werden:

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.

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.

Fremdwährungsrisiko: Das Risiko eines Verlusts aufgrund von Wechselkurschwankungen oder aufgrund von devisenrechtlichen Bestimmungen.

Risiko einer starken Hebelwirkung: Das Risiko, dass die zulässige Nutzung eines erheblichen Maßes an Hebelung einen Fonds dazu veranlassen kann, Portfoliopositionen zur Erfüllung seiner Verpflichtungen dann zu liquidieren, wenn dies möglicherweise nicht vorteilhaft ist. Dadurch kann eine relativ geringe Preisbewegung in einem Derivatekontrakt zu erheblichen Verlusten für einen Fonds führen.

Betriebliches Risiko: Das Risiko von Verlusten durch Fehler oder Versäumnisse von Personen, Systemen, Dienstleistern oder Prozessen, von denen der Fonds abhängig ist.

Umfassende Informationen über alle für den vorliegenden Fonds geltenden Risiken finden Sie im Abschnitt „Risikoabwägungen“ des aktuellen Verkaufsprospekts von Franklin Templeton Alternative Funds.

Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten werden für die laufende Verwaltung des Fonds verwendet, einschließlich für Vermarktung und Vertrieb der Fondsanteile. Diese Kosten verringern das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

Ausgabeaufschläge	Entfällt
Rücknahmeaufschläge	Entfällt

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, vor der Investition von Ihrer Anlage abgezogen wird.

Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden.

Laufende Kosten	0.90%
------------------------	-------

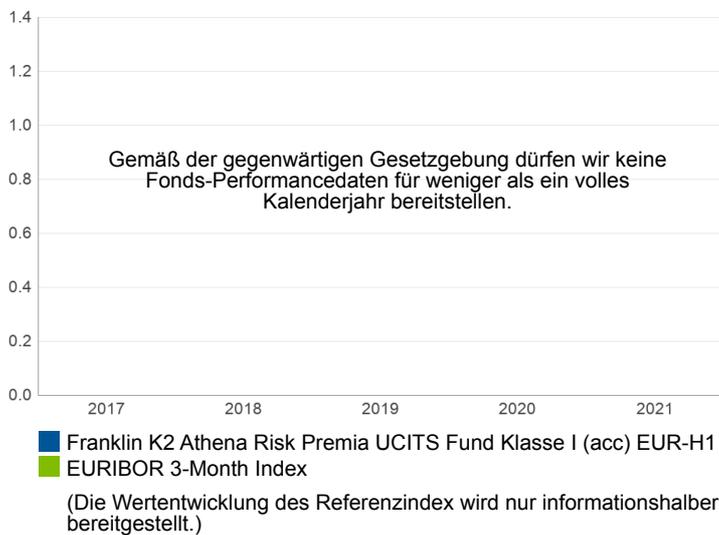
Kosten, die unter bestimmten Umständen vom Fonds abgezogen werden.

Erfolgsgebühren	Nicht zutreffend
------------------------	------------------

Die laufenden Kosten basieren auf den Aufwendungen für das Kalenderjahr zum 31. Juli 2022. Dieser Wert kann von Jahr zu Jahr schwanken.

Ausführliche Informationen zu den Gebühren finden Sie (gegebenenfalls) in den Abschnitten „Anteilsklassen“ und/oder „Erfolgsgebühren“ sowie in Anhang E des aktuellen Prospekts von Franklin Templeton Alternative Funds.

Wertentwicklung in der Vergangenheit



- Der Fonds wurde im Jahr 2021 aufgelegt.

Praktische Informationen

- Die Verwahrstelle von Franklin Templeton Alternative Funds ist die J.P. Morgan SE, Luxembourg Branch.
- Exemplare des aktuellen Verkaufsprospekts sowie der letzten Jahres- und Halbjahresberichte von Franklin Templeton Alternative Funds stehen in der Sprache des vorliegenden Dokuments auf der Website www.ftidocuments.com zur Verfügung und können kostenlos bei Franklin Templeton International Services S.à r.l., rue Albert Borschette 8A, L-1246 Luxembourg, Luxemburg oder bei Ihrem Finanzberater angefordert werden.
- Die aktuellen Anteilspreise und sonstige Informationen über den Fonds (einschließlich anderer Anteilsklassen des Fonds) erhalten Sie bei Franklin Templeton International Services S.à r.l., 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg oder unter www.franklintempleton.lu.
- Beachten Sie bitte, dass die Steuergesetze, die im Großherzogtum Luxemburg gelten, Einfluss auf Ihre persönliche steuerliche Lage haben können. Bitte sprechen Sie mit Ihrem Finanz- oder Steuerberater, bevor Sie sich zu einer Anlage entschließen.
- Franklin Templeton International Services S.à r.l. kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Verkaufsprospekts des Fonds vereinbar ist.
- Der vorliegend beschriebene Fonds ist ein Teilfonds von Franklin Templeton Alternative Funds. Der Verkaufsprospekt und die Finanzberichte beziehen sich auf alle Teilfonds von Franklin Templeton Alternative Funds. Bei allen Teilfonds von Franklin Templeton Alternative Funds sind Vermögenswerte und Verbindlichkeiten getrennt. Aufgrund dessen wird jeder Teilfonds separat verwaltet.
- Wie im Verkaufsprospekt weiter ausgeführt wird, können Sie Ihre Anteile in Anteile eines anderen Teilfonds von Franklin Templeton Alternative Funds umtauschen.
- Die Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik (einschließlich unter anderem einer Beschreibung dessen, wie Vergütungen und Vergünstigungen berechnet werden und der Identität der für die Zuteilung der Vergütungen und Vergünstigungen verantwortlichen Personen sowie der Zusammensetzung des Vergütungsausschusses) sind auf www.franklintempleton.lu verfügbar und ein Druckexemplar ist kostenlos erhältlich.

Der vorliegend beschriebene Fonds ist im Großherzogtum Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert. Franklin Templeton International Services S.à r.l. ist im Großherzogtum Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert. Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 16/08/2022.