



富兰克林邓普顿投资基金 (SICAV) 富蘭克林 K2 另類策略基金

Alternative
29.02.2024

基金单张

基金概览

基金货币	USD
基金总资产 (USD)	649 百万
成立日期	15.09.2014
基准	洲际交易所美银3个月美国国库券指数, HFRX全球对冲基金指数
晨星类别™	多元策略 (USD)

最低投资

股份类别	首次	后续
A (acc) USD	USD 1,000	USD 500
A (acc) SGD-H1	SGD 1,000	SGD 500
A (Ydis) EUR-H1	USD 1,000	USD 500

投资目标摘要

基金投资目标是寻求相对于广泛的股票市场的较低波幅的资本增值。通过多种非传统或“可替代”策略，对基金资产进行分配，来实现基金的投资目标。

基金经理

Brooks Ritchey: 美国
Robert Christian: 美国
Anthony M Zanolta, CFA: 美国

战略配置 (占投资资本的百分比(%))

	目标	实际
股票长短仓	25-40	28.48
事件导向	10-30	6.88
相对价值	30-45	36.82
全球宏观	0-30	27.81

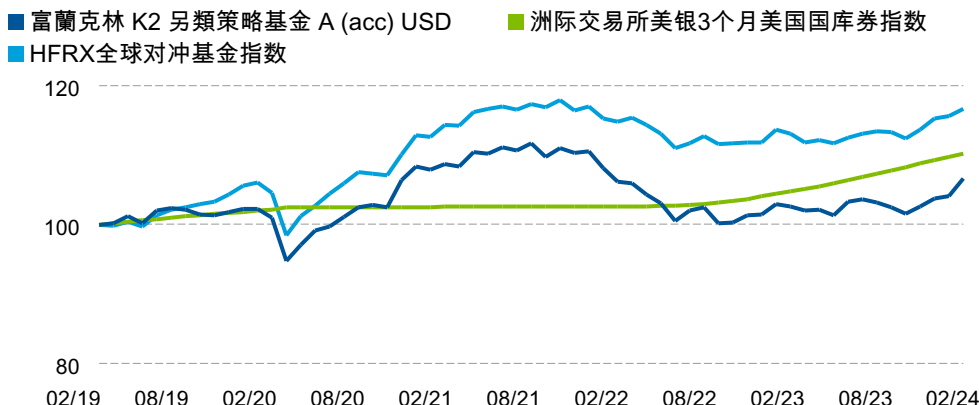
投资组合投资项目 (占总数%)

总持仓	231.56
净持仓	63.86
长仓	147.18
短仓	-83.96

表现

过往表现不能用于预测未来的回报。

过往5年表现 (根据股份类别货币计算) (%)



表现 (根据股份类别货币计算) (%)

	累积		年初至今		自成立至今	年率	
	1 个月	3 个月	1 年	3 年	自成立至今	3 年	自成立至今
A (acc) USD	2.39	3.90	2.74	3.90	20.01	-0.63	1.95
扣除首次销售费*	-2.73	-1.30	-2.40	-1.30	14.01	-2.31	1.40
洲际交易所美银3个月美国国库券指数 USD	0.41	1.31	0.84	5.22	14.15	2.43	1.41
HFRX全球对冲基金指数 USD	0.92	2.64	1.24	3.15	14.46	0.68	1.44
A (acc) SGD-H1	2.19	3.46	2.46	2.28	16.50	-1.23	1.63
扣除首次销售费*	-2.92	-1.71	-2.66	-2.83	10.68	-2.90	1.08
洲际交易所美银3个月美国国库券指数 USD	0.41	1.31	0.84	5.22	14.15	2.43	1.41
A (Ydis) EUR-H1	2.25	3.47	2.47	1.93	-4.70	-2.30	-0.54
扣除首次销售费*	-2.86	-1.70	-2.65	-3.17	-9.47	-3.96	-1.12
洲际交易所美银3个月美国国库券指数 USD	0.41	1.31	0.84	5.22	14.14	2.43	1.51

Top Exposures (占总数%)

长仓 (仅股票)

发行机构 (股票)

CONSTELLATION ENERGY CORP	0.81
ENERGY HARBOR CORP	0.76
VERTIV HOLDINGS CO	0.70
CRH PLC	0.67
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	0.66

短仓 (仅股票)

发行机构 (股票)

EAGLE BULK SHIPPING INC	-0.51
EXXON MOBIL CORP	-0.46
STXE 600 UTILITIES EUR	-0.41
PHILA UTILITY INDEX	-0.37
MONGODDB INC	-0.36

股份类别资料 (以查看提供股份类别的完整列表, 请浏览您当地的网站 www.franklintempleton.com.sg.)

股份类别	成立日期	单位净值	总开支比率 (%)	费用	
				最高认购费 (%)	最高年费 (%)
A (acc) USD	15.09.2014	USD 12.00	2.75	5.00	2.55
A (acc) SGD-H1	15.09.2014	SGD 11.65	2.75	5.00	2.55
A (Ydis) EUR-H1	24.04.2015	EUR 9.53	2.75	5.00	2.55

其他股份类别资料

股份类别	成立日期	认购	派息	代号	Bloomberg ID	ISIN
			频率			
A (acc) USD	15.09.2014	现金	不适用		FKASAAU LX	LU1093756168
A (acc) SGD-H1	15.09.2014	现金	不适用		FKAAASH LX	LU1093756325
A (Ydis) EUR-H1	24.04.2015	现金	每年		FTFASAE LX	LU1212701707

基金组合

基金经理配置	占投资资本的百分比(%)	相对价值 (续)	占投资资本的百分比(%)
股票长短线	28.48		
Electron Capital Partners, LLC	14.27	Lazard Asset Management, LLC	10.97
Jennison Associates, LLC	7.29	K2/D&S Management Co., LLC	10.41
ActusRayPartners Limited	6.92	全球宏观	27.81
事件导向	6.88	Graham Capital Management, L.P.	10.74
Bardin Hill Investment Partners L.P.	6.88	Capital Fund Management SA	10.50
相对价值	36.82	BlueBay Asset Management, LLP	6.58
Apollo SA Management, LLC	15.44		

存在哪些主要风险？

基金的价值和获得的收入可能下降或上涨，投资者可能无法收回全部投资金额。基金表现也可能受货币波动的影响。货币波动可能会影响海外投资的价值。本基金力求通过跨多种"另类投资"策略分配资产和投资于广泛的资产,实现其目标投资目标。由于股市普遍波动、利率突然变化或商品价格波动等因素,这类资产和投资工具历来受到价格波动的影响。基金将寻求使用对冲策略来限制波动。因此,基金的业绩可能会随着时间的推移而适度波动。其他主要风险包括：信用风险，衍生工具风险，流动性风险，操作风险，目标回报风险。有关本基金的所有风险的详细信息，请参阅富兰克林邓普顿投资基金当前招股说明书中基金的“风险考虑”部分。

免责声明

本基金已根据《金融服务业（欧盟）2019/2088 可持续性相关披露条例》第 8 条分类。这些基金采用 ESG 整合方法，此外，在其投资过程中还具有连结环境和/或社会的特征。
本广告或出版物并未经新加坡金融管理局审核。

本文件仅供参考，并不构成投资建议或建议，也并未考虑任何接收本文件人士之特定目标，财务状况及需要。本文件未经富兰克林邓普顿事先书面许可，不得复制或分发。

本文件所载的任何研究和分析皆由本行就其本身的用途而取得，并且可就此采用，附带提供予阁下。虽然本文件中提供的信息是从富兰克林邓普顿认为可靠的来源获得，但不能保证其准确性，并且这些信息可能不完整或压缩，并且随时可能更改，恕不另行通知。所表达的任何观点均为截至本文之截至日期之基金经理的观点，并不构成投资建议。本文的基本假设和观点可因应市场及其他情况修改并可能与其他投资组合经理或公司整体的观点或有不同。

任何对经济、股市、债券市场或不同市场的经济趋势的预测或推算，并不一定代表将来或可能的表现。富兰克林邓普顿并不负责任何因使用本文或其所载的任何评论、意见或估计而导致直接或间接后果性的损失。

投资价值及收益可升或跌，阁下有机会不能收回全部的投资金额。过往表现或任何预测或推算不保证基金将来的表现。认购基金份额时只可以根据由Templeton Asset Management Ltd. 或其授权分销商提供的最新基金说明书(Prospectus)及产品介绍清单(Product Highlights Sheet)。决定认购或购买基金前，投资者应仔细阅读基金说明书(Prospectus)和产品介绍清单(Product Highlights Sheet)。在任何未经授权的邀请或作出邀请的人士不符合资格或向任何人士作出邀请即属违法之情况下，本文件并不构成对任何人士于任何司法权区内作出该等要约或邀请。尤其是本基金不对美国及加拿大居民和公民开放。

在作出投资基金股份的承诺前，投资者可能希望向财务顾问寻求意见。若投资者选择不寻求财务顾问的意见，他或她应考虑该基金是否适合自己。

Franklin K2 Alternative Strategies Fund 是富兰克林邓普顿投资基金的子基金和卢森堡注册的SICAV。

免责声明 (续)

此外，投资者权利摘要可从<https://www.franklintempleton.com.sg/summary-of-investors-rights.pdf>获得。该摘要为英文版本。富兰克林邓普顿投资基金系列的子基金根据 UCITS 指令在多个欧盟成员国进行营销通知。富兰克林邓普顿投资基金系列可以使用 UCITS 指令第 93a 条中包含的流程随时终止任何股份类别和/或子基金的此类通知。

为避免疑问，如果您决定投资，即代表您将购买本基金的单位/股份，并不是直接投资于本基金的相关资产。

Copyright© 2024。富兰克林邓普顿。版权所有。发行人为 Templeton Asset Management Ltd.，注册编号为(UEN) 199205211E。

本文所提及之指数数据均归洲际交易所（“ICE”）及 / 或其许可商所有，且已经许可供富兰克林邓普顿使用。洲际交易所及其许可商概不就该使用承担任何责任。如欲了解免责声明的完整副本，请登录www.franklintempletondatasources.com。

资料来源：HedgeMark。

请浏览 www.franklinresources.com/datasources 可了解更多资料提供商的资讯参阅更多资料提供者资料。

服务表现：回报率以基金份额类别货币计算并包含股息再投资。同一个基金内个别股的表现将有差异，请向基金经理索取相关资料。

当投资组合或其基准表现已被转换时，可以在投资组合及其基准间使用不同的外汇收盘利率。

基金费用：本基金向投资者收取一定费用，以支付本基金的营运成本。并且还会产生额外的费用，包括交易费等。这些费用由本基金支付，这将影响到本基金的整体回报。基金费用将以多种货币产生，这也代表成本可能因货币汇率波动而增加或减少。

基金经理：CFA® 及 Chartered Financial Analyst® 为特许金融分析师协会拥有的商标。

策略配置：实际配置是指截至期限结束时占基金经理（副投资顾问或联席基金经理）的投资资本百分比。目标配置截至期限结束。

基金可随时改动策略之配置。此外，K2 可全权酌情决定不将投资分配于一个或以上的策略，或加入新策略。因此，以上目标配置仅供说明用途，不应视为未来基金投资组合（及其经理）组成部分之预测，且可能随时有所变动。

比重占基金经理(副投资顾问或联席基金经理)的投资资本百分比。因调整至最接近之数值，总和或不等于100%。资料为历史数据，并不反映现时或未来的投资组合。所有投资项目可能有所变动。所有投资组合项目可能有所变动。

投资组合持仓：所示数据反映投资组合中的个别衍生工具(或其相关资产)，因调整至最接近之数值、应用衍生工具、未完成之交易或其他因素，总和或不等于100%或可能为负数。

扣除首次销售费*：首次销售费 - 5%；货币市场基金 - 0%

主要持仓：五大长短持仓代表 Franklin K2 Alternative Strategies Fund 于截至所示日期内，所持的五大长短仓股票发行机构。发行机构之持仓包括透过应用衍生工具，所得的实际证券持仓及单一证券持仓。综合直接证券投资项目及衍生工具持仓作计算用途。这些投资项目及衍生工具并不代表所有买入、卖出及推荐予投资顾问客人之证券，读者不应假设投资于这些上述发行机构的证券曾经或将会获利。

基金组合：

基金经理配置：基金经理名单包括已被委任为副投资顾问或投资基金经理。K2 可全权酌情决定不将投资分配于一个或以上的投资经理，或加入新的投资经理。因此，基金经理名单仅供说明用途，不应视为未来基金投资组合组成部分之预测，且可能随时有所变动。

比重占基金经理(副投资顾问或联席基金经理)的投资资本百分比。因调整至最接近之数值，总和或不等于100%。资料为历史数据，并不反映现时或未来的投资组合。所有投资项目可能有所变动。所有投资组合项目可能有所变动。